MEFFStation
FICHEROS DE DATOS DE LIQUIDACIÓN

BME CLEARING S/MART v12.33

9 de enero de 2025

Historia de Revisiones

FECHA ACTUALIZACIÓN	VERSIÓN	DESCRIPCIÓN	AUTOR
9 de octubre 2023	11.27	Cambios en ficheros CPLEDGES, CALLOCAS y CALLOCBs. Nuevo fichero CCOLLATERALFEES.	BME Clearing Architecture
10 de enero 2024	11.30	Cambios en ficheros CCPCOLLATERALFEES, CPHYSDEL, CDELIVESETTL y CPHYSDELDETS. Nuevo fichero CPHYSDELFEES.	BME Clearing Architecture
21 de febrero 2024	11.30	Cambios en ficheros CASHMOVBRKD, CCPCASHMOVCC, CCPALLOCAS, CCPMARGINSCLM y CCPCASHMOVCLM Cambio en fichero CCPCOLLATERALFEES	BME Clearing Architecture
14 de marzo 2024	11.32	Cambios en fichero CVALARRAYS. Cambios en fichero CCONTRSTAT. Cambios en fichero CCPCOLLATERALFEES.	BME Clearing Architecture
17 de abril 2024	12.32	Cambios en el fichero CMARGINACCOUNTS. Se cambia la numeración del Documento por razones técnicas internas.	BME Clearing Architecture
8 de julio 2024	12.33	Cambios en el fichero CCONTRSTAT y en CVARMARGIN.	BME Clearing Architecture
9 de enero de 2025	12.33	Nuevos valores admitidos y nuevas descripciones de valores en campo Periodicity en CCONTRTYP	BME Clearing Architecture

Sensitivity: C2 Internal

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.

© 2023 BME. Todos los derechos reservados.

Sensitivity: C2 Internal

Índice

1 INTRODUCCIÓN 12

1.1 Alcance 12

1.2 Estructura del documento 12

1.3 Convenciones utilizadas en este documento 13

1.4 Futuras versiones de este documento 15

2 DATOS GENERALES 17

2.1 Entorno de liquidación 17

2.2 Estado 18

2.3 Festivos 19

2.4 Entidades participantes 20

2.5 Subgrupos de contratos 21

2.6 Tipos de contrato 22

2.7 Contratos 24

2.8 Contratos estado “baja” 26

2.9 Códigos internos de contratos 27

2.10 Tipos de operación 28

2.11 Activos subyacentes 29

2.12 Códigos resultantes para cascada teórica 30

2.13 Detalle de códigos resultantes para la cascada 31

2.14 Parametrización para cálculo de comisiones por diferimiento 32

3 INFORMACIÓN PÚBLICA DIARIA 33

3.1 Información diaria de contratos 33

3.2 Divisas 35

3.3 Tipos a utilizar para el cálculo de los flujos de diferimiento 36

4 DATOS PRIVADOS DE CONFIGURACIÓN 37

4.1 Cuentas de posición 37

4.2 Cuentas de garantías 39

4.3 Cuentas de colateral 40

4.4 Cuentas de colateral a nivel ECC 41

4.5 Referencias de Give-Out 42

Sensitivity: C2 Internal

4.6 Referencias de Give-In 43
4.7 Filtros de aceptación de Give-In para Miembro Destino 44
4.8 Filtros de aceptación de Give-In para Compensador de Miembro Destino....45
4.9 Relaciones Proveedor de Liquidez con Demandantes xRolling 46
4.10 Ajustes por eventos corporativos sobre xRolling....47

5 DATOS PARA CÁLCULO DE GARANTÍAS....48
5.1 Parámetros de la matriz de garantías 48
5.2 Compensación intra-matriz....49
5.3 Compensación inter-matriz....50
5.4 Precios teóricos (con el criterio de cálculo institucional) 51
5.5 Precios teóricos (con el criterio de cálculo minorista)....52
5.6 Deltas (con el criterio de cálculo institucional)....53
5.7 Deltas (con el criterio de cálculo minorista) 54
5.8 Curva de tipos de interés 55
5.9 Dividendos....56
5.10 Skew de volatilidades....57

6 DATOS PARA CÁLCULO DE GARANTÍAS – MODELO DE ESCENARIOS....59
6.1 Parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición 59
6.2 Parametrización correspondiente al ajuste por tamaño de la posición 61
6.3 Buffer (Factor de riesgo) y factor de decaimiento 62
6.4 Parametrización del modelo de cálculo de Stress 63
6.5 Escenarios en el cálculo de garantías por posición y de Stress Test 64
6.6 Calendario de sesiones en que no se aplica ajuste técnico 65
6.7 Garantías por 1 contrato....66

7 OPERACIONES....67
7.1 Operaciones 67
7.2 Operaciones que no liquidan en la sesión 70

8 GESTIÓN DE OPERACIONES 73
8.1 Operaciones vivas 73
8.2 Asignaciones y traspasos realizados 75
8.3 Give-Outs....76

Sensitivity: C2 Internal

8.4 Give-Ins para miembro Destino 77
8.5 Give-Ins para Compensador de Miembro Destino....79

9 POSICIÓN ABIERTA 81
9.1 Saldo de posición abierta por cuenta de posición 81
9.2 Saldo de posición abierta por cuenta de garantías....82
9.3 Saldo de posición abierta virtual por cuenta de posición 83
9.4 Saldo de posición abierta virtual por cuenta de garantías....84
9.5 Saldo de posición abierta Proveedor de Liquidez con Demandantes de xRolling 85
9.6 Saldo de posición abierta Demandante de xRolling con Proveedor de Liquidez....86
9.7 Ajustes de posición....87

10 EJERCICIO – VENCIMIENTO – ENTREGA 88
10.1 Peticiones de ejercicio de opciones 88
10.2 Operaciones de contado del Miembro 89
10.3 Operaciones de contado desglosadas por cuenta de garantías 90
10.4 Operaciones de contado desglosadas por cuenta de posición....91
10.5 Títulos entregables....93
10.6 Detalle de entrega física de gas 95
10.7 Nominaciones para entrega física de gas a nivel de EIC 96
10.8 Detalle de la tarifa de entrega física de productos de gas....96

11 COMISIONES....98
11.1 Detalle de comisiones 98
11.2 Comisiones 100
11.3 Comisiones por diferimiento....101
11.4 Comisiones Ajuste de posición....103
11.5 Comisiones Colateral....104

12 RESULTADOS A NIVEL DE CUENTA DE POSICIÓN 106
12.1 Primas de opciones 106
12.2 Variation Margin 107
12.3 Variation Margin pendiente....109
12.4 Valoración para productos sin liquidación diaria de variation margin 111
12.5 Resultado cálculo flujos de diferimiento....113

Sensitivity: C2 Internal

12.6 Pagos compensatorios 114

13 RESULTADOS A NIVEL DE CUENTA DE GARANTÍAS 115

13.1 Detalle del cálculo de garantía diaria 115

13.2 Liquidaciones y garantías por cuenta de garantías y divisa liquidable 117

13.3 Información de las Pruebas Retrospectivas 118

13.4 Información de las Pruebas de Resistencia 119

13.5 Liquidación de entregas de gas por cuenta de garantías 120

13.6 Liquidaciones y garantías por cuenta de garantías y divisa de cálculo 121

13.7 Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de garantías – modelo de escenarios 122

13.8 Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de garantías y subyacente – modelo de escenarios 124

13.9 Detalle del cálculo de garantía por posición mínima por cuenta de garantías y subyacente – modelo de escenarios 126

13.10 Información de las Pruebas de Resistencia a nivel cuenta de garantías – modelo de escenarios 127

13.11 Garantías exigidas por cuenta de garantías no asociadas a cuentas de posición 128

14 REGISTRO DE DETALLE. RESULTADOS A NIVEL DE CUENTA DE RESULTADOS POR CUENTA DE COLATERAL A NIVEL ECC 129

14.1 Liquidaciones y garantías por cuenta de colateral 129

14.2 Detalle de las Garantías depositadas 130

14.3 Detalle por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo 132

14.4 Resumen agregado por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo 133

14.5 Información de las Pruebas de Resistencia a nivel cuenta de colateral – modelo de escenarios 134

14.6 Garantías exigidas y colateral depositado por cuenta de colateral no asociadas a cuentas de posición 135

14.7 Previsión del colateral asignado a cada cuenta de colateral para la siguiente sesión 136

14.8 Colateral asignado a cada cuenta de colateral 138

15 REGISTRO DE DETALLE. RESULTADOS A NIVEL DE CUENTA DE POSICIÓN 140

15.1 Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de posición 140

15.2 Liquidaciones y garantías por cuenta de posición y divisa liquidable 142

15.3 Liquidaciones y garantías por cuenta de posición y divisa de cálculo 143

15.4 Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de posición – modelo de escenarios 144

Sensitivity: C2 Internal

15.5 Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de posición y subyacente – modelo de escenarios 145

15.6 Detalle del cálculo de garantía por posición mínima por cuenta de posición – modelo de escenarios 147

16 RESULTADOS PARA MIEMBROS COMPENSADORES 148

16.1 Garantías requeridas al Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central 148

16.2 Movimientos de efectivo para el Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central 151

16.3 Información del Riesgo de Concentración del Miembro Compensador – modelo de escenarios 152

16.4 Información de las Pruebas de Resistencia a nivel miembro – modelo de escenarios 153

17 RESULTADOS PARA AGENTES DE PAGO 154

17.1 Movimientos de efectivo para el Agente de Pagos a nivel de Contrapartida Central 154

Sensitivity: C2 Internal

Índice de Ficheros

CCLEARINGHOUSE.ch 17
CSTATUS.ch 18
CHOLIDAYS.ch 19
CENTITIES.ch 20
CCONTRGRP.ch 21
CCONTRTYP.ch 22
CCONTRACTS.ch 24
CCONTRDEL.ch 26
CCONTRCODES.ch 27
CTRADETYP.ch 28
CUNDERLYINGS.ch 29
CCONTRREL.ch 30
CCONTRRELDET.ch 31
CDEFERRALFEEPAR.ch 32
CCONTRSTAT.ch 33
CCCURRENCY.ch 35
CDEFERRALFLOWPAR.ch 36
CACCOUNTS.ch 37
CMARGINACCOUNTS.ch 39
CCOLLATERALACCOUNTS.ch 40
CCPCOLLATERALACCOUNTS.ch 41
CGIVEOUTREF.ch 42
CGIVEINREF.ch 43
CGIVEINFILT.ch 44
CGIVEINFILTCLM.ch 45
CRELPLDR.ch 46
CADJUSTMENTS.ch 47
CVALARRAYS.ch 48
CINTRASPR.ch 49
CINTERSPR.ch 50
CTHEORPRICES.ch 51
CTHEORPRICES_RETAIL.ch 52
CDELTAS.ch 53
CDELTAS_RETAIL.ch 54
CYIELDCURVE.ch 55

Sensitivity: C2 Internal

CDIVIDENDS.ch 56
CVOLATILITYSKEW.ch 57
CMARGINPARAMETERS.ch 59
CLIQUIDITYMARGIN.ch 61
CIMFACTORS.ch 62
CSTRESSTESTPARAMETERS.ch 63
CSCENARIOS.ch 64
CROLLINGCALENDAR.ch 65
CIMSINGLEPOSITION.ch 66
CTRADES.ch 67
CTRADESNL.ch 70
CHISTTRADES.ch 73
CTRANSFTRADES.ch 75
CGIVEOUT.ch 76
CGIVEIN.ch 77
CGIVEINCLM.ch 79
COPENPOSITION.ch 81
CMARGINOPENPOSITION.ch 82
COPENPOSITIONREL.ch 83
CMARGINOPENPOSITIONREL.ch 84
COPENPOSITIONPL.ch 85
COPENPOSITIONDR.ch 86
CPOSADJUST.ch 87
CEXERCISERQT.ch 88
CSPOTTRADES.ch 89
CSPOTTRADESBRKD.ch 90
CSPOTTRADESBRKDDET.ch 91
CDELIVERABLES.DB 93
CPHYSDELDETS.ch 95
CPHYSDEL.ch 96
CPHYSDELFEES.ch 96
CFEESBRKD.ch 98
CFEES.ch 100
CDEFERRALFEE.ch 101
CPOSADJFEE.ch 103
CCPCOLLATERALFEES.ch 104

Sensitivity: C2 Internal

CPREMIUMS.ch 106
CVARMARGIN.ch 107
CVARMARGINPEND.ch 109
CVALUATIONOTH.ch 111
CDEFERRALFLOW.ch 113
CCOMPPAYMENT.ch 114
CINIMARGINCALC.ch 115
CACCOUNTSETTL.ch 117
CBACKTESTING.ch 118
CSTRESSTESTING.ch 119
CDELIVESETTL.ch 120
CACCOUNTSETTLCCY.ch 121
CTOTALINITIALMARGIN.ch 122
CINIMARGINCALCSCENARIO.ch 124
CMARGINFLOORCALC.ch 126
CMARGINFLOORCALC.ch 127
CREQMARGM.ch 128
CCPACCOUNTSETTL.ch 129
CCPPLEDGES.ch 130
CCPCASHMOVBRKD.ch 132
CCPCASHMOVCC.ch 133
CSTRESSTESTINGSCENARIOCOLAC.ch 134
CCPREQMARGM.ch 135
CCPALLOCAS.ch 136
CCPALLOCBS.ch 138
CINIMARGINCALCDET.ch 140
CACCOUNTSETTLDET.ch 142
CACCOUNTSETTLCCYDET.ch 143
CTOTALINITIALMARGINDET.ch 144
CINIMARGINCALCSCENARIODET.ch 145
CMARGINFLOORCALCDET.ch 147
CCPMARGINSCLM.ch.XML 148
CCPCASHMOVCLM.ch 151
CCONCENTRATIONRISK.ch 152
CTOTALSTRESSTESTING.ch 153
CCPCASHMOVTREAS.ch 154

Sensitivity: C2 Internal

1 Introducción

1.1 Alcance

Este documento tiene como objetivo la descripción técnica de los ficheros de datos que pueden ser generados desde un terminal de BME CLEARING con funciones de liquidación.

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

1.2 Estructura del documento

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

En los capítulos restantes se definen los ficheros agrupándolos funcionalmente.

- Datos generales: características del entorno, y contratos.
- Información pública diaria: datos públicos resultantes de la operativa de la sesión.
- Datos privados de configuración: características de la configuración de cuentas (de posición, garantías y colateral) y referencias de Give-Up de un Miembro.
- Datos para Cálculo de Garantías: datos empleados por los algoritmos publicados de cálculo y compensación de garantías, y valoraciones de precios y deltas.
- Datos para Cálculo de Garantías – modelo de escenarios: datos empleados por los algoritmos publicados de cálculo de garantías en el modelo de escenarios.
- Operaciones: detalle de las operaciones del día y de las operaciones de días anteriores susceptibles de traspaso.
- Gestión de operaciones: acciones de asignación, traspaso o Give-Up efectuadas sobre las operaciones.
- Posición abierta: estado de la posición y ajustes efectuados a la misma.
- Ejercicio – Vencimiento: peticiones de ejercicio y posibles entregas de acciones.
- Garantías depositadas: datos relativos a las garantías depositadas.
- Comisiones: datos relativos al importe de comisiones a liquidar.
- Resultados a nivel de cuenta de posición: datos relativos a la negociación, primas de opciones y valoraciones de futuros, forwards y swaps.
- Resultados a nivel de cuenta de garantías: datos relativos a las garantías exigidas, primas de opciones, comisiones y valoraciones de futuros, forwards y swaps.
- Resultados a nivel de cuenta de colateral: datos relativos a las garantías exigidas y depositadas.

Sensitivity: C2 Internal

- Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición: datos relativos a las garantías exigidas, así como a la negociación, primas de opciones y valoraciones de futuros, forwards y swaps, y posibles entregas de acciones.

- Resultados para Miembros Compensadores: datos a nivel de Miembro Compensador relativos a las garantías exigidas y depositada, y datos finales de movimientos de efectivo.

- Resultados para Agentes de Pago: ficheros relativos a los movimientos de efectivo de liquidación para la Entidad Domiciliataria.

1.3 Convenciones utilizadas en este documento

1.3.1 Información general de cada fichero

Para cada fichero contenido en este documento se presenta una primera tabla como la descrita a continuación. Esta tabla presenta la información genérica del fichero con el siguiente formato:

	(1)
Grupo	(2)
Descripción	(3)
Destinatarios	(4)
Privacidad	(5)
Timing	(6)

(1) – Nombre del fichero tal y como es generado. Todos los ficheros tienen como extensión el código de entorno correspondiente (genéricamente, “ch”).

(2) - Grupo al que pertenece el fichero

(3) – Descripción del fichero

(4) – Destinatarios del fichero

(5) – Informa de si el fichero contiene datos públicos o privados

(6) – Informa del momento en que el fichero está disponible, cuándo varía y la forma de actualización de los registros

1.3.2 Definición de ficheros planos

En los ficheros planos se incluye una segunda tabla que describe el formato y contenido de los campos que componen cada uno de los registros del fichero.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)

Sensitivity: C2 Internal

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

(2) - Contiene “” cuando el campo forma parte de la clave del fichero

(3) – Nombre del campo

(4) – Tipo del campo según lo descrito en el apartado 1.3.4

(5) – Valores válidos o rango de valores

(6) – Descripción del campo

En los ficheros planos los campos están separados por el carácter punto y coma (“;”).Los registros de cada uno de los ficheros están delimitados por los caracteres CR, LF.

1.3.3 Definición de ficheros XML

Para los ficheros XML se informa de la ubicación del esquema XSD relacionado y su versión. También se incluye una tabla que describe el formato y contenido de los posibles elementos de su estructura.

#	Elemento	Valores válidos	Descripción
(1)	(2)	(3)	**(4)**

(1) - Número de elemento dentro de la tabla de definición. Para ayudar al seguimiento de esta tabla, se utiliza numeración multinivel (ejemplo: 1, 1.1, 1.2, 2, 3, 3.1, 3.2, 3.2.1, 3.2.2 ...). No obstante, dentro de un nivel los elementos en el fichero pueden aparecer en cualquier orden, ya que vienen identificados por el nombre de elemento en el correspondiente tag.

(2) – Nombre del elemento XML

(3) – Valores válidos o rango de valores

(4) – Descripción del campo

1.3.4 Tipos de datos

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

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

- **int:** Secuencia de dígitos sin separadores de miles ni decimales y opcionalmente con signo (caracteres ASCII “**-**“ y “**0**” – “**9**”. El carácter signo utiliza un byte (es decir, int es “ **99999**” mientras que int negativo es “**-99999**”. Téngase en cuenta que valores int pueden representar cifras que empiecen por ceros (es decir “**00023**” = “**23**”).

Sensitivity: C2 Internal

- **float:** Secuencia de dígitos, opcionalmente con coma decimal y signo (caracteres ASCII "**-**" , "**0**" – "**9** y "**,**"); la ausencia de la coma decimal en el valor del campo debe interpretarse como la representación "float" de un valor entero. Todos los campos float tendrán como máximo **quince dígitos significativos (no se tendrán en cuenta ni el signo ni la coma decimal)**. El número de decimales usados será un factor de las necesidades del negocio. Téngase en cuenta que los valores float pueden representar cifras que empiecen por ceros (es decir "**00023**" = "**23**") y pueden contener u omitir ceros al final después de la coma decimal (es decir "**23,0**" = "**23,0000**" = "**23**").
    - Qty: Campo float capaz de almacenar un número completo (sin decimales) de "contratos".
    - Price: Campo float que representa un precio. Téngase en cuenta que el número de decimales puede variar.
    - Amt: Campo float que representa un importe. Téngase en cuenta que el número de decimales puede variar.

- **char:** campo de un único carácter. Puede contener cualquier carácter alfanumérico o de puntuación excepto el delimitador. Todos los campos char son sensibles a mayúsculas/minúsculas (es decir, **m** ≠ **M**) y están delimitados por comillas (**'**).

- **String:** Cadena de caracteres alfanuméricos. Puede incluir cualquier carácter alfanumérico o de puntuación excepto el delimitador. Todos los campos String son sensibles a mayúsculas/minúsculas (es decir, **ref** ≠ **Ref**) y están delimitados por comillas (**'**). La anotación "String(n)" se utiliza para indicar el máximo número de caracteres en el campo String. En algunos casos, "n" implica el número exacto de caracteres y, en este caso se especificará concretamente bajo la columna "Valores válidos".
    - **Currency:** Campo String que representa una divisa utilizando los valores definidos en la norma ISO 4217 Currency code (3 caracteres).

      Ver "Tabla 1 – Códigos de divisa" en documento "Tablas de Codificación".
    - **LocalDate:** Fecha local en formato AAAAMMDD.

      Valores válidos: AAAA = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31.
    - **LocalTime:** Hora local en formato HH:MM:SS

      Valores válidos: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59
    - **LongLocalTime:** Hora local en formato HH:MM:SS.XXXXXX

      Valores válidos: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59, XXXXXX = 000000-999999

1.4 Futuras versiones de este documento

1.4.1 Nuevos campos

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

1.4.2 Campos eliminados

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

Sensitivity: C2 Internal

1.4.3 Nuevos ficheros

Este documento puede ser modificado en un futuro para incluir nuevos ficheros.

1.4.4 Resaltando cambios

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

Sensitivity: C2 Internal

2 Datos Generales

En este grupo se localizan los ficheros de carácter público que definen las características del entorno de liquidación, grupo de contratos y sus contratos.

2.1 Entorno de liquidación

CCLEARINGHOUSE.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información genérica del entorno de liquidación
Destinatarios	Todos los usuarios del entorno de liquidación
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	EnvironmentCode	String(2)	Ver Tabla 11 en documento "Tablas de codificación"	Código de contrapartida central o grupo de contratos
3		EnvironmentDescription	String(75)		Texto descriptivo de la contrapartida central o grupo de contratos

Sensitivity: C2 Internal

2.2 Estado

CSTATUS.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Estado del conjunto de los ficheros
Destinatarios	Todos los usuarios del entorno de liquidación
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, varía una vez finalizada la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	EnvironmentCode	String(2)		Código de contrapartida central o grupo de contratos
3		FileStatus	char	1: Sesión 2: Fin sesión	Estado de los ficheros

Sensitivity: C2 Internal

2.3 Festivos

CHOLIDAYS.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Calendario de festivos de liquidación
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	HolidayDate	LocalDate		Fecha del festivo
4		RegistrationOpen	Char	S/N	Abierto a registro

Sensitivity: C2 Internal

2.4 Entidades participantes

CENTITIES.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información pública de las entidades que intervienen en el grupo de contratos
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	EntityCode	String(4)		Código de la Entidad Participante en el grupo de contratos
4		EntityType	char	ver Tabla 7 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de la Entidad Participante
5		EntityDescription	String(75)		Nombre de la Entidad Participante
6		EntityECBCode	String(6)		Código de la Entidad Participante en el Banco Central Europeo
7		LEI	String(20)		LEI de la entidad

Sensitivity: C2 Internal

2.5 Subgrupos de contratos

CCONTRGRP.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Subgrupos de contratos del grupo Su contenido es equivalente al de las tablas 13 y 14 del documento "Tablas de Codificación"
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de Contratos
3	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)		Subgrupo de contrato
4		ContractSubgroupDescription	String(20)		Descripción del subgrupo de contratos
5		ContractSubgroupUnderlying	String(22)	Ver tabla 14 en documento "Tablas de codificación"	Código de contrato de contado del subgrupo

Sensitivity: C2 Internal

2.6 Tipos de contrato

CCONTRTYP.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Tipos de contratos del subgrupo de contratos
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
4	🗝	ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato
5		ContractTypeDescription	String(20)		Descripción del tipo de contrato
6		PriceMultiplier	float		Multiplicador que debe aplicarse al precio del contrato
7		Nominal	Amt		Nominal de los contratos de este tipo
8		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que se expresa el precio de los contratos de este tipo. En los contratos de divisa es la divisa cotizada o segunda del par.
9		CalcMethod	char	"1"=Black-76 "2"=Binomial "3"=Black Scholes	Método de cálculo de precios para los contratos de este tipo
10		FILLER	String(6)		
11		ContractFamily	String(5)	ver Tabla 20 en documento "Tablas de Codificación"	
12		AII	String(12)		Identificador AII
13		PriceType	Int	1 = Precio 2= Rentabilidad	
14		SecurityType	String(1)	"E"= Strategy "F"=Future "G"=xRolling "M"=Forward "O"=Option "R"=Roll-over "W"=Swap "S"=Spot "X"=Other	Tipo de producto
15		FlexibleIndicator	String(1)	"Y" – No estándar "N" - Estándar	Para indicar si es estándar o no
16		ExerciseStyle	String(1)	"A"- Americano "E" - Europeo	Tipo de Ejercicio

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
17		SettMethod	String(1)	"P" – física "C" - cash	Método de liquidación
18		PutorCall	String(1)	"P" – Put "C" - Call	Tipo de opción
19		Periodicity	String(1)	"Y" – Anual "H" - Semestral "S"- Temporada "Q" – Trimestral "M" – Mensual "m" – Resto de mes "K" – Semanal (L-D) "k" – Resto de semana "B" – Semanal (L-V) "E" – Semanal (S-D) "D" – Diario (excepto Futuro GNL TTF) "d" – Diario (Futuro GNL TTF) "A" – Mensual (Auxiliar)	
20		AdjustmentsRule	String(1)	"E" – Sólo extraordinarios "T" - Todos	Tipo de ajuste
21		CFICode	String(6)	ver Tabla 10 en documento "Tablas de Codificación"	CFICode oficial EMIR Reporting
22		UnitOfMeasure	Char(20)		Unidad de medida del multiplicador
23		BaseCurrency	Char(3)	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que se expresa el nominal de los contratos de este tipo. En los contratos de divisa es la divisa base o primera del par.
24		SettlCurrency	Char(3)	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa a la que se convertirán las liquidaciones de estos contratos

Sensitivity: C2 Internal

2.7 Contratos

CCONTRACTS.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información general de los contratos del grupo de contratos disponibles en la sesión
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en

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

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
21		SpotMaturityDate	LocalDate		Para los contratos con diferimiento, es la fecha teórica de vencimiento del spot. En general, D+2.
22		ClosingPositionType	String(1)	M: En mercado C: Por comprador V: Por vendedor A: Por ambos	Indica si la posición se podrá cerrar por parte de las contrapartidas en una fecha anterior a la fecha de vencimiento.
23		BuyReferenceRate	String(1)	S: €STR F: Fis Analytics M: Coste de préstamo MEFF 0: Cero ' ': No aplica	Tipo de referencia financiación en compras. En FLEX sólo se informará uno de los dos lados (compras o ventas), el correspondiente a la contrapartida financiada.
24		BuyReferenceRateMarkup	float	-100.0000 to 100.0000	Markup sobre tipo de referencia en compras En porcentaje con signo y 4 decimales
25		SellReferenceRate	String(1)	S: €STR F: Fis Analytics M: Coste de préstamo MEFF 0: Cero ' ': No aplica	Tipo de referencia financiación en ventas En FLEX sólo se informará uno de los dos lados (compras o ventas), el correspondiente a la contrapartida financiada.
26		SellReferenceRateMarkup	float	-100.0000 to 100.0000	Markup sobre tipo de referencia en ventas En porcentaje con signo y 4 decimales
27		DividendPercentageApplied	float	0.00-100.00	Porcentaje flujo de liquidación de dividendos En porcentaje sin signo y 2 decimales..
28		DividendDateOffset	int	0-999	Diferencial de fecha de pago/ cobro del flujo de dividendo ordinario 0 indica fecha exdate 999 indica fecha efectiva de pago
29		RetailArrayCode	String(3)		Código de matriz de garantias para el cálculo de minoristas
30		RetailExpirySpan	char	Códigos:A..Z, 0..9	Tipo de vencimiento usado para el cálculo de garantías para minoristas

Sensitivity: C2 Internal

2.8 Contratos estado “baja”

CCONTRDEL.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información de contratos dados de baja
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		ISINCode	String(12)		Código ISIN del contrato a efectos informativos. Puede no estar presente.

Sensitivity: C2 Internal

2.9 Códigos internos de contratos

CCONTRCODES.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Códigos internos de los contratos
Destinatarios	Todos los Operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato Largo
4		ContractInternalCode	String(8)		Código interno de contrato

Sensitivity: C2 Internal

2.10 Tipos de operación

CTRADETYP.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información sobre los tipos de operación tratados en el grupo de contratos
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TradeType	char	ver Tabla 12 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de operación
4		TradeTypeDescription	String(20)		Descripción del tipo de operación

Sensitivity: C2 Internal

2.11 Activos subyacentes

CUNDERLYINGS.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información de los activos subyacentes
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		UnderlyingISINCode	String(12)		Código ISIN del activo subyacente
5		UnderlyingDescription	String(20)		Descripción del activo subyacente
6		UnderlyingContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos en que está listado el activo subyacente
7		CFICode	String(6)		Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962.
8		AssetType	String(3)	Ver tabla 2 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de activo
9		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa del activo
10		ExpiryDate	LocalDate		Fecha de vencimiento del activo
11		LastAuctionDate	LocalDate		Fecha de última subasta del activo
12		StartCouponDate	LocalDate		Fecha en la que el activo empieza a devengar cupón. Sólo para bonos y obligaciones
13		CouponNo	int	> 0 y <= 12	Número de cupones anuales. Sólo para bonos y obligaciones
14		Coupon	Float		Cupón en porcentaje del nominal. Sólo para bonos y obligaciones
15		CalcMethod	Char	1 = Base real	Método de cálculo del cupón corrido, dependiendo de la forma de estimar el número de días entre las fechas de pago de cupón entre las que está comprendida la fecha de cálculo. Sólo para bonos y obligaciones Base real: Se tiene en cuenta el número de días real entre las fechas de pago de cupón

Sensitivity: C2 Internal

2.12 Códigos resultantes para cascada teórica

CCONTRREL.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de que en el grupo de
Destinatarios	Todos los Operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

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

Sensitivity: C2 Internal

2.13 Detalle de códigos resultantes para la cascada

CCONTRRELDET.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Detalle de la relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de que en el
Destinatarios	Todos los Operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato original
4		MaturityDate	LocalDate		Fecha de vencimiento
5		CascadeDate	LocalDate		Fecha de cascada real
6		Nominal	Amt		Nominal del contrato
7		UnitOfMeasure	Char(20)		Unidad de medida del multiplicador
8		ContractInitialDate	LocalDate		Fecha inicial del contrato. En Energía es la fecha inicial del período de entrega del contrato inicial.
9		ContractFinalDate	LocalDate		Fecha final del contrato. En Energía es la fecha final del período de entrega del contrato inicial.
10		NumberOfRelatedContracts	Int		Número de relaciones que se definen a continuación. Máximo 31.
11.1		RelatedContractCode	String(22)		Código de contrato resultante
11.2		RelatedMaturityDate	LocalDate		Fecha de vencimiento
11.3		RelatedNominal	Amt		Nominal del contrato
11.4		RelatedContractInitialDate	LocalDate		Fecha inicial del contrato. En Energía es la fecha inicial del período de entrega del contrato resultante.
11.5		RelatedContractFinalDate	LocalDate		Fecha final del contrato. En Energía es la fecha final del período de entrega del contrato resultante.

Sensitivity: C2 Internal

2.14 Parametrización para cálculo de comisiones por diferimiento

CDEFERRALFEEPAR.ch	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Parámetros para el cálculo de la comisión por diferimiento
Destinatarios	Todos los Operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

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

Sensitivity: C2 Internal

3 Información Pública Diaria

En este grupo se localizan los ficheros de carácter público que contienen los datos diarios resultantes de la operativa de la sesión.

3.1 Información diaria de contratos

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

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		HighPrice	Price		Precio alto de la sesión
5		LowPrice	Price		Precio bajo de la sesión
6		FirstPrice	Price		Primer precio de la sesión
7		LastPrice	Price		Último precio de la sesión
8		SettlPrice	Price		Precio de liquidación en la sesión
9		SettlVolatility	float		Volatilidad de liquidación al cierre de la sesión. Este campo no está informado para opciones largas.
10		SettlDelta	float		Delta de liquidación al cierre de la sesión. Este campo no está informado para opciones largas.
11		PreviousDaySettlPrice	Price		Precio de liquidación en la sesión anterior. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de liquidación del contrato.
12		PreviousDaySettlVolatility	float		Volatilidad de liquidación al cierre de la sesión anterior. Este campo no está informado para opciones largas. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de liquidación del contrato.
13		PreviousDaySettlDelta	float		Delta de liquidación al cierre de la sesión anterior. Este campo no está informado para opciones largas.

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
					Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de liquidación del contrato.
14		TotalRegVolume	Qty		Volumen total registrado
15		NumberOfTrades	int		Número de operaciones registrado
16		OpenInterest	Qty		Posición abierta
17		AccruedInterest	Price		Cupón corrido incorporado al precio de liquidación de la sesión. Sólo para bonos y obligaciones
18		Yield	Price		
19		ReferencePrice	Price		Precio Forward para FX. Precio de referencia para los contratos entregables para Gas
20		PreviousReferencePrice	Price		Precio Forward para FX. Precio de referencia para los contratos entregables para Gas
21		NextDaySwapPoints	Price		Puntos Swap aproximados para la siguiente sesión
22		DiscountFactor	Float		Factor de descuento

Sensitivity: C2 Internal

3.2 Divisas

CCCURRENCY.ch	
Grupo	Información pública diaria
Descripción	Divisas utilizadas en la cámara, tipos de cambio a la divisa base de la Cámara.
Destinatarios	Todos los Operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Currency	String(3)	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa cotizada o segunda del par.
4		BaseCurrency	String(3)	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa base o primera del par.
5		ConversionRate	Price		Tipo de cambio de conversión a la divisa base de la Cámara.

Sensitivity: C2 Internal

3.3 Tipos a utilizar para el cálculo de los flujos de diferimiento

CDEFERRALFLOWPAR.ch	
Grupo	Información pública diaria
Descripción	Tipos a utilizar para el cálculo de los flujos de diferimiento
Destinatarios	Todos los Operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión

#	*	FIELD	TYPE	VALID VALUES	DESCRIPTION
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Session date
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Contract Group code
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato Contract Code
4		BuyDeferralFlowRate	Float		Expresado en tanto por ciento, con 4 decimales. Puede ser negativo. Para los contratos estándar será el €STR.
5		SellDeferralFlowRate	Float		Expresado en tanto por ciento, con 4 decimales. Puede ser negativo. Para los contratos estándar será el €STR.
6		BuyReferenceRateMarkup	Float		Mark up para la compra. Expresado en tanto por ciento, con 4 decimales
7		SellReferenceRateMarkup	Float		Mark up para la venta. Expresado en tanto por ciento, con 4 decimales
8		Stockborrowrate	Float		Tipo de interés del préstamo Expresado en tanto por ciento, con 4 decimales
9		BuyReferenceRateLP	Float		Tipo resultante si el PL está comprado, con 4 decimales
10		SellReferenceRateLP	Float		Tipo resultante si el PL está vendido, con 4 decimales
11		BuyReferenceRateXR	Float		Tipo resultante si el DR está comprado, con 4 decimales
12		SellReferenceRateXR	Float		Tipo resultante si el DR está vendido, con 4 decimales
13		DeferralDays	int		Número de días de diferimiento

Sensitivity: C2 Internal

4 Datos Privados de Configuración

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado que detallan las características de la configuración de cuentas y referencias de Give-Up de un Miembro.

4.1 Cuentas de posición

CACCOUNTS.ch	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Información de las cuentas de posición disponibles en el grupo de contratos
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
6		FILLER	String(4)		Filler (contenido no relevante)
7		FILLER	String(4)		
8		AccountClass	char	ver Tabla 18 en documento "Tablas de Codificación"	Clase de la cuenta de posición
9		FILLER			
10		FILLER	char		Filler (contenido no relevante)
11		ResidualAccount	String(5)		Este campo sólo es significativo cuando el registro se refiere a una cuenta diaria. Cuenta de posición a la que se moverán las operaciones pendientes de asignar una vez finalizada la prórroga de asignación de cuenta diaria
12		FILLER	char		Filler (contenido no relevante)
13		Active	Char	"S"=Sí "N"="No	Indica si la cuenta de posición está vigente o no
14		AuthEntity	Char		Entidad Autorizada a la que pertenece la cuenta de posición
15		HolderType	String(2)	Ver Tabla 17 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de persona
16		MarginAccount	String(3)		Cuenta de garantías Antiguo campo ClearingGroup, que se reinterpreta como Cuenta de Garantías.

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
					Nota: Campo que se eliminará en futuras versiones, equivale al nuevo campo MarginAccount (campo 23)
17		TakeUpFirm	String(4)		Miembro ECC destino para entrega de acciones
18		AllocText	String(18)		Referencia asignación para entrega de acciones
19		FirmMnemonic	String(10)		Mnemotécnico para entrega de acciones
20		RVPositionAccount	String(3)		Cuenta de posición ECC para entrega de acciones
21		SIBEClient	String(16)		Código de cliente SIBE para entrega de acciones
22		MarginAccountMember	String(4)		Miembro de la cuenta de garantías
23		MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
24		RiskReducingPositionIndicator	Char	S=Si N=No Blancos	En los segmentos con derivados sobre commodities sujetos a MiFID II, indica si por defecto las posiciones incluidas en esta cuenta de posición reducen o aumentan riesgo
25		PropClient	Char	C=Cliente P=Propia	Tipo de cuenta de posición desde el punto de vista del miembro de mercado
26		EICCode	String(16)		
27		GrossOrNet	String (1)	G: Bruto N:Neto	Tipo de anotación
28		TitEICCode	String(1)	S=Si N=No	Titularidad EICCode
29		TypeEntity	String(1)	N – No Aplica I – Cliente Institucional M – Cliente minorista B – Proveedor Liquidez	Tipo de Entidad

Sensitivity: C2 Internal

4.2 Cuentas de garantías

CMARGINACCOUNTS.ch	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Información de las cuentas de garantías disponibles en el grupo de contratos
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro de la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
5		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
6		CollateralAccountMember	String(4)		Miembro cuenta de colateral
7		CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
8		MarginType	String(2)	IM: Initial Margin IF: individual Fund DF: Default Fund EM: Extraordinary margins	
9		MarginBufferPercentage	Float		Buffer en porcentaje sobre el total exigido con criterio institucional o minorista
10		RegulatorMargin	String(1)	S/N	N = No afectado por Restricciones Regulatorias S = Sí afectado por Restricciones Regulatorias
11		**MarginCalcType**	**String(1)**	**G: Bruto N: Neto**	**Tipo de cálculo de garantías**

Sensitivity: C2 Internal

4.3 Cuentas de colateral

CCOLLATERALACCOUNTS.ch	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Información de las cuentas de colateral disponibles en el grupo de contratos
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro cuenta de colateral
4	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
5		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
6		TreasuryEntity	String(4)		Agente de pagos
7		CashMovGroup	String(8)		Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos.
8		CashAdjType	String(1)	N: Buffer Y: Ajuste efectivo automático D: ajuste sólo déficit	Tipo ajuste Efectivo
9		ReinvestmentIndicator	String(1)	S/N	Indicador de reinversión
10		AccountStructName	String(12)		Referencia estructura de cuenta
11		StructureType	String(2)	ver Tabla 19 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de estructura
12		Model	String(1)	P – p-t-p A – agency N – No Aplica	Modelo
13		IndirectClearing	String(1)	S=Si N=No	Indicador de Clearing Indirecto

Sensitivity: C2 Internal

4.4 Cuentas de colateral a nivel ECC

CCPCOLLATERALACCOUNTS.ch	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Información de las cuentas de colateral disponibles a nivel Código de contrapartida central
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro cuenta de colateral
4	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
5		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
6		TreasuryEntity	String(4)		Agente de pagos
7		CashMovGroup	String(8)		Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos.
8		CashAdjType	String(1)	N: Buffer A: No Aplica	Tipo ajuste Efectivo
9		ReinvestmentIndicator	String(1)	S/N	Indicador de reinversión
10		AccountStructName	String(12)		Referencia estructura de cuenta
11		StructureType	String(2)	ver Tabla 19 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de estructura
12		Model	String(1)	N: No Aplica	Modelo
13		IndirectClearing	String(1)	S=Si N=No	Indicador de Clearing Indirecto

Sensitivity: C2 Internal

4.5 Referencias de Give-Out

CGIVEOUTREF.ch	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Referencias de Give-Out definidas en el sistema por el Miembro Origen
Destinatarios	Miembro Origen
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	GiveOutMember	String(4)		Miembro Origen, que configura las referencias del Give-Out
4	🗝	GiveOutMnemonic	String(10)		Mnemotécnico al que se ha asociado un Miembro Destino y una referencia de Give-Up
5		GiveUpReference	String(18)		Referencia de Give-Up. Es una referencia común para Miembros Origen y Destino que tiene como objeto identificar la operación
6		GiveInMember	String(4)		Miembro Destino del Give-Up asociado al mnemotécnico del registro
7		GiveOutInternalRef	String(18)		Referencia asignada por el Miembro Origen para uso interno y que se asocia al mnemónico de give-out. Una misma referencia interna puede estar asociada a más de un mnemónico. Puede no estar informada

Sensitivity: C2 Internal

4.6 Referencias de Give-In

CGIVEINREF.ch	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Referencias de Give-In definidas en el sistema por el Miembro Destino
Destinatarios	Miembro Destino
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	GiveInMember	String(4)		Miembro Destino, que configura las referencias de Give-In
4	🗝	GiveOutMember	String(4)		Miembro Origen del Give-Up
5	🗝	GiveUpReference	String(18)		Referencia de Give-Up. Es una referencia común para Miembros Origen y Destino que tiene como objeto identificar la operación
6		GiveInMnemonic	String(10)		Mnemotécnico asignado por el Miembro Destino a la combinación de Miembro Origen y referencia de Give-Up del registro. Puede no estar informado
7		GiveInAccount	String(5)		Cuenta de posición destino en la que debe registrarse el Give-In en caso de ser aceptado

Sensitivity: C2 Internal

4.7 Filtros de aceptación de Give-In para Miembro Destino

CGIVEINFILT.ch	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Filtros de aceptación Give-In establecidos por el Miembro Destino
Destinatarios	Miembro Destino
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	GiveInMember	String(4)		Miembro Destino, que configura los filtros de Give-In
4	🗝	GiveOutMember	String(4)		Miembro Origen del Give-Up, para el cual, junto con la referencia, se define el filtro
5	🗝	GiveUpReference	String(18)		Referencia para la que, junto con el código de Miembro Origen del Give-Up, se define el filtro
6		TransactionAmtLimit	Amt		Importe máximo para un Give-In que será aceptado automáticamente para ese Miembro Origen y referencia. Este campo no estará cumplimentado cuando el filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe máximo específico a comprobar
7		SessionAmtLimit	Amt		Importe acumulado máximo por sesión de Give-Ins que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Origen y referencia. Este campo no estará cumplimentado cuando el filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe máximo específico a comprobar

Sensitivity: C2 Internal

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

CGIVEINFILTCLM.ch	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Filtros de aceptación Give-In establecidos por el Miembro Compensador del Miembro Destino
Destinatarios	Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador del destino del Give-In
4	🗝	GiveInMember	String(4)		Miembro Destino del Give-In
5	🗝	GiveInAccount	String(5)		Cuenta de posición destino del Give-In
6		TransactionAmtLimit	Amt		Importe máximo para un Give-In que será aceptado de forma automática para ese Miembro Destino y cuenta de posición. Este campo no estará cumplimentado cuando el filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe máximo específico a comprobar
7		SessionAmtLimit	Amt		Importe acumulado máximo por sesión de Give-Ins que serán aceptados automáticamente para ese Miembro Destino y cuenta de posición. Este campo no estará cumplimentado cuando el filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe máximo específico a comprobar

Sensitivity: C2 Internal

4.9 Relaciones Proveedor de Liquidez con Demandantes xRolling

CRELPLDR.ch	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Relaciones Proveedores de Liquidez con Clientes o Demandantes XRolling
Destinatarios	Miembro Proveedor Liquidez y Miembro Clientes
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	DRMember	String(4)		Demandante de xRolling
4	🗝	ReferencePL	String(4)		Código del Proveedor de Liquidez
5		PLMember	String(4)		Proveedor de Liquidez

Sensitivity: C2 Internal

4.10 Ajustes por eventos corporativos sobre xRolling

CADJUSTMENTS.ch	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Ratios de ajuste de precio y posición por eventos corporativos sobre xRolling
Destinatarios	Los operadores con permiso de operar en xRolling
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		ExdateDate	LocalDate		Fecha Exdate
5		PriceAdjustmentRatio	Float		Ratio Ajuste precio
6		PositionAdjustmentRatio	Float		Ratio Ajuste posición

Sensitivity: C2 Internal

5 Datos para Cálculo de Garantías

En este grupo se localizan los ficheros de carácter público que contienen datos empleados por los algoritmos publicados de cálculo y compensación de garantías, y valoraciones de precios y deltas.

5.1 Parámetros de la matriz de garantías

CVALARRAYS.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Parámetros de cada una de las matrices de cálculo de garantía
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ArrayCode	String(3)		Código de matriz de garantías
4	🗝	FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
5	🗝	ExpirySpan	char	Códigos:A..Z, 0..9	Tipo de vencimiento
6		NumberOfColumns	Int	<=41	Número de columnas sin tener en cuenta grandes posiciones
7		PriceFluctuationType	char	"P"=Porcentual "T"=Por Precio	Tipo de fluctuación de precios
8		PriceIncFluctuation	float		Fluctuación de crecimiento (izquierda)
9		PriceDecFluctuation	float		Fluctuación de decrecimiento (derecha)
10		VolatilityVariationType	char	"P"=Porcentual "T"=Aditiva	Forma de aplicar la variación de la volatilidad
11		VolatilityVariation	float		Variación de volatilidad
12		ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Subgrupo de contrato referencia para compensación entre subyacentes distintos
13		ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato referencia para compensación entre subyacentes distintos
14		LargePosThreshold	float		Delta a partir de la cual aplican las garantías para grandes posiciones.
15		FILLER	Int		
16		NumberOfColumnsLPos	Int	<=16	Número de Columnas para grandes posiciones
17		RegulatorMarginPercentage	Float		Porcentaje de Garantía Mínima establecida por el Regulador
18		MinTheoricalPriceApplies	String(1)	"N"=No "S"=Si	Indica si el precio mínimo aplica o no
19		MinTheoricalPrice	Price		Valor mínimo cuando aplique

Sensitivity: C2 Internal

5.2 Compensación intra-matriz

CINTRASPR.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con el mismo código de matriz
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ArrayCode	String(3)		Código de matriz de garantías
4	🗝	FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
5		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
6		FILLER	String(4)		Filler (contenido no relevante)
7		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
8		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
9		FILLER	String(4)		Filler (contenido no relevante)
10		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
11		Factor	float		Factor
12		MinimumValue	float		Valor mínimo
13		Spread	float		Spread
14	🗝	FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
15		DayCalc	char	"S"=La distancia entre vencimientos se cuenta en días "N"=La distancia entre vencimientos se cuenta en meses	

Sensitivity: C2 Internal

5.3 Compensación inter-matriz

CINTERSPR.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con diferente código de matriz
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	OffsetPriority	String(3)		Prioridad
4		ArrayCode1	String(3)		Código de matriz 1
5		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
6		FILLER	String(4)		Filler (contenido no relevante)
7		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
8		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
9		GroupOffsetDiscount1	Amt		Descuento en grupo de compensación 1
10		OffsetMultiplier1	float		Multiplicador de compensación 1
11		ArrayCode2	String(3)		Código de matriz 2
12		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
13		FILLER	String(4)		Filler (contenido no relevante)
14		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
15		FILLER	String(2)		Filler (contenido no relevante)
16		GroupOffsetDiscount2	Amt		Descuento en grupo de compensación 2
17		OffsetMultiplier2	float		Multiplicador de compensación 2
18		FILLER	Amt		Filler (contenido no relevante)
19		DiscountType	char	"D"=Divisa "P"=Porcentaje	Tipo de descuento que se aplica

Sensitivity: C2 Internal

5.4 Precios teóricos (con el criterio de cálculo institucional)

CTHEORPRICES.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Precios teóricos de los contratos (con el criterio de cálculo institucional)
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse o modificarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Indica si el registro contiene precios teóricos para posiciones compradoras o vendedoras
5N		NumberOfTheoreticalPrices	int		Número de precios teóricos contenidos en el registro. Corresponde al campo NumberOfColumns del fichero CVALARRAYS. Nota: El nº total de campos que se muestran a continuación corresponde a la suma de los campos NumberOfColumns y NumberOfColumnsLPos del fichero CVALARRAYS
6R		TheoreticalPrice	Price		Precio teórico(con el criterio de cálculo institucional)

Sensitivity: C2 Internal

5.5 Precios teóricos (con el criterio de cálculo minorista)

CTHEORPRICES_RETAIL.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Precios teóricos de los contratos (con el criterio de cálculo minorista)
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse o modificarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Indica si el registro contiene precios teóricos para posiciones compradoras o vendedoras
5N		NumberOfTheoreticalPrices	int		Número de precios teóricos contenidos en el registro. Corresponde al campo NumberOfColumns del fichero CVALARRAYS Nota: El nº total de campos que se muestran a continuación corresponde a la suma de los campos NumberOfColumns y NumberOfColumnsLPos del fichero CVALARRAYS
6R		TheoreticalPrice	Price		Precio teórico (con el criterio de cálculo minorista)

Sensitivity: C2 Internal

5.6 Deltas (con el criterio de cálculo institucional)

CDELTAS.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Deltas de los contratos (con el criterio de cálculo institucional)
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse o modificarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Indica si el registro contiene deltas para posiciones compradoras o vendedoras
5N		NumberOfDeltas	int		Número de deltas contenidos en el registro. Corresponde al campo NumberOfColumns del fichero CVALARRAYS ~~A continuación se encuentran tantos campos como indique éste~~ Nota: El nº total de campos que se muestran a continuación corresponde a la suma de los campos NumberOfColumns y NumberOfColumnsLPos del fichero CVALARRAYS
6R		Delta	float		Delta (con el criterio de cálculo institucional)

Sensitivity: C2 Internal

5.7 Deltas (con el criterio de cálculo minorista)

CDELTAS_RETAIL.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Deltas de los contratos (con el criterio de cálculo minorista)
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse o modificarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Indica si el registro contiene deltas para posiciones compradoras o vendedoras
5N		NumberOfDeltas	int		Número de deltas contenidos en el registro. Corresponde al campo NumberOfColumns del fichero CVALARRAYS Nota: El nº total de campos que se muestran a continuación corresponde a la suma de los campos NumberOfColumns y NumberOfColumnsLPos del fichero CVALARRAYS
6R		Delta	float		Delta (con el criterio de cálculo minorista)

Sensitivity: C2 Internal

5.8 Curva de tipos de interés

CYIELDCURVE.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Información sobre tipos de interés utilizados en el cálculo de precios teóricos, por tramos
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse o modificarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de la sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	CalcType	char	"2"=Garantía "3"=Actualiza-ción efectivo compras "4"=Actualiza-ción efecivo ventas	Tipo de cálculo
4	🗝	DayRangeStart	int	>=0 y <= 99999	Número de días a partir del cual debe aplicarse el tipo de interés especificado. Es menor o igual que DayRangeEnd
5		DayRangeEnd	int	>=0 y <= 99999	Número de días hasta el que debe aplicarse el tipo de interés especificado. Es mayor o igual que DayRangeStart
6		YieldCurveRate	float		Tipo de interés de la curva de tipos para el plazo correspondiente. En tanto por ciento.

Sensitivity: C2 Internal

5.9 Dividendos

CDIVIDENDS.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Información sobre los dividendos utilizados en el cálculo de precios teóricos para cada subyacente
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse o modificarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	□	SessionDate	LocalDate		Fecha de la sesión
2	□	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	□	Stock	String(22)		Código de contrato de contado
4N		NumberOfDividends	int		Número de dividendos que contiene este registro. Seguirán tres campos como los que se describen a continuación por cada dividendo
5R		DividendDate	LocalDate		Fecha del dividendo
6R		DividendAmount	Amt		Importe del dividendo
7R		DividendConfirmedIndicator	char	"1"=Sí "0"=No	Indica si se trata de un dividendo confirmado o no

Sensitivity: C2 Internal

5.10 Skew de volatilidades

CVOLATILITYSKEW.ch	
Grupo	Datos para Cálculo de Garantías
Descripción	Curva de volatilidades utilizada en el cálculo de precios teóricos
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse o modificarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de la sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Underlying	String(22)		Código de subyacente (contrato de contado)
4	🗝	MaturityDate	LocalDate		Fecha de vencimiento
5	🗝	InstrumentType	char	"C"=Call "P"=Put "?"=Todos (Call y Put)	Indicador que informa si el registro se refiere a las opciones call, opciones put, o ambas
6		VolatilityATM	float		Volatilidad At The Money. En tanto por ciento.
7		Divisor	int		Divisor de puntos porcentuales. Indica a que porcentaje se aplica cada incremento de volatilidad
8		MinimumVolatility	float		Volatilidad mínima. En tanto por ciento.
9		MaximumVolatility	float		Volatilidad máxima. En tanto por ciento.
10N		NumberOfRanges	int	<=8	Número de rangos que contiene este registro. Seguirán cuatro campos como los que se describen a continuación por cada rango
11R		VariationPercentage1	float		Porcentaje de variación para precio de ejercicio >= precio del subyacente. Se expresa como un porcentaje sobre el precio de referencia y es acumulativo. Por ejemplo si para el primer tramo es un 10% y para el segundo tramo es un 15%, esto quiere decir que es un 10+15 % sobre el precio de referencia. En tanto por ciento.
12R		VariationPoints1	float		Puntos porcentuales de incremento / decremento para precio de ejercicio >= precio del subyacente
13R		VariationPercentage2	float		Porcentaje de variación para precio de ejercicio < precio del subyacente. Se expresa como un porcentaje sobre el precio de referencia y es acumulativo. Por ejemplo si para el primer tramo es un 10% y para el segundo tramo es un 15%, esto quiere decir que es un 10+15 % sobre el precio de referencia. En tanto por ciento.

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
14R		VariationPoints2	float		Puntos porcentuales de incremento / decremento para precio de ejercicio < precio del subyacente

Sensitivity: C2 Internal

6 Datos para Cálculo de Garantías – modelo de escenarios

6.1 Parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición

CMARGINPARAMETERS.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Información de la parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición (modelo de escenarios)
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3		MporHouse	Int		Número de días Mpor House
4		MporClient	Int		Número de días Mpor Cliente
5		HvarCI	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (4 decimales)	Nivel de confianza HVAR
6		EsCI	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (4 decimales). Debería corresponder a la media de los 18 peores escenarios	Nivel de confianza ES
7		LookBackPeriod	Int		Es el número de escenarios históricos que se utilizan en el cálculo del IM. Se aplicará el mismo para HVaR y ES. En principio 2520.
8		NonScaledScenariosNumberFV	Int		Número de escenarios no escalados a realizar full valuation (no aplica a FX RSF)
9		ScaledScenariosNumberFV	Int		Número de escenarios escalados a realizar full valuation (no aplica a FX RSF)
10		IMbaseBuffer	float		Multiplicador sobre el IM Base
11		IMFloorFactor	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 20% sería 0.20 (4 decimales)	Multiplicador sobre el IM Base para obtener la garantía mínima
12		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
13		DaysSmoothingParam	Int		N (DaySmoothingParam) corresponde al valor a computar en el smoothing parameter definido como 2/(N+1). El valor por defecto es 10.

Sensitivity: C2 Internal

6.2 Parametrización correspondiente al ajuste por tamaño de la posición

CLIQUIDITYMARGIN.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Información para cada par de divisas de la parametrización correspondiente al ajuste por tamaño de la posición en condiciones normales y de stress de mercado. (modelo de escenarios)
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
4		ContractSubgroupDescription	String(20)	Ver tabla 14 en documento "Tablas de codificación"	Descripción del subgrupo de contratos
5		QuantityMax	Int		Volumen Maximo en mercado
6N		NumberOfIntervals	Int		Número de intervalos que se definen a continuación. Máximo 10.
7R		QuantityInterval	Int		El valor de este campo por QuantityMax marca la frontera con el siguiente tramo de volumen máximo de mercado (habitualmente 5 intervalos)
8R		Surcharge	float		Sobrecoste por iliquidez expresado en la divisa cotizada

Sensitivity: C2 Internal

6.3 Buffer (Factor de riesgo) y factor de decaimiento

CIMFACTORS.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Información para cada par de divisas del factor de riesgo soberano y decay factor que aplica (modelo de escenarios)
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
4		ContractSubgroupDescription	String(20)	Ver tabla 14 en documento "Tablas de codificación"	Descripción del subgrupo de contratos
5		RiskFactorBuffer	float		Factor multiplicativo que aplica al cálculo de retornos.
6		DecayFactorSpot	float		Valor entre 0 y 1 usado en el método EWMA.
7		DecayFactorSwapPoints	float		Valor entre 0 y 1 usado en el método EWMA.

Sensitivity: C2 Internal

6.4 Parametrización del modelo de cálculo de Stress

CSTRESSTESTPARAMETERS.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Información de la parametrización del modelo de cálculo de Stress Test (modelo de escenarios)
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3		StressHistPeriod	Int		Número de escenarios históricos usados para calcular el Stress Test: "-1" = todos los escenarios "1, 2,...,n" = número de escenarios a utilizar en el cálculos
4		StressHypoPeriod	Int		Número de escenarios hipotéticos usados para calcular el Stress Test: "-1" = todos los escenarios "1, 2,...,n" = número de escenarios a utilizar en el cálculos
5		StressNivelConfidenceHist	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (4 decimales)	Nivel de confianza para escenarios históricos para el cálculo del stress test (1 -> El peor; 0 -> El menos malo)
6		StressNivelConfidenceHypo	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (4 decimales)	Nivel de confianza para escenarios hipotéticos para el cálculo del stress test (1 -> El peor; 0 -> El menos malo)
7		StressNumScenariosDDBB	Int		Número de peores escenarios que se grabarán en base de datos como resultado del Stress Test
8		StressAvgHist	char	N"= No, "S"= Sí	Promediar o no las pérdidas y ganancias generadas por escenarios históricos que correspondan al nivel de confianza establecido. "N"= No, "S"= Sí
9		StressAvgHypo	char	N"= No, "S"= Sí	Promediar o no las pérdidas y ganancias generadas por escenarios hipotéticos que correspondan al nivel de confianza establecido. "N"= No, "S"= Sí
10		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Stress Test"

Sensitivity: C2 Internal

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

CSCENARIOS.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Información de los escenarios históricos, históricos escalados e hipotéticos utilizados por el algoritmo de cálculo de garantías por posición y de Stress Test (modelo de escenarios)
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
4	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
3	🗝	ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato
5	🗝	ScenarioType	String(4)		Puede ser un escenrio histórico (HIST) o un escenario hipotético (HYPO)
6	🗝	ScenarioID	String(18)		Fecha del escenario para Históricos Nombre del escenario para Hipotéticos
7		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que se expresan los retornos
8		ReturnShiftNonScalated	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (como máximo15 decimales)	Retorno no escalado
9		ReturnShiftScalated	float	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (como máximo15 decimales)	Retorno escalado

Sensitivity: C2 Internal

6.6 Calendario de sesiones en que no se aplica ajuste técnico

CROLLINGCALENDAR.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Calendario, a nivel de subyacente, de las sesiones en las que no se deberá generar el ajuste técnico para la posición abierta
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
4		ContractSubgroupDescription	String(20)	Ver tabla 14 en documento "Tablas de codificación"	Descripción del subgrupo de contratos
5N		NumberOfHolidays	Int	<=40	Número de días festivos que se definen a continuación. Máximo 40
5R		HolidayDate	LocalDate		Fecha de la sesión en que no se aplica ajuste técnico a los contractos de este subgrupo de contratos.

Sensitivity: C2 Internal

6.7 Garantías por 1 contrato

CIMSINGLEPOSITION.ch	
Grupo	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios
Descripción	Importe de garantías requeridas por una posición de un 1 contrato
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
4		ContractSubgroupDescription	String(20)	Ver tabla 14 en documento "Tablas de codificación"	Descripción del subgrupo de contratos
5		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
6		InitialMarginLongOnecontract	Amt		Initial Margin requerido por una posición de un 1 contrato comprado
7		InitialMarginShortOnecontract	Amt		Initial Margin requerido por una posición de un 1 contrato vendido
8	🗝	ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato

Sensitivity: C2 Internal

7 Operaciones

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado que detallan las operaciones del día.

7.1 Operaciones

CTRADES.ch	
Grupo	Operaciones
Descripción	Información de todas las operaciones liquidadas en la sesión. Se incluyen las operaciones de ajuste de posición
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación (único a nivel de Grupo de Contratos)
4	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
5		Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
6		UserID	String(3)		Identificador del usuario que realizó la operación En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS"
7		PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
8		ContractCode	String(22)		Código de contrato
9		TradeType	char		Tipo de operación
10		Price	Price		Precio
11		Quantity	Qty		Volumen
12		TradeReference	String(18)		Referencia de la operación - Si es una operación procedente de una orden, es la referencia asignada en la orden - Si es una aplicación, es la referencia asignada por el intermediario - Si es una asignación de diaria o un traspaso contiene la referencia de la operación de procedencia.
13		OpenCloseIndicator	char	"O"=Abre "C"=Cierra	Indica si la operación abre o cierra posición abierta
14		FILLER			
15		FILLER			

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
16		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes
17		SettlDate	LocalDate		Fecha de liquidación
18		RegDate	LocalDate		Fecha de registro
19		RegTime	LocalTime		Hora de registro
20		PreviousTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación de procedencia. Si se trata de la operación inicial es su propio número de registro de cámara (TradeID)
21		InitialTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación inicial. Si se trata de la operación inicial es su propio número de registro de liquidación (TradeID)
22		InitialTradeMarketCode	String(2)		Código del grupo de contratos de negociación donde fue negociada la operación inicial
23		InitialTradeExecID	String(16)		Número de registro de negociación de la operación inicial
24		InitialTradeTradingDate	LocalDate		Fecha de registro de la operación inicial
25		InitialTradeType	Char		Tipo de operación inicial
26		ExecutionDate	LocalDate		Fecha de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en liquidación, esta fecha es igual a la fecha de la operación inicial.
27		ExecutionTime	LongLocal Time		Hora de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en liquidación, esta hora es igual a la hora de la operación inicial.
28		OrderNumber	String(12)		Número de orden asignado por el sistema central. Informado en caso de que la operación inicial provenga de una orden o un quote.
29		GrossTradeAmt	Amt		Nominal / Efectivo de la transacción
30		OrigTradeReference1	String(18)		Referencia original primaria de la operación. En un repo, es la referencia común a las 2 patas del mismo.
31		OrigTradeReference2	String(18)		Referencia original secundaria de la operación. En un repo, es la referencia correspondiente a la ida o la vuelta del mismo.
32		UTI	String(52)		Identificador de la operación para la notificación
33		NotTransferredQty	Qty		Volumen vivo de la operación. Número de contratos asociados a la operación, habiendo descontado aquellos que han sido traspasados

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
34		NextTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación posterior (operaciones precio medio).
35		Yield	Price		
36		MarketID	String(4)		Operating MIC, para operaciones que procedan de una plataforma de negociación
37		MarketSegmentID	String(4)		Segment MIC, para operaciones que procedan de una plataforma de negociación
38		PremiumMargin	Amt		
39		FTL	LocalDate		

Sensitivity: C2 Internal

7.2 Operaciones que no liquidan en la sesión

CTRADESNL.ch	
Grupo	Operaciones
Descripción	Información de todas las operaciones registradas en la sesión y liquidadas en una sesión futura.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación (único a nivel de Grupo de Contratos)
4	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
5		Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
6		UserID	String(3)		Identificador del usuario que realizó la operación En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS"
7		PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
8		ContractCode	String(22)		Código de contrato
9		TradeType	char		Tipo de operación
10		Price	Price		Precio
11		Quantity	Qty		Volumen
12		TradeReference	String(18)		Referencia de la operación - Si es una operación procedente de una orden, es la referencia asignada en la orden - Si es una aplicación, es la referencia asignada por el intermediario - Si es una asignación de diaria o un traspaso contiene la referencia de la operación de procedencia.
13		OpenCloseIndicator	char	"O"=Abre "C"=Cierra	Indica si la operación abre o cierra posición abierta
14		FILLER			
15		FILLER			
16		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes
17		SettlDate	LocalDate		Fecha de liquidación
18		RegDate	LocalDate		Fecha de registro
19		RegTime	LocalTime		Hora de registro

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
20		PreviousTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación de procedencia. Si se trata de la operación inicial es su propio número de registro de cámara (TradeID)
21		InitialTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación inicial. Si se trata de la operación inicial es su propio número de registro de liquidación (TradeID)
22		InitialTradeMarketCode	String(2)		Código del grupo de contratos de negociación donde fue negociada la operación inicial
23		InitialTradeExecID	String(16)		Número de registro de negociación de la operación inicial
24		InitialTradeTradingDate	LocalDate		Fecha de registro de la operación inicial
25		InitialTradeType	Char		Tipo de operación inicial
26		ExecutionDate	LocalDate		Fecha de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en liquidación, esta fecha es igual a la fecha de la operación inicial.
27		ExecutionTime	LongLocal Time		Hora de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en liquidación, esta hora es igual a la hora de la operación inicial.
28		OrderNumber	String(12)		Número de orden asignado por el sistema central. Informado en caso de que la operación inicial provenga de una orden o un quote.
29		GrossTradeAmt	Amt		Nominal / Efectivo de la transacción
30		OrigTradeReference1	String(18)		Referencia original primaria de la operación. En un repo, es la referencia común a las 2 patas del mismo.
31		OrigTradeReference2	String(18)		Referencia original secundaria de la operación. En un repo, es la referencia correspondiente a la ida o la vuelta del mismo.
32		UTI	String(52)		Identificador de la operación para la notificación
33		NotTransferredQty	Qty		Volumen vivo de la operación. Número de contratos asociados a la operación, habiendo descontado aquellos que han sido traspasados
34		NextTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación posterior (operaciones precio medio).
35		Yield	Price		
36		MarketID	String(4)		Operating MIC, para operaciones que procedan de una plataforma de negociación

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
37		MarketSegmentID	String(4)		Segment MIC, para operaciones que procedan de una plataforma de negociación
38		PremiumMargin	Amt		
39		FTL	LocalDate		

Sensitivity: C2 Internal

8 Gestión de Operaciones

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado que detallan las acciones de asignación, traspaso o Give-Up efectuadas sobre las operaciones, así como las operaciones de días anteriores todavía susceptibles de traspaso.

8.1 Operaciones vivas

CHISTTRADES.ch	
Grupo	Operaciones
Descripción	Información de las operaciones que pueden ser tratadas en la gestión de operaciones. Este fichero contendrá las operaciones de sesiones previas que tengan volumen vivo, las negociadas durante sesión (independientemente de su fecha de liquidación) o las operaciones con fecha de liquidación del día.
Destinatarios	Miembro
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación (único a nivel de grupo de contratos)
4	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
5		Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
6		PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
7		ContractCode	String(22)		Código de contrato
8		TradeType	char		Tipo de operación
9		Price	Price		Precio
10		Quantity	Qty		Volumen
11		SettlDate	LocalDate		Fecha de liquidación
12		RegDate	LocalDate		Fecha de registro en el entorno de liquidación
13		RegTime	LocalTime		Hora de registro en el entorno de liquidación
14		NotTransferredQty	Qty		Volumen vivo de la operación. Número de contratos asociados a la operación, habiendo descontado aquellos que han sido traspasados
15		PreviousTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación de procedencia. Si se trata de la operación inicial es su propio número de registro de liquidación (TradeID)
16		InitialTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación inicial. Si se trata de la

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
					operación inicial es su propio número de registro de liquidación (TradeID)
17		ExecutionDate	LocalDate		Fecha de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en liquidación, esta fecha es igual a la fecha de la operación inicial.
18		ExecutionTime	LongLocal Time		Hora de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en liquidación, esta hora es igual a la hora de la operación inicial.
19		GrossTradeAmt	Amt		Valoración inicial. Nominal/Efectivo de la operación en la parte correspondiente al volumen vivo, calculado al precio original de la operación.
20		OrigTradeReference1	String(18)		Referencia original primaria de la operación. En un repo, es la referencia común a las 2 patas del mismo.
21		OrigTradeReference2	String(18)		Referencia original secundaria de la operación. En un repo, es la referencia correspondiente a la ida o la vuelta del mismo.
22		PremiumMargin	Amt		
39		FTL	LocalDate		

Sensitivity: C2 Internal

8.2 Asignaciones y traspasos realizados

CTRANSFTRADES.ch	
Grupo	Gestión de operaciones
Descripción	Asignaciones y Traspasos realizados
Destinatarios	Miembro que realiza las asignación o traspaso
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TransactionID	String(10)		Identificador del traspaso
4		Member	String(4)		Miembro que realiza la asignación o el traspaso
5		UserID	String(3)		Identificador del operador de liquidación que solicitó la acción
6		ContractCode	String(22)		Código de contrato
7		PreviousTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación de procedencia
8		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación
9		AccountFrom	String(5)		Cuenta de posición origen
10		TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación
11		AccountTo	String(5)		Cuenta de posición destino
12		Price	Price		Precio
13		Quantity	Qty		Volumen traspasado
14		TradeType	char		Tipo de operación
15		RegTime	LocalTime		Hora de registro en el entorno de liquidación
16		SettlDate	LocalDate		Fecha de liquidación
17		GrossTradeAmt	Amt		Nominal / Efectivo de la transacción

Sensitivity: C2 Internal

8.3 Give-Outs

CGIVEOUT.ch	
Grupo	Gestión de operaciones
Descripción	Estado de los Give-Outs en que se participa como Miembro Origen
Destinatarios	Miembro Origen
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse o modificarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TransactionID	String(10)		Identificador del Give-Up
4		GiveUpStatus	char	ver Tabla 7 en documento "Tablas de Codificación"	Estado del Give-Up
5		GiveOutMember	String(4)		Miembro Origen
6		GiveOutUserID	String(3)		Identificador del operador de liquidación que solicitó la acción
7		ContractCode	String(22)		Código de contrato
8		PreviousTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación para la que se ha solicitado el Give-Out
9		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de la que se ha solicitado el Give-Out
10		GiveOutAccount	String(5)		Cuenta de posición origen
11		TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación de Give-Up. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.
12		Price	Price		Precio
13		Quantity	Qty		Número de contratos a traspasar
14		GiveOutMnemonic	String(10)		Mnemotécnico del Give-Out
15		GiveInMember	String(4)		Miembro Destino
16		GiveUpReference	String(18)		Referencia de Give-Up
17		TransactionTime	LocalTime		Hora en que el Give-Out pasa a este estado
18		SettlDate	LocalDate		Fecha de liquidación. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado. Este campo está cumplimentado cuando el Give-up ha sido aceptado.
19		GiveOutInternalRef	String(18)		Referencia asignada por el Miembro Origen para uso interno y que se asocia al mnemónico de give-out. Una misma referencia interna puede estar asociada a más de un mnemónico. Puede no estar informada
20		GrossTradeAmt	Amt		Nominal / Efectivo de la transacción

Sensitivity: C2 Internal

8.4 Give-Ins para miembro Destino

CGIVEIN.ch	
Grupo	Gestión de operaciones
Descripción	Estado de los Give-In en que se participa como Miembro Destino
Destinatarios	Miembro Destino
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse o modificarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TransactionID	String(10)		Identificador del Give-Up
4		GiveUpStatus	Char	ver Tabla 7 en documento "Tablas de Codificación"	Estado del Give-Up
5		GiveInMember	String(4)		Miembro Destino
6		GiveInUserID	String(3)		Identificador del operador de Miembro Destino que actuó aceptando o rechazando el Give-Up En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS" En el caso de Give-Ups sobre los que el Miembro Destino no haya efectuado ninguna acción aparecerá en blanco.
7		ContractCode	String(22)		Código de contrato
8		TradeID	Int		Número de registro de liquidación de la operación de Give-Up. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.
9		Side	Char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de la que se ha solicitado el Give-Up
10		GiveInAccount	String(5)		Cuenta de posición destino
11		Price	Price		Precio
12		Quantity	Qty		Número de contratos a traspasar
13		GiveInMnemonic	String(10)		Mnemotécnico asignado por el Miembro Destino a la combinación de Miembro Origen y referencia de Give-Up del registro
14		GiveOutMember	String(4)		Miembro Origen
15		GiveOutUserID	String(3)		Identificador del operador del Miembro Origen que solicitó el Give-Up
16		GiveUpReference	String(18)		Referencia de Give-Up
17		TransactionTime	LocalTime		Hora en que el Give-In pasa a este estado
18		SettlDate	LocalDate		Fecha de liquidación. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado. Este campo está cumplimentado cuando el Give-up ha sido aceptado..

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
19		GrossTradeAmt	Amt		Nominal / Efectivo de la transacción

Sensitivity: C2 Internal

8.5 Give-Ins para Compensador de Miembro Destino

CGIVEINCLM.ch	
Grupo	Gestión de operaciones
Descripción	Estado de los Give-In en que se participa como Compensador del Miembro Destino
Destinatarios	Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse o modificarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TransactionID	String(10)		Identificador del Give-Up
4		GiveUpStatus	char	ver Tabla 7 en documento "Tablas de Codificación"	Estado del Give-Up
5		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador del Miembro Destino del Give-Up
6		UserID	String(3)		Identificador del operador del Compensador de Miembro Destino que actuó aceptando o rechazando el Give-Up En el caso de Give-Ups aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS" En el caso de Give-Ups sobre los que el Compensador no haya efectuado ninguna acción aparecerá en blanco.
7		GiveInMember	String(4)		Miembro Destino
8		GiveInUserID	String(3)		Identificador del operador de Miembro Destino que aceptó el Give-Up En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS"
9		ContractCode	String(22)		Código de contrato
10		TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación de Give-Up. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.
11		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de la que se ha solicitado el Give-Up
12		GiveInAccount	String(5)		Cuenta de posición destino
13		Price	Price		Precio
14		Quantity	Qty		Número de contratos a traspasar
15		GiveOutMember	String(4)		Miembro Origen
16		GiveUpReference	String(18)		Referencia de Give-Up
17		TransactionTime	LocalTime		Hora en que el Give-In pasa a este estado
18		SettlDate	LocalDate		Fecha de liquidación. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
					Este campo está cumplimentado cuando el Give-up ha sido aceptado.
19		GrossTradeAmt	Amt		Nominal / Efectivo de la transacción

Sensitivity: C2 Internal

9 Posición Abierta

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado que detallan el estado de la posición y los ajustes efectuados a la misma.

9.1 Saldo de posición abierta por cuenta de posición

COPENPOSITION.ch	
Grupo	Posición Abierta
Descripción	Información de la posición abierta por cuenta de posición y contrato (sólo aquellas que tienen posición)
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		LongPosition	Qty		Posición compradora para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
7		ShortPosition	Qty		Posición vendedora para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
8		LongCashAmount	Amt		Importe efectivo comprador para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
9		ShortCashAmount	Amt		Importe efectivo vendedor para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro

Sensitivity: C2 Internal

9.2 Saldo de posición abierta por cuenta de garantías

CMARGINOPENPOSITION.ch	
Grupo	Posición Abierta
Descripción	Información de la posición abierta por cuenta de garantías y contrato (sólo aquellas que tienen posición)
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		LongPosition	Qty		Posición compradora para la combinación de cuenta de garantías y contrato del registro
7		ShortPosition	Qty		Posición vendedora para la combinación de cuenta de garantías y contrato del registro
8		LongCashAmount	Amt		Importe efectivo comprador para la combinación de cuenta de garantías y contrato del registro
9		ShortCashAmount	Amt		Importe efectivo vendedor para la combinación de cuenta de garantías y contrato del registro

Sensitivity: C2 Internal

9.3 Saldo de posición abierta virtual por cuenta de posición

COPENPOSITIONREL.ch	
Grupo	Posición Abierta
Descripción	Información de la posición abierta por cuenta de posición y contrato (sólo aquellas que tienen posición) a tener en cuenta en caso de en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Para Energía informa de la posición resultante de aplicar la cascada teórica.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		LongPosition	Qty		Posición compradora para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
7		ShortPosition	Qty		Posición vendedora para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro

Sensitivity: C2 Internal

9.4 Saldo de posición abierta virtual por cuenta de garantías

CMARGINOPENPOSITIONREL.ch	
Grupo	Posición Abierta
Descripción	Información de la posición abierta por cuenta de garantías y contrato (sólo aquellas que tienen posición) a tener en cuenta para calcular la componente de initial margin de las garantías por posición, en caso de en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Para Energía informa de la posición resultante de aplicar la cascada teórica.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		LongPosition	Qty		Posición compradora para la combinación de cuenta de garantías y contrato del registro
7		ShortPosition	Qty		Posición vendedora para la combinación de cuenta de garantías y contrato del registro

Sensitivity: C2 Internal

9.5 Saldo de posición abierta Proveedor de Liquidez con Demandantes de xRolling

COPENPOSITIONPL.ch	
Grupo	Posición Abierta Demandantes de xRolling
Descripción	Información de la posición abierta Proveedor de Liquidez con Demandantes de xRolling y contrato (sólo aquellos que tienen posición)
Destinatarios	Proveedor Liquidez
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
4	🗝	MemberPL	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición PL
4	🗝	PositionAccountPL	String(5)		Cuenta de posición PL
5	🗝	MemberDR	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición DR
6	🗝	ReferencePL	String(4)		Código del Proveedor de Liquidez
7	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
8		LongPositionPL	Qty		Posición compradora del PL para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
9		ShortPositionPL	Qty		Posición vendedora del PL para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
10		LongCashAmountPL	Amt		Importe efectivo comprador del PL para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
11		ShortCashAmountPL	Amt		Importe efectivo vendedor del PL para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro

Sensitivity: C2 Internal

9.6 Saldo de posición abierta Demandante de xRolling con Proveedor de Liquidez

COPENPOSITIONDR.ch	
Grupo	Posición Abierta Demandante de xRolling con Proveedor de Liquidez
Descripción	Información de la posición abierta Demandantes de xRolling con Proveedor de Liquidez y contrato (sólo aquellos que tienen posición)
Destinatarios	Demandantes de xRolling
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MemberDR	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición DR
4	🗝	PositionAccountDR	String(5)		Cuenta de posición DR
5	🗝	MemberPL	String(4)		Miembro PL
6	🗝	ReferencePL	String(4)		Código del Proveedor de Liquidez
7	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
8		LongPositionDR	Qty		Posición compradora del DR para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
9		ShortPositionDR	Qty		Posición vendedora del DR para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
10		LongCashAmountDR	Amt		Importe efectivo comprador del DR para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
11		ShortCashAmountDR	Amt		Importe efectivo vendedor del DR para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro

Sensitivity: C2 Internal

9.7 Ajustes de posición

CPOSADJUST.ch	
Grupo	Posición Abierta
Descripción	Ajustes de posición realizados durante la sesión
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TradeID	int		Número de registro de liquidación
4		Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
5		PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
6		ContractCode	String(22)		Código de contrato
7		UserID	String(3)		Identificador del operador de liquidación que solicitó la acción
8		AdjustmentQty	Qty	>0	Número de contratos en que se ajusta la posición
9		AdjustmentSign	char	"1"=Reducción de posición "2"=Incremento de posición	Indica si se realiza una reducción o incremento de posición
10		AdjustmentTime	LocalTime		Hora del ajuste de posición

Sensitivity: C2 Internal

10 Ejercicio – Vencimiento – Entrega

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado que detallan las peticiones de ejercicio y las posibles entregas de acciones.

10.1 Peticiones de ejercicio de opciones

CEXERCISERQT.ch	
Grupo	Ejercicio – Vencimiento - Entrega
Descripción	Información de las peticiones de ejercicio vigentes
Destinatarios	Miembro
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		UserID	String(3)		Identificador del operador de liquidación que solicitó la acción
7		Quantity	Qty		Número de contratos a ejercer. Este valor no debe ser tenido en cuenta cuando se trata de una petición de no ejercer. Está en blanco si la petición es para todo el volumen existente.
8		ExerciseRequest	char	"S"=Ejercer "N"=No Ejercer "A"=Automático	Indica si el registro se refiere a una petición expresa de ejercer o de no ejercer, o si se desea el ejercicio automático por el sistema

Sensitivity: C2 Internal

10.2 Operaciones de contado del Miembro

CSPOTTRADES.ch	
Grupo	Ejercicio – Vencimiento - Entrega
Descripción	Información acerca de las operaciones de entregas a realizar fuera de BME CLEARING: Vencimiento del Bono. Se envía al Miembro que actúa como Titular de Cuenta en el Depositario Central de Valores en el que se realiza la entrega, que puede o no ser el Miembro de la cámara, y a su Compensador.
Destinatarios	Miembro/ Miembro que actúa como Titular de Cuenta, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro
4	🗝	ContractCode	String(22)		Código de título entregable
5	🗝	ExerciseIndicator	char	"A"=Anticipado "V"=Vencimiento	Indica si la entrega proviene de ejercicio anticipado o al vencimiento
6	🗝	CounterpartyMember	String(4)		Miembro Contrapartida
7		Quantity	Qty		
8	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de contado
9	🗝	ReferencePrice	Price		Precio de referencia
10		MemberExchCode	String(4)		Código del Miembro en el mercado en el que se realiza la entrega
11		CounterpartyMemberExchCode	String(4)		Código del Miembro contrapartida en el mercado en el que se realiza la entrega
12		TradeDate	LocalDate		Fecha de registro de la operación
13	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
14		CashAmt	Amt		En entrega de valores de renta variable, corresponde al importe efectivo de la operación. En entrega de valores de renta fija es el importe efectivo de la entrega = nº contratos * (precio de liquidación en tanto por 1 * nominal de un contrato * factor de conversión + cupón corrido).
15	🗝	CapacityInd	char	"P" = Propia "A" = Ajena	Indicador de capacidad
16	🗝	CounterpartyMemberCapacityInd	char	"P" = Propia "A" = Ajena	Indicador de capacidad del Miembro contrapartida
17	🗝	TradeId	Int		Referencia de case de las operaciones de entrega para la entrega del Bono. En el resto de casos vale cero.
18		Nominal	Amt		Sólo informado para productos de renta fija: valor nominal.

Sensitivity: C2 Internal

10.3 Operaciones de contado desglosadas por cuenta de garantías

CSPOTTRADESBRKD.ch	
Grupo	Ejercicio – Vencimiento - Entrega
Descripción	Detalle a nivel titular de las operaciones a realizar fuera de BME CLEARING: Vencimiento del Bono.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador, Miembro en la Entrega
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(3)		Cuenta de garantías Nota: Campo que se eliminará en futuras versiones, equivale al nuevo campo MarginAccount (campo 17)
5	🗝	DeliverableContractCode	String(22)		Código de título entregable
6	🗝	ExerciseIndicator	char	"A"=Anticipado "V"=Vencimiento	Indica si la entrega proviene de ejercicio anticipado o al vencimiento
7		Quantity	Qty		Volumen que se entrega.
8	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de contado
9	🗝	ReferencePrice	Price		Precio de referencia
10		TradeDate	LocalDate		Fecha de registro de las operaciones
11		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
12		CodCSD	char	Ver tabla 9 en documento "Tablas de Codificación"	Código de Depositario Central de Valores en el que se realiza la entrega
13		CashAmt	Amt		En entrega de valores de renta variable, corresponde al importe efectivo de la operación. En entrega de valores de renta fija es el importe efectivo de la entrega = nº contratos * (precio de liquidación en tanto por 1 * nominal de un contrato * factor de conversión + cupón corrido).
14	🗝	TradeID	Int		Número de operación de entrega En BME CLEARING siempre es cero.
15	🗝	DeliveryMember	String(4)		Miembro que actúa como Titular de Cuenta en el Depositario Central de Valores en el que se realiza la entrega.
16		Nominal	Amt		Sólo informado para productos de renta fija: valor nominal.
17	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías

Sensitivity: C2 Internal

10.4 Operaciones de contado desglosadas por cuenta de posición

CSPOTTRADESBRKDDET.ch	
Grupo	Ejercicio – Vencimiento - Entrega
Descripción	Detalle a nivel de cuenta de posición de las operaciones sobre acciones a realizar fuera de BME CLEARING, como consecuencia del ejercicio de opciones realizado en la sesión
Destinatarios	Miembro
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	DeliverableContractCode	String(22)		Código de título entregable (código de contrato de contado)
6	🗝	ExerciseIndicator	char	"A"=Anticipado "V"=Vencimiento (opciones) “F”=Vencimiento (futuros)	Indica si la entrega proviene de ejercicio anticipado o al vencimiento
7		Quantity	Qty		Volumen que se entrega. En valores de renta fija: valor nominal En valores de renta variable: Nº acciones
8	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de contado
9	🗝	ReferencePrice	Price		Precio de referencia
10		TradeDate	LocalDate		Fecha de registro de las operaciones de contado
11		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
12		CodCSD	char	Ver tabla 9 en documento “Tablas de Codificación”	Código de Depositario Central de Valores en el que se realiza la entrega
13		CashAmt	Amt		En BME CLEARING sólo se usa en entrega de acciones, y corresponde al importe efectivo de la operación. En CRCC es el importe efectivo de la entrega = nº contratos * (precio liquidación en tanto por 1 * Nominal de un contrato * Factor de conversión + cupón corrido)
14	🗝	TradeID	Int		BMEClearing: Número de registro para clave única (acciones) CRCC: Número de operación de entrega
15		CapacityInd	Char	A: Ajena P: Propia	Indicador de capacidad de la operación de entrega

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
16		SIBEMember	String(4)		Miembro SIBE que realiza la operación especial de entrega
17		RVPositionAccount	String(3)		Cuenta de posición para asignación interna en segmento contado
18		SIBEClient	String(16)		Código de cliente
19		TakeUpFirm	String(4)		Miembro para asignación externa en segmento de contado
20		AllocText	String(18)		Referencia para asignación externa en segmento contado
21		FirmMnemonic	String(10)		Mnemotécnico para asignación externa en segmento contado
22		SIBEMemberCounterparty	String(4)		

Sensitivity: C2 Internal

10.5 Títulos entregables

CDELIVERABLES.DB	
Grupo	Ejercicio – Vencimiento - Entrega
Descripción	Información de los posibles títulos entregables asociados a un contrato de derivados
Destinatarios	Todos los usuarios del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión en día de vencimiento

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato de derivados que genera la obligación de entrega
4	🗝	CodCSD	char	Ver tabla 9 en documento "Tablas de Codificación"	Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía
5	🗝	DeliverableContractCode	String(22)		Código de título entregable empleado por la cámara
6		DeliverableOrderNo	Int	>0	Número de orden de emisión del entregable
7		DeliverableISINCode	String(12)		Código ISIN del título entregable
8		MatutiryDate	LocalDate		Fecha de vencimiento y de entrega
9		Factor	Float		Factor de conversión. Aplica a la entrega de bonos
10		AccruedInterest	Amt		Cupón corrido. Aplica a la entrega de bonos
11		Field1	String(20)		BME CLEARING: Este campo no aplica. CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL: este campo corresponde al Código ISIN ANNA. String(12) * Si el activo está depositado en DCV: este campo corresponde al Código título que identifica al activo en DCV. String(3)
12		Field2	String(20)	0=DECEVAL 1=CLEARSTREAM 2=BANK OF NEW YORK 3 = DCV	BME CLEARING: Este campo no aplica. CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL: este campo corresponde al Código Depósito donde se encuentra el ISIN.String(10) * Si el activo está depositado en DCV: este campo corresponde al Número de emisión que identifica al activo en DCV. String(7)

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
13		BVCContractCode	String(35)		BME CLEARING: Este campo no aplica CRCC: Nemotécnico del título en la BVC
14		CFICode	String(6)		Código CFI

Sensitivity: C2 Internal

10.6 Detalle de entrega física de gas

CPHYSDELDETS.ch	
Grupo	Ejercicio – Vencimiento - Entrega
Descripción	Detalle de obligaciones de entrega física
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	Member	String(4)		Miembro
5	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
6	🗝	Infraestructure	String(10)	"PVB"=Punto Virtual de Balance Español "TVB"= Tanque Virtual de Balance	Infraestructura
7		EICcode	String(16)		Código EIC
8	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato de derivados que genera la obligación de entrega
9	🗝	DeliveryDate	LocalDate		Fecha de entrega
10	🗝	SettlPrice	Price		Precio de liquidación
11		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación a liquidar
12		Quantity	Qty		Número de contratos a entregar
13		QuantityToDeliver	float		Cantidad a entregar
14		UnitOfMeasure	Char(20)		Unidad de medida de la cantidad a entregar
15		NominationStatus	char	"P"=Previsión "N"=Notificación "A"=Aceptada	Estado de la nominación

Sensitivity: C2 Internal

10.7 Nominaciones para entrega física de gas a nivel de EIC

CPHYSDEL.ch	
Grupo	Ejercicio – Vencimiento - Entrega
Descripción	Nominaciones de entrega física a nivel de EIC
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	Member	String(4)		Miembro
5	🗝	Infraestructure	String(10)	"PVB"=Punto Virtual de Balance Español "TVB"= Tanque Virtual de Balance	Infraestructura
6	🗝	EICcode	String(16)		Código EIC
7	🗝	DeliveryDate	LocalDate		Fecha de entrega
8	🗝	ContractType	Char	"N"=No intradía	
9		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación a liquidar
10		QuantityToDeliver	float	Hasta 3 decimales	Cantidad a entregar
11		UnitOfMeasure	Char(20)		Unidad de medida de la cantidad a entregar
12		NominationStatus	char	"P"=Previsión "N"=Notificación "A"=Aceptada	Estado de la nominación

10.8 Detalle de la tarifa de entrega física de productos de gas

CPHYSDELFEES.ch	
Grupo	Comisiones
Descripción	Tarifa por entrega física
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	Member	String(4)		Miembro
5	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
6	🗝	Infraestructure	String(10)	"PVB"=Punto Virtual de Balance Español	Infraestructura

Sensitivity: C2 Internal

				"TVB"= Tanque Virtual de Balance	
7		EICcode	String(16)		Código EIC
8	🗝	DeliveryDate	LocalDate		Fecha de entrega
9		NetQuantity	Qty		Número neto de contratos a entregar
10		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que está expresada la tarifa
11		Delivery Fee	Amt		Importe de la comisión por entrega

Sensitivity: C2 Internal

11 Comisiones

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado con datos relativos a las comisiones a liquidar.

11.1 Detalle de comisiones

CFEESBRKD.ch	
Grupo	Comisiones
Descripción	Información del detalle de comisiones por operaciones
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación
4	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
5	🗝	LastDateFeesCalc	LocalDate		En caso de cargo de comisiones, esta fecha siempre es igual a la fecha de la sesión. En caso de devolución, este campo indica la ultima fecha de sesión en la que se ha realizó cálculo de comisiones para esta operación
6	🗝	FeeGroup	String(2)	ver Tabla 15 en documento "Tablas de Codificación"	Grupo de comisión asociado al subyacente, instrumento y tipo de cuenta de posición
7		FeeType	String(2)	ver Tabla 16 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de comisión
8		FeeConcept	char	1= Por contrato 2=Cap 3=Floor 4=Por MWh 5=Por efectivo 6=Efectivo/plazo	Concepto de cobro
9		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresadas las comisiones
10		RegDate	LocalDate		Fecha de registro de la operación
11		PreviousTradeDate	LocalDate		Fecha de la operación previa. Este campo es útil para el seguimiento de comisiones en caso de give-outs y traspasos que cierran
12		Clearing Member	String(4)		Miembro Compensador

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
13		Member	String(4)		Miembro
14		PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
15		ContractCode	String(22)		Código de contrato
16		Price	Price		Precio
17		OrderNumber	String(12)		Número de orden. Informado en caso de que la operación inicial provenga de una orden o un quote
18		Quantity	Qty		Volumen de la operación
19		NotTransferredQty	Qty		Volumen vivo de la operación. Número de contratos asociados a la operación, habiendo descontado aquellos que han sido traspasados
20		OpenCloseIndicator	char	"O"=Abre "C"=Cierra	Indica si la operación abre o cierra posición abierta
21		FeePerConcept	Amt		Importe de la comisión a aplicar por concepto en el grupo de comisión correspondiente
22		TotalFee	Amt		Importe de la comisión. Puede ser cero. En caso de aplicar Cap/Floor para una transacción que agrupa varias operaciones, el importe total de la comisión estará informado sólo en una de las operaciones.
23		TradeType	char		Tipo de operación
24		TradeReference	String(18)		Referencia de la operación - Si es una operación procedente de una orden, es la referencia asignada en la orden - Si es una aplicación, es la referencia asignada por el intermediario - Si es una asignación de diaria o un traspaso contiene la referencia de la operación de procedencia.
25		PreviousTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación de procedencia. Si se trata de la operación inicial es su propio número de registro de liquidación (TradeID)
26		QuantityPerConcept	Qty		Cantidad sobre la que hay que aplicar la tarifa
27		NumberOfDays	Int		Número de días entre la fecha valor de la ida y la vuelta de la simultánea
28		CashAmt	Amt		Importe efectivo de la operación
29		FixedAmount	Amt		Importe fijo a aplicar por operación
30		TradingFee	Amt		Importe de la comisión por negociación
31		ClearingFee	Amt		Importe de la comisión por liquidación

Sensitivity: C2 Internal

11.2 Comisiones

CFEES.ch	
Grupo	Comisiones
Descripción	Información del total de comisiones devengadas en la sesión por cada Miembro
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	RegDate	LocalDate		Fecha de registro de operaciones en liquidación
4	🗝	LastDateFeesCalc	LocalDate		Última fecha de sesión en la que se realizó cálculo de comisiones para la fecha de registro indicada
5	🗝	FeeGroup	String(2)	ver Tabla 15 en documento "Tablas de Codificación"	Grupo de comisión asociado al subyacente, instrumento y tipo de cuenta de posición
6	🗝	FeeType	String(2)	ver Tabla 16 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de comisión
7	🗝	FeeConcept	char	1= Por contrato 2=Cap 3=Floor 4=Por MWh 5=Por efectivo 6=Efectivo/plazo	Concepto de cobro
8	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
9	🗝	Member	String(4)		Miembro
10	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresadas las comisiones.
11		TotalNotTransferredQty	Qty		Suma de los volúmenes vivos de todas las operaciones consideradas. Puede ser cero
12		TotalNumTransactions	Int		Número total de transacciones consideradas. Puede ser cero
13		TotalNumLines	Int		Número total de líneas en el fichero CFEESBRKD que componen este registro agregado. Puede ser cero
14		QuantityPerConcept	Qty		Cantidad sobre la que hay que aplicar el concepto de cobro
15	🗝	FeePerConcept	Amt		Importe de la comisión a aplicar por concepto de cobro
16		TotalFee	Amt		Importe de la comisión. Puede ser cero.
17		Text	String(30)		Texto informativo
18		FixedAmount	Amt		Importe fijo
19		TradingFee	Amt		Importe de la comisión por negociación
20		ClearingFee	Amt		Importe de la comisión por liquidación

Sensitivity: C2 Internal

11.3 Comisiones por diferimiento

CDEFERRALFEE.ch	
Grupo	Comisiones
Descripción	Comisión de diferimiento
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresadas las comisiones.
7		LongPosition	Qty		Posición compradora para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
8		ShortPosition	Qty		Posición vendedora para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
9		BuyCashAmt	Amt		Valor efectivo Posición Comprada (en la divisa de cotización)
10		SellCashAmt	Amt		Valor efectivo Posición Vendida (en la divisa de cotización)
11		BuyDeferralComponent	char	1=tramo 2=cap 3=floor	Indica si el mark-up aplicado en base al valor efectivo de la Posición Compradora es un % (tramo), cap o floor.
12		SellDeferralComponent	char	1=tramo 2=cap 3=floor	Indica si el mark-up aplicado en base al valor efectivo de la Posición Vendedora es un % (tramo), cap o floor.
13		BuyMarkUp	float		Si BuyDeferralComponent=1, mark-up aplicado en base al valor efectivo de la Posición Compradora.
14		SellMarkUp	float		Si SellDeferralComponent=1, mark -up aplicado en base al valor efectivo de la Posición Vendedora.
15		DeferralDays	Int		Número de días de diferimiento
16		BuyDeferralFee	Amt		Comisión de diferimiento compras. Si BuyDeferralComponent=1 se calcula aplicando el BuyMarkUp al BuyCashAmt. En caso contrario, es el cap o floor, según corresponda, prorrateado por los dias de diferimiento en cualquier caso.

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
17		SellDeferralFee	Amt		Comisión de diferimiento ventas. Si SellDeferralComponent =1 se calcula aplicando el SellMarkUp al SellCashAmt. En caso contrario, es el cap o floor, según corresponda, prorrateado por los dias de diferimiento en cualquier caso.
18	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador

Sensitivity: C2 Internal

11.4 Comisiones Ajuste de posición

CPOSADJFEE.ch	
Grupo	Comisiones
Descripción	Detalle de comisión por cuenta de posición y contrato, para aquellas cuentas en bruto sobre las que se ha incurrido en comisión por sobreajuste
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	Member	String(4)		Miembro
5	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
6	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
7	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresadas las comisiones
8		ClearingFee	Amt		Comisión de Liquidación

Sensitivity: C2 Internal

11.5 Comisiones Colateral

CCPCOLLATERALFEES.ch	
Grupo	Comisiones
Descripción	Detalle del cálculo de la remuneración del colateral en efectivo y la tarifa sobre el colateral en valores.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
4	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
5	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de colateral
6	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
7	🗝	CollateralSourceAccount	String(12)		Indica el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer.
8	🗝	MarginInstrument	char	ver Tabla 6 en documento "Tablas de Codificación"	Modo de materialización de garantías
9	🗝	CSDCode	char	ver Tabla 9, para colateral en valores, o Tabla 21, para efectivo, en documento "Tablas de Codificación"	Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo
10	🗝	NominalCurrency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes de nominal de este registro
11	🗝	AssetCode	String(12)		Código del activo entregado.
12		CurrencyReinvestmentIndicator	"S"=Yes "N"=No		Indica si es posible o no optar por reinvertir el colateral depositado en la divisa y CSC_Code de este registro.
13		AccountReinvestmentIndicator	"S"=Yes "N"=No		Indica si el miembro compensador ha optado por reinvertir o no el colateral en efectivo depositado en la cuenta colateral correspondiente, cuando sea posible.
14		Nominal	Float		Valor nominal del colateral total asignado a la cuenta.
15		ReferenceRateName	String(5)		Nombre del índice de referencia para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo.

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
16		ReferenceRate	Float		Valor del índice de referencia utilizada para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo.
17		Spread	Int		Spread aplicado al cálculo de la remuneración del colateral en efectivo, expresado en puntos básicos.
18		AddOnSpread	Int		Spread add-on aplicado al cálculo de la remuneración del colateral en efectivo, expresado en puntos básicos.
19		CashRate	Float		Tasa utilizada para el cálculo de la remuneración del colateral en efectivo. (Reference Rate + Spread + Spread add-on)
20		TreasuryFeeAmt	Amt		Importe de remuneración del colateral depositado en efectivo.
21		NonCashCollateralFee	Int		Tarifa sobre el colateral en valores, expresado en puntos básicos.
22		NonCashCollateralFeeAmt	Amt		Importe de la tarifa sobre el colateral en valores, expresada en la divisa del activo.
23		Assetprice	Price		Indica el precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido
24		Exchangerate	Price		Indica el tipo de cambio aplicable.
25		Numdays	Int		Indica el número de días de cálculo.
26	🗝	Tranche	String(1)	Valores 0/1	Para los casos en que se necesario desglosar el cálculo de comisión en 2 tramos (finales de mes e inicio) 1 = Tramo único o de fecha sesión a fecha liquidación 0 = Tramo de inicio de mes en caso de haber desglose

Sensitivity: C2 Internal

12 Resultados a nivel de Cuenta de Posición

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado con los datos, a nivel de cuentas de posición, relativos a primas de opciones, valoraciones de contratos con liquidación diaria o por diferencias a vencimiento y los pagos compensatorios por efecto de un evento corporativo (sólo aplicable a xRolling Acciones).

12.1 Primas de opciones

CPREMIUMS.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Posición
Descripción	Prima asociada a una operación de opciones liquidada en la sesión
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación
4	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación
5		Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
6		PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición asociada a la operación
7		ContractCode	String(22)		Código de contrato
8		Premium	Amt		Prima resultante de la opción
9		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que está expresada la prima

Sensitivity: C2 Internal

12.2 Variation Margin

CVARMARGIN.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Posición
Descripción	Detalle de la liquidación de pérdidas y ganancias: 1. Para contratos con liquidación diaria está formado por la diferencia entre las valoraciones de posición a principio y a fin de día de día y de las operaciones del día entre precio de la operación y precio de cierre 2. Para forwards y swaps (liquidación por diferencias a vencimiento) está formado por la diferencia de valoración de todas las operaciones históricas, incluidas las de vencimiento) entre precio de operación y precio de liquidación final.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6	🗝	PositionTradeIndicator	char	"1"=Posición abierta al inicio de la sesión "2"=Operación para mark-to- market “4”=Operación para Rollover Mark-to-Market	Indica si se está valorando la posición abierta al inicio de la sesión, una operación o una operación de diferimiento.
7	🗝	TradeID	int		Si PositionTradeIndicator = “2” o “4”, es el número de registro de liquidación de la operación
8	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
9		Quantity	Qty		Volumen
10		InitialPrice	Price		Precio de valoración inicial: Si PositionTradeIndicator = “1”, es el precio de cierre de la sesión anterior. Si PositionTradeIndicator = “2” o “4”, es el precio de la operación CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad.
11		InitialValue	Amt		Valoración inicial de la posición / operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración inicial por el volumen y el multiplicador del contrato. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas
12		SettlPrice	Price		Precio de valoración final:

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
					Si la sesión ha finalizado es el precio de liquidación del contrato. SI la sesión no ha finalizado es el precio de la última operación del contrato. CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad.
13		SettlValue	Amt		Valoración final de la posición / operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración final por el volumen y el multiplicador del contrato. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas
14		VariationMargin	Amt		Pérdidas y ganancias generadas por la posición / operación referida en el registro. Es la diferencia entre la valoración final y la valoración inicial.
15		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que está expresada la valoración. En los contratos de divisa es la divisa cotizada o segunda del par.
16		InitialDate	LocalDate		Fecha de la valoración inicial. Si PositionTradeIndicator = "1", es la fecha de la última sesión en la que se liquidaron pérdidas y ganancias. Si PositionTradeIndicator = "2" o "4", es la fecha de registro de la operación
17		InitialNPV	Amt		Initial Net Present Value
18		FinalNPV	Amt		Final Net Present Value

Sensitivity: C2 Internal

12.3 Variation Margin pendiente

CVARMARGINPEND.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Posición
Descripción	Para forwards y swaps (liquidación por diferencias a vencimiento) es el detalle de la diferencia de valoración de las operaciones entre precio de operación y precio de valoración actual. Este fichero contiene los mismos campos y en el mismo orden que el fichero CVARMARGIN
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6	🗝	PositionTradeIndicator	char	"3"=Operación para valoración	Indica que se está valorando una operación
7	🗝	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación
8	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
9		Quantity	Qty		Volumen
10		InitialPrice	Price		Precio de valoración inicial: Esto es, precio de la operación CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad
11		InitialValue	Amt		Valoración inicial de la operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración inicial por el volumen y el multiplicador del contrato. En operaciones (simples y repos) de deuda se actualiza, además, este valor efectivo según el tipo de interés. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas
12		SettlPrice	Price		Precio de valoración: Si la sesión ha finalizado es el precio de liquidación del contrato. SI la sesión no ha finalizado es el precio de la última operación del contrato. CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
13		CurrGrossTradeAmt	Amt		Valoración actual de la operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración actual por el volumen y el multiplicador del contrato. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas
14		GrossTradeAmtDiff	Amt		Diferencia entre la valoración actual y la inicial
15		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que está expresada la valoración
16		InitialDate	LocalDate		Fecha de registro de la operación

Sensitivity: C2 Internal

12.4 Valoración para productos sin liquidación diaria de variation margin

CVALUATIONOTH.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Posición
Descripción	Detalle de la valoración de las operaciones o posiciones para aquellos productos que no tienen liquidación diaria de pérdidas y ganancias. - Para operaciones de sesiones previas: contiene, en base a la posición abierta a inicio de día, la valoración calculada según la diferencia entre el precio de cierre de la sesión anterior y el de la sesión actual. - Para operaciones del día: contiene, en base a dichas operaciones, la valoración calculada según la diferencia entre precio de la operación y precio de cierre de la sesión actual. Este fichero contiene los mismos campos y en el mismo orden que el fichero CVARMARGIN
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6	🗝	PositionTradeIndicator	char	"1"=Posición abierta al inicio de la sesión "2"=Operación del día	Indica si se está valorando la posición abierta al inicio de la sesión o de una operación
7	🗝	TradeID	int		Si PositionTradeIndicator = 2, es el número de registro de liquidación de la operación
8	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
9		Quantity	Qty		Volumen
10		InitialPrice	Price		Precio de valoración inicial: Si PositionTradeIndicator = "1", es el precio de cierre de la sesión anterior. Si PositionTradeIndicator = "2", es el precio de la operación CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad
11		InitialValue	Amt		Valoración inicial de la posición / operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración inicial por el volumen y el multiplicador del contrato. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas
12		SettlPrice	Price		Precio de valoración final:

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
					Si la sesión ha finalizado es el precio de liquidación del contrato. SI la sesión no ha finalizado es el precio de la última operación del contrato. CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad
13		SettlValue	Amt		Valoración final de la posición / operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración final por el volumen y el multiplicador del contrato. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas
14		GrossTradeAmtDiff	Amt		Valoración de la posición / operación referida en el registro. Es la diferencia entre la valoración final y la valoración inicial.
15		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que está expresada la valoración
16		InitialDate	LocalDate		Fecha de la valoración inicial. Si PositionTradeIndicator = 1, es la fecha de la sesión previa. Si PositionTradeIndicator = 2, es la fecha de la sesión.

Sensitivity: C2 Internal

12.5 Resultado cálculo flujos de diferimiento

CDEFERRALFLOW.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Posición
Descripción	Resultado cálculo flujos de diferimiento
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición asociada a la operación
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
7		LongPosition	Qty		Posición compradora para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
8		ShortPosition	Qty		Posición vendedora para la combinación de cuenta de posición y contrato del registro
9		BuyCashAmount	Amt		Varlor efectivo posición comprada
10		SellCashAmount	Amt		Varlor efectivo posición vendida
11		DeferralDays	Int		Número de días de diferimiento
12		BuyDeferralFlow	Amt		Flujo de diferimiento compras
13		SellDeferralFlow	Amt		Flujo de diferimiento ventas

Sensitivity: C2 Internal

12.6 Pagos compensatorios

CCOMPPAYMENT.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Posición
Descripción	Pagos compensatorios por eventos corporativos
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3		Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4		PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5		ContractCode	String(22)		Código de contrato
6	🗝	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación
7	🗝	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación
8		Quantity	Qty		Volumen de la operación
9		DividendPercentageApplied	Amt		Porcentaje flujo de liquidación de dividendos. Expresado en porcentaje, sin signo con 2 decimales
10		Gross Dividend	Amt		Dividendo bruto.
11		CompensatoryPayment	Amt		Pago compensatorio. Expresado con signo y 2 decimales. (Signo negativo = Pago; Signo positivo = Abono)
12		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que está expresado el pago compensatorio

Sensitivity: C2 Internal

13 Resultados a nivel de Cuenta de Garantías

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado con los datos, a nivel de cuenta de garantías, relativos a las garantías exigidas, así como a la negociación, primas de opciones, valoraciones de contratos con liquidación diaria o por diferencias a vencimiento.

13.1 Detalle del cálculo de garantía diaria

CINIMARGINCALC.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Garantías
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada cuenta de garantías
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(3)		Cuenta de garantías Nota: Campo que se eliminará en futuras versiones, equivale al nuevo campo MarginAccount (campo 22)
5	🗝	ArrayCode	String(3)		Código de matriz de garantías
6		NetPositionMargin	Amt		Garantía posición neta
7		TimeSpreadMargin	Amt		Garantía time-spread o por posición compensada dentro del mismo grupo
8		Scenario	int		Escenario más desfavorable
9		LongPositionDelta	Amt		Delta posición abierta compradora
10		ShortPositionDelta	Amt		Delta posición abierta vendedora
11		NetDelta	Amt		Delta neta
12		DeltaToOffset	Amt		Delta a aplicar en cada grupo de compensación
13		InterCommoditySpreadCredit	Amt		Descuento por spreads obtenido en las compensaciones
14		FinalDelta	Amt		Delta final
15		CommodityMargin	Amt		Garantía Grupo (previa a la compensación de subyacentes)
16		FinalCommodityMargin	Amt		Garantía final
17		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes de este registro
18		NetCommodityMargin	Amt		Garantía Grupo tras la compensación de subyacentes
19		PendingVariationMargin	Amt		Ajuste de garantía por Variation Margin no liquidado

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
20		ScenarioIni	Int		Escenario más desfavorable sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones.
21		NetDeltaIni	Amt		Delta neta sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones
22	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
23		PremiumMargin	Amt		
24	🗝	CalculationType	String(1)	1: Cálculo Ordinario 2: Cálculo con Restricciones Regulatorias	Este campo junto con el campo ArrayCode determina el criterio utilizado para el cálculo de garantías: CalculationType = 1 y ArrayCode institucional: Garantías BME CLEARING CalculationType = 2 y ArrayCode institutional: Garantías BME CLEARING excluyendo los contratos xRolling sobre acciones CalculationType = 2 y retail ArrayCode: Garantías por posiciones en xRolling sobre acciones bajo restricciones regulatorias.
25		IMIncreased	Amt		IM calculado bajo el criterio determinado por CalculationType and Arraycode, incrementado por MarginBufferPercentage

Sensitivity: C2 Internal

13.2 Liquidaciones y garantías por cuenta de garantías y divisa liquidable

CACCOUNTSETTL.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de garantías
Descripción	Importes por cuenta de garantías y garantías diarias
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(3)		Cuenta de garantías Nota: Campo que se eliminará en futuras versiones, equivale al nuevo campo MarginAccount (campo 14)
5	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa liquidable
6		InitialMargin	Amt		Garantías diarias a constituir el día hábil siguiente a SessionDate
7		InitialMarginPledged	Amt		Valoración del colateral depositado por el titular.
8		InitialMarginDiff	Amt		Diferencia entre las garantías diarias exigidas y el colateral depositado
9		VariationMargin	Amt		Pérdidas y ganancias generadas
10		FILLER			
11		FILLER			
12		Premium	Amt		Primas de opciones
13		GrossDeliveryAmt	Amt		Importe a liquidar por entrega física de gas
14	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
15		DeferralFee	Amt		Comisión de diferimiento

Sensitivity: C2 Internal

13.3 Información de las Pruebas Retrospectivas

CBACKTESTING.ch	
Grupo	Resultados por Cuenta de garantías
Descripción	Importes por cuenta de garantías de los resultados de pruebas retrospectivas
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuentade garantías
5	🗝	MarginAccount	String(3)		Cuenta de garantías Nota: Campo que se eliminará en futuras versiones, equivale al nuevo campo MarginAccount (campo 16)
6	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
7		InitialPosValue	Amt		Valor de la posición que se está analizando al cierre de la sesión más antigua analizada.
8		InitialMargin	Amt		Initial Margin de la sesión más antigua analizada.
9		MaximumRisk	Amt		Máxima Pérdida
10		UncoveredRisk	Amt		Pérdida no cubierta por el Initial Margin
11		1DayRisk	Amt		Pérdida a 1 día
12		2DayRisk	Amt		Pérdida a 2 días
13		3DayRisk	Amt		Pérdida a 3 días
14		4DayRisk	Amt		Pérdida a 4 días
15		5DayRisk	Amt		Pérdida a 5 días
16	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías

Sensitivity: C2 Internal

13.4 Información de las Pruebas de Resistencia

CSTRESSTESTING.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de garantías
Descripción	Importes por cuenta de garantías de los resultados de pruebas de resistencia
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
5	🗝	MarginAccount	String(3)		Cuenta de garantías Nota: Campo que se eliminará en futuras versiones, equivale al nuevo campo MarginAccount (campo 11)
6	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
7		WorstScenario	int		Peor escenario del Miembro Compensador
8		WorstScenarioMargin	Amt		Garantía exigida con parámetros peor escenario
9		InitialMargin	Amt		Garantía por posición
10		StressTestRisk	Amt		Riesgo en situación de Stress Test
11	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías

Sensitivity: C2 Internal

13.5 Liquidación de entregas de gas por cuenta de garantías

CDELIVESETTL.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de garantías
Descripción	Liquidaciones debidas a entrega de gas, a nivel de cuenta de garantías
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
5	🗝	ContractCode	String(22)		Código de contrato de derivados que genera la obligación de entrega
6	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
7	🗝	Infraestructure	String(10)	"PVB"=Punto Virtual de Balance Español "TVB"=Tanque Virtual de Balance	Infraestructura
8	🗝	SettlPrice	Price		Precio de liquidación
9	🗝	SettlDate	LocalDate		Fecha de Liquidación monetaria
10		DeliveryAmt	Amt		Importe efectivo antes de impuestos (*)
11		TaxRate	Amt		% Impuesto
12		TaxAmount	Amt		Importe impuesto (*)
13		GrossDeliveryAmt	Amt		Importe Efectivo incluidos impuestos (*)

(*) Si la cantidad es positiva, la cuenta de garantías recibe el flujo de caja. Si el monto es negativo, la cuenta de garantías paga el flujo de caja.

Sensitivity: C2 Internal

13.6 Liquidaciones y garantías por cuenta de garantías y divisa de cálculo

CACCOUNTSETTLCCY.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de garantías
Descripción	Importes por cuenta de garantías de las liquidaciones , expresadas en la divisa de cálculo
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
5	🗝	CalcCurrency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de cálculo. En los contratos de divisa es la divisa cotizada o segunda del par.
6		CalcInitialMargin	Amt		Garantías diarias a constituir el día hábil siguiente a SessionDate expresadas en la divisa de cálculo
7		CalcVariationMargin	Amt		Pérdidas y ganancias generadas expresadas en la divisa de cálculo
8		CalcPremium	Amt		Primas de opciones expresadas en la divisa de cálculo
9		CalcDeliveryAmt	Amt		Importe a liquidar por entrega física de gas expresado en la divisa de cálculo
10		CalcDeferralFee	Amt		Comisión de diferimiento expresada en la divisa de cálculo
11		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de liquidación
12		InitialMargin	Amt		Garantías diarias a constituir el día hábil siguiente a SessionDate expresadas en la divisa de liquidación
13		VariationMargin	Amt		Pérdidas y ganancias generadas expresadas en la divisa de liquidación
14		Premium	Amt		Primas de opciones expresadas en la divisa de liquidación
15		GrossDeliveryAmt	Amt		Importe a liquidar por entrega física de gas expresado en la divisa de liquidación
16		DeferralFee	Amt		Comisión de diferimiento expresada en la divisa de liquidación

Sensitivity: C2 Internal

13.7 Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de garantías – modelo de escenarios

CTOTALINITIALMARGIN.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Garantías
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada cuenta de garantías según modelo empleado (IM calculation method)
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
5		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación”	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
6		IMCalculateMethod	String(12)	"ES" "HVAR" "MAX _HVAR_ES" “MEFFCOM2”	Método de cálculo del Initial Margin
7		InitialMargin	Amt		Initial Margin
8		InitialMarginD-1	Amt		Initial Margin de D-1 (depende del MCalculateMethod (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
9		ESValue	Amt		Valor del Expected Shortfall a nivel de MC (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
10		HVaRValue	Amt		Valor del VaR Histórico a nivel de MC (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
11		HVaRDate	Date		Fecha escenario HVaR. (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
12		MPOR	int		Según topo de cuenta (cliente/propia) (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
13		IMBase	Amt		Initial Margin Base (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
14		IMFloor	Amt		Importe mínimo de garantía (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
15		IliquiditySurcharge	Amt		Incremento del IM debido al ATP (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
16		SolvencyMultiplier	float		Multiplicador de Solvencia

Sensitivity: C2 Internal

13.8 Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de garantías y subyacente – modelo de escenarios

CINIMARGINCALCSCENARIO.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Garantías
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada cuenta de garantías y por subyacente (modelo de escenarios)
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
5	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento “Tablas de Codificación” o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
6		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación”	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
7		LongPositionDelta	Amt		Delta posición abierta compradora
8		ShortPositionDelta	Amt		Delta posición abierta vendedora
9		NetDelta	Amt		Delta neta
10		IMCalculateMethod	String(12)	"ES" "HVAR" "MAX _HVAR_ES" “MEFFCOM2”	IM calculation method
11		P&LES	Amt		Promedio de Pérdidas y ganancias resultantes de una posición específica de una cartera al computar los 18 peores escenarios históricos de la cartera. (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
12		P&LHVaR	Amt		Pérdidas y ganancias resultantes de una posición específica de una cartera al computar el 25 peor escenario histórico de la cartera. (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
13		HVaRDate	String(8)	Formato YYYYMMDD	Fecha escenario HVaR. (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
14		IMFloor	Amt		Importe mínimo de garantía (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")
15		IliquiditySurcharge	Amt		Incremento del IM debido al ATP (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")
16		RiskFactorBuffer	float		Factor multiplicativo relativo a riesgo soberano (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")

Sensitivity: C2 Internal

13.9 Detalle del cálculo de garantía por posición mínima por cuenta de garantías y subyacente – modelo de escenarios

CMARGINFLOORCALC.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Garantías
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía por posición mínima a nivel de cuenta de garantías y por subyacente (modelo de escenarios)
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
4	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías
5	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento “Tablas de Codificación” o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
6		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación”	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
7		LongPositionDelta	Amt		Delta posición abierta compradora (excluyendo posibles arbitrajes sintéticos)
8		ShortPositionDelta	Amt		Delta posición abierta vendedora (excluyendo posibles arbitrajes sintéticos)
9		NetDelta	Amt		
10		IMCalculateMethod	String(12)	"ES" "HVAR" "MAX _HVAR_ES" “MEFFCOM2”	IM calculation method
11		ESValue	Amt		Valor del Expected Shortfall a nivel de Miembro (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
12		HVaRValue	Amt		Valor del VaR Histórico a nivel de Miembro (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
13		IMFloor	Amt		IMFloorFactor sobre el max (HVaRValue, ESValue). (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)

Sensitivity: C2 Internal

13.10 Información de las Pruebas de Resistencia a nivel cuenta de garantías – modelo de escenarios

CMARGINFLOORCALC.ch	
Grupo	Resultados a nivel de Cuenta de Garantías
Descripción	Importes por cuenta de garantías de los resultados de pruebas de resistencia (modelo de escenarios)
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	MarginAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
5	🗝	MarginAccount	String(12)		Cuenta de garantías.
6	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
7		WorstHistScenario	String(8)	Formato YYYMMDD	Fecha del peor escenario histórico
8		WorstHistScenarioP&L	Amt		P&L en el peor escenario histórico
9		WorstHypoScenario	String(18)		Nombre del peor escenario hipotético
10		WorstHypoScenarioP&L	Amt		P&L en el peor escenario hipotético
11		Settlement EOD	Amt		Corresponde a la suma de los importes siguientes calculados en el EOD para el titular: VM, Coste por diferimiento de vencimiento y variación de IM. Únicamente aplican valores negativos.
12		IliquiditySurcharge	Amt		Incremento del IM debido al ATP

Sensitivity: C2 Internal

13.11 Garantías exigidas por cuenta de garantías no asociadas a cuentas de posición

CREQMARGM.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de garantías
Descripción	Importes por cuenta de garantías de las garantías exigidas no asociadas a cuentas de posición
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String (2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ClearingMember	String (4)		Miembro Compensador
4	🗝	MarginAccountMember	String (4)		Miembro al que pertenece la cuenta de garantías
5	🗝	MarginAccount	String (12)		Cuenta de garantías
6	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa liquidable
7		RequiredMargin	Amt		Importe de la garantía exigida.

Sensitivity: C2 Internal

14 Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de Resultados por cuenta de colateral a nivel ECC

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado con información por cuenta de colateral y a nivel de Contrapartica Central (ECC).

14.1 Liquidaciones y garantías por cuenta de colateral

CCPACCOUNTSETTL.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de colateral a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Importes por cuenta de colateral de las liquidaciones y garantías diarias
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de colateral
5	🗝	CollateralAccount	String(3)		Cuenta de colateral Nota: Campo que se eliminará en futuras versiones, equivale al nuevo campo CollateralAccount (campo 13)
6	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
7		InitialMargin	Amt		Garantías diarias a constituir el día hábil siguiente a SessionDate
8		InitialMarginPledged	Amt		Valoración del colateral depositado por la cuenta de colateral.
9		InitialMarginDiff	Amt		Diferencia entre las garantías diarias exigidas y el colateral depositado
10		VariationMargin	Amt		Pérdidas y ganancias generadas
11		Premium	Amt		Primas de opciones
12		GrossDeliveryAmt	Amt		Importe a liquidar por entrega física de gas
13	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
14		DeferralFee	Amt		Comisión de diferimiento

Sensitivity: C2 Internal

14.2 Detalle de las Garantías depositadas

CCPPLEDGES.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de colateral a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Valoración de los activos depositados como colateral en la fecha de la sesión, detalladas por activo y destino
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de colateral (puede estar en blanco para garantías depositadas por el Compensador)
5	🗝	CollateralAccount	String(3)		Cuenta de colateral Nota: Campo que se eliminará en futuras versiones, equivale al nuevo campo CollateralAccount (campo 22)
6	🗝	AssetTCode	String(12)		Código del activo entregado.
7	🗝	MarginInstrument	char	ver Tabla 6 en documento "Tablas de Codificación"	Modo de materialización de garantías
8		AssetType	String(3)	ver Tabla 2 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de activo entregado
9		AssetDescription	String(40)		Descripción del activo entregado
10		AssetCSD	String(20)	ver Tabla 9, para colateral en valores, o Tabla 21, para efectivo, en documento "Tablas de Codificación"	Nombre del Depositario Central del activo o del Banco en el que está depositado el efectivo
11		Haircut	float		Coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo. En tanto por ciento.
12		AssetPrice	Price		Precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido
13		Nominal	Float		Valor nominal del activo entregado. Si es un repo, es su nominal
14		AssetValue	Amt		Valor del activo: (Nominal * Precio * Haircut)/Tipo cambio. Si es un repo, es su nominal valorado a precio de mercado
15	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que está expresado el AssetValue de este registro

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
16	🗝	CSDCode	char	ver Tabla 9, para colateral en valores, o Tabla 21, para efectivo, en documento "Tablas de Codificación"	Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo
17		CFICode	string(6)		Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962
18		Field1	String(20)		BME CLEARING: Reservado para uso futuro CRCC: • Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12) • Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3)
19		Field2	String(20)		BME CLEARING: Reservado para uso futuro CRCC: • Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10) • Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7)
20		Field3	String(20)		Reservado para uso futuro
21		Field4	String(20)		Reservado para uso futuro
22	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
23	🗝	NominalCurrency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que está expresado el Nominal de este registro
24		ExchangeRate	Price		Tipo de cambio aplicable

Sensitivity: C2 Internal

14.3 Detalle por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo

CCPCASHMOVBRKD.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de colateral a nivel de Contrapartida Central
Descripción	**Información del movimiento de efectivo de un Miembro Compensador desglosado por Miembro, Cuenta de Colateral, concepto y grupo de movimiento de efectiro. Incluye conceptos diarios y mensuales.**
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de Grupo de Contratos. Para conceptos no relacionados con un Grupo de Contratos concreto contendrá el código de contrapartida central.
4	🗝	CashMovGroup	String(8)		Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos.
5	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
6	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de colateral
7	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
8	🗝	ConceptCode	String(2)	ver Tabla 4 en documento "Tablas de Codificación"	Concepto de movimiento de efectivo. Para los contratos sobre crypto divisas, el concepto de movimiento de efectivo 1 (Garantías) será solo informativo y no formará parte de los flujos de liquidación diaria.
9	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
10	🗝	PaymentMethod	String(2)	ver Tabla 5 en documento "Tablas de Codificación"	Método de pago
11		ConceptDescription	String(50)		Descripción del concepto (si el código de concepto es "99")
12		CashAmount	Amt		Importe del movimiento de efectivo resultante (cargo si es < 0, abono si es > 0)
13		ValueDate	LocalDate		Fecha valor del movimiento de efectivo

Sensitivity: C2 Internal

14.4 Resumen agregado por cuenta de colateral de los Movimientos de efectivo

CCPCASHMOVCC.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de colateral a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Información del movimiento de efectivo de un Miembro Compensador desglosado por Miembro, Cuenta de Colateral y grupo de movimiento de efectivo.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de Grupo de Contratos. Para conceptos no relacionados con un Grupo de Contratos concreto contendrá el código de contrapartida central.
4	🗝	CashMovGroup	String(8)		Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos.
5	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
6	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de colateral
7	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
8	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
9	🗝	PaymentMethod	String(2)	ver Tabla 5 en documento "Tablas de Codificación"	Método de pago
10		CashAmount	Amt		Importe del movimiento de efectivo resultante (cargo si es < 0, abono si es > 0)
11		ValueDate	LocalDate		Fecha valor del movimiento de efectivo

Sensitivity: C2 Internal

14.5 Información de las Pruebas de Resistencia a nivel cuenta de colateral – modelo de escenarios

CSTRESSTESTINGSCENARIOCOLAC.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de colateral
Descripción	Importes por cuenta de colateral de los resultados de pruebas de resistencia (modelo de escenarios)
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de colateral
5	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
6	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
7		WorstHistScenario	String(8)	Formato YYYMMDD	Fecha del peor escenario histórico
8		WorstHistScenarioRiskBase	Amt		Riesgo base por stress de la cuenta de colateral en el peor escenario histórico (ST Hist Base)
9		WorstHypoScenario	String(18)		Nombre del peor escenario hipotético
10		WorstHypoScenarioRiskBase	Amt		Riesgo base por stress de la cuenta de colateral en el peor escenario hipotético (ST Hypo Base)
11		InitialMarginPosted	Amt		Importe de la garantía depositada en la cuenta de colateral

Sensitivity: C2 Internal

14.6 Garantías exigidas y colateral depositado por cuenta de colateral no asociadas a cuentas de posición

CCPREQMARGM.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de colateral a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Importes por cuenta de colateral del colateral depositado y las garantías exigidas no asociadas a cuentas de posición
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de colateral
5	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
6	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa liquidable
7		RequiredMargin	Amt		Importe de la garantía exigida.
8		CollateralPledged	Amt		Valoración del colateral depositado por la cuenta de colateral.
9		MarginDiff	Amt		Diferencia entre las garantías exigidas y el colateral depositado

Sensitivity: C2 Internal

14.7 Previsión del colateral asignado a cada cuenta de colateral para la siguiente sesión

CCPALLOCAS.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de colateral a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Previsión del colateral asignado a cada cuenta de colateral incluyendo los movimientos de colateral en efectivo que resulten del cierre de la sesión actual.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
4	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
5	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de colateral
6	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
7	🗝	AssetCode	String(12)		Código del activo entregado
8	🗝	MarginInstrument	char	ver Tabla 6 en documento "Tablas de Codificación"	Modo de materialización de garantías
9		AssetType	String(3)	ver Tabla 2 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de activo entregado
10		AssetDescription	String(40)		Descripción del activo entregado
11		AssetCSD	String(20)	ver Tabla 9 en documento "Tablas de Codificación"	Nombre del Depositario Central del activo
12		Haircut	float		Coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo. En tanto por ciento.
13		AssetPrice	Price		Precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido
14		Nominal	Float		Valor nominal del colateral total asignado a la cuenta.
15		AssetValue	Amt		Valoración del colateral total asignado a la cuenta (Nominal * Precio * Haircut)/Tipo de cambio.
16	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes de AssetValue de este registro
17	🗝	CSDCode	char	ver Tabla 9, para colateral en valores, o Tabla 21, para efectivo, en documento "Tablas de Codificación"	Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo
18		NominalRequired	Float		Valor nominal del colateral requerido asignado a la cuenta

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
19		AssetValueRequired	Amt		Colateral requerido valorado asignado a esta cuenta
20		NominalExcess	Float		Colateral requerido valorado asignado a esta cuenta
21		AssetValueExcess	Amt		Valoración del exceso de nominal asignado.
22		ValueDate	LocalDate		Fecha valor de los asignados (siguiente día hábil a la fecha sesión).
23	🗝	CollateralSourceAccount	String(12)		Indica el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la propia cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer.
24		Field1	String(20)		BME CLEARING: Reservado para uso futuro CRCC: • Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12) • Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3)
25		Field2	String(20)		BME CLEARING: Reservado para uso futuro CRCC: • Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10) • Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7)
26		Nominal Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes Nominal de este registro
27		Exchange Rate	Price		Tipo de cambio aplicable

Sensitivity: C2 Internal

14.8 Colateral asignado a cada cuenta de colateral

CCPALLOCBS.ch	
Grupo	Resultados por cuenta de colateral a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Distribución y valoración del colateral asignado a cada cuenta de colateral a cierre de sesión.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
4	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
5	🗝	CollateralAccountMember	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de colateral
6	🗝	CollateralAccount	String(12)		Cuenta de colateral
7	🗝	AssetCode	String(12)		Código del activo entregado.
8	🗝	MarginInstrument	char	ver Tabla 6 en documento "Tablas de Codificación"	Modo de materialización de garantías
9		AssetType	String(3)	ver Tabla 2 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de activo entregado
10		AssetDescription	String(40)		Descripción del activo entregado
11		AssetCSD	String(20)	ver Tabla 9, para colateral en valores, o Tabla 21, para efectivo, en documento "Tablas de Codificación"	Nombre del Depositario Central del activo o del Banco en el que está depositado el efectivo
12		Haircut	float		Coeficiente que se aplica al precio en la valoración del activo. En tanto por ciento.
13		AssetPrice	Price		Precio del activo al cierre. Para los bonos y obligaciones incluye cupón corrido
14		Nominal	Float		Valor nominal del colateral total asignado a la cuenta.
15		AssetValue	Amt		Valoración del colateral total asignado a la cuenta (Nominal * Precio * Haircut))/Tipo de cambio.
16	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes de AssetValue de este registro
17	🗝	CSDCode	char	ver Tabla 9, para colateral en valores, o Tabla 21, para efectivo, en	Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía o del Banco en el que está depositado el efectivo

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
				documento "Tablas de Codificación"	
18		NominalRequired	Float		Valor nominal del colateral requerido asignado a la cuenta
19		AssetValueRequired	Amt		Colateral requerido valorado asignado a esta cuenta
20		NominalExcess	Float		Valor nominal del colateral en exceso asignado a la cuenta.
21		AssetValueExcess	Amt		Valoración del exceso de nominal asignado.
22		ValueDate	LocalDate		Fecha valor de los asignados (sesión en curso, SessionDate).
23	🗝	CollateralSourceAccount	String(12)		Indica el origen del colateral. Cuando el colateral sea de la cuenta se mostrará la misma cuenta de colateral. Cuando sea de una cuenta buffer, se mostrará el código de la cuenta buffer.
24		Field1	String(20)		BME CLEARING: Reservado para uso futuro CRCC: • Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12) • Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3)
25		Field2	String(20)		BME CLEARING: Reservado para uso futuro CRCC: • Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10) • Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7)
26		Nominal Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes Nominal de este registro
27		Exchange Rate	Price		Tipo de cambio aplicable

Sensitivity: C2 Internal

15 Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado con los datos, a nivel de cuenta de posición, relativos a las garantías por posición y a las liquidaciones de variation margin y primas de opciones.

Estos ficheros sólo estarán cumplimentados para los Miembros que hayan contratado el servicio de Registro de Detalle ofrecido por BME CLEARING, y contendrán información para cada una de las cuentas de posición.

15.1 Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de posición

CINIMARGINCALCDET.ch	
Grupo	Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada cuenta de posición
Destinatarios	Miembro
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	ArrayCode	String(3)		Código de matriz de garantías
6		NetPositionMargin	Amt		Garantía posición neta
7		TimeSpreadMargin	Amt		Garantía time-spread o por posición compensada dentro del mismo grupo
8		Scenario	Int		Escenario más desfavorable
9		LongPositionDelta	Amt		Delta posición abierta compradora
10		ShortPositionDelta	Amt		Delta posición abierta vendedora
11		NetDelta	Amt		Delta neta
12		DeltaToOffset	Amt		Delta a aplicar en cada grupo de compensación
13		InterCommoditySpreadCredit	Amt		Descuento por spreads obtenido en las compensaciones
14		FinalDelta	Amt		Delta final
15		CommodityMargin	Amt		Garantía Grupo (previa a la compensación de subyacentes)
16		FinalCommodityMargin	Amt		Garantía final
17		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes de este registro
18		NetCommodityMargin	Amt		Garantía Grupo tras la compensación de subyacentes
19		PendingVariationMargin	Amt		Ajuste de garantía por Variation Margin no liquidado
20		ScenarioIni	Int		Escenario más desfavorable sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones.

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
21		NetDeltaIni	Amt		Delta neta sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones
22		PremiumMargin	Amt		
23	🗝	CalculationType	String(1)	1: Cálculo Ordinario 2: Cálculo con Restricciones Regulatorias	Este campo junto con el campo ArrayCode determina el criterio utilizado para el cálculo de garantías: • CalculationType = 1 y ArrayCode institucional: Garantías BME CLEARING • CalculationType = 2 y ArrayCode institutional: Garantías BME CLEARING excluyendo los contratos xRolling sobre acciones • CalculationType = 2 y retail ArrayCode: Garantías por posiciones en xRolling sobre acciones bajo restricciones regulatorias.
24		IMIncreased	Amt		IM calculado bajo el criterio determinado por CalculationType and Arraycode, incrementado por MarginBufferPercentage

Sensitivity: C2 Internal

15.2 Liquidaciones y garantías por cuenta de posición y divisa liquidable

CACCOUNTSETTLDET.ch	
Grupo	Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición
Descripción	Importes por cuenta de posición de las liquidaciones y garantías diarias
Destinatarios	Miembro
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
6		InitialMargin	Amt		Garantías diarias a constituir el día hábil siguiente a SessionDate
7		VariationMargin	Amt		Pérdidas y ganancias generadas
8		Premium	Amt		Primas de opciones
9		GrossDeliveryAmt	Amt		Importe a liquidar por entrega física de gas
10		DeferralFee	Amt		Comisión de diferimiento

Sensitivity: C2 Internal

15.3 Liquidaciones y garantías por cuenta de posición y divisa de cálculo

CACCOUNTSETTLCCYDET.ch	
Grupo	Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición
Descripción	Importes por cuenta de posición de las liquidaciones , expresadas en la divisa de cálculo
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	CalcCurrency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de cálculo. En los contratos de divisa es la divisa cotizada o segunda del par.
6		CalcInitialMargin	Amt		Garantías diarias a constituir el día hábil siguiente a SessionDate expresadas en la divisa de cálculo
7		CalcVariationMargin	Amt		Pérdidas y ganancias generadas expresadas en la divisa de cálculo.
8		CalcPremium	Amt		Primas de opciones expresadas en la divisa de cálculo
9		CalcDeliveryAmt	Amt		Importe a liquidar por entrega física de gas expresado en la divisa de cálculo
10		CalcDeferralFee	Amt		Comisión de diferimiento expresada en la divisa de cálculo.
11		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de liquidación
12		InitialMargin	Amt		Garantías diarias a constituir el día hábil siguiente a SessionDate expresadas en la divisa de liquidación
13		VariationMargin	Amt		Pérdidas y ganancias generadas expresadas en la divisa de liquidación
14		Premium	Amt		Primas de opciones expresadas en la divisa de liquidación
14		GrossDeliveryAmt	Amt		Importe a liquidar por entrega física de gas expresado en la divisa de liquidación
16		DeferralFee	Amt		Comisión de diferimiento expresada en la divisa de liquidación

Sensitivity: C2 Internal

15.4 Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de posición – modelo de escenarios

CTOTALINITIALMARGINDET.ch	
Grupo	Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada cuenta de posición según modelo empleado (IM calculation method)
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación”	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
6		IMCalculateMethod	String(12)	"ES" "HVAR" "MAX _HVAR_ES" “MEFFCOM2”	Método de cálculo del Initial Margin
7		InitialMargin	Amt		Initial Margin
8		InitialMarginD-1	Amt		Initial Margin de D-1 (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
9		ESValue	Amt		Valor del Expected Shortfall a nivel de MC (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
10		HVaRValue	Amt		Valor del VaR Histórico a nivel de MC (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
11		HVaRDate	Date		Fecha escenario HVaR. (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
12		MPOR	int		Según topo de cuenta (cliente/propia) (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
13		IMBase	Amt		Initial Margin Base (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
14		IMFloor	Amt		Importe mínimo de garantía. (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
15		IliquiditySurcharge	Amt		Incremento del IM debido al ATP (no aplica al método de cálculo “MEFFCOM2”)
16		SolvencyMultiplier	float		Multiplicador de Solvencia

Sensitivity: C2 Internal

15.5 Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de posición y subyacente – modelo de escenarios

CINIMARGINCALCSCENARIODET.ch	
Grupo	Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada cuenta de posición y por subyacente (modelo de escenarios)
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
6		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
7		LongPositionDelta	Amt		Delta posición abierta compradora
8		ShortPositionDelta	Amt		Delta posición abierta vendedora
9		NetDelta	Amt		Delta neta
10		IMCalculateMethod	String(12)	"ES" "HVAR" "MAX _HVAR_ES" "MEFFCOM2"	IM calculation method
11		P&LES	Amt		Promedio de Pérdidas y ganancias resultantes de una posición específica de una cartera al computar los 18 peores escenarios históricos de la cartera. (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")
12		P&LHVaR	Amt		Pérdidas y ganancias resultantes de una posición específica de una cartera al computar el 25 peor escenario histórico de la cartera. (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")
13		HVaRDate	Date		Fecha escenario HVaR. (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")
14		IMFloor	Amt		Importe mínimo de garantía (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")

Sensitivity: C2 Internal

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
15		IliquiditySurcharge	Amt		Incremento del IM debido al ATP (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")
16		RiskFactorBuffer	float		Factor multiplicativo relativo a riesgo soberano (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")

Sensitivity: C2 Internal

15.6 Detalle del cálculo de garantía por posición mínima por cuenta de posición – modelo de escenarios

CMARGINFLOORCALCDET.ch	
Grupo	Registro de detalle. Resultados a nivel de cuenta de posición
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía por posición mínima a nivel de cuenta de garantías y por subyacente (modelo de escenarios)
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta de posición
4	🗝	PositionAccount	String(5)		Cuenta de posición
5	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
6		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
7		LongPositionDelta	Amt		Delta posición abierta compradora (excluyendo posibles arbitrajes sintéticos)
8		ShortPositionDelta	Amt		Delta posición abierta vendedora (excluyendo posibles arbitrajes sintéticos)
9		NetDelta	Amt		
10		IMCalculateMethod	String(12)	"ES" "HVAR" "MAX_HVAR_ES" "MEFFCOM2"	IM calculation method
11		ESValue	Amt		Valor del Expected Shortfall a nivel de Miembro (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")
12		HVaRValue	Amt		Valor del VaR Histórico a nivel de Miembro (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")
13		IMFloor	Amt		IMFloorFactor sobre el max (HVaRValue, ESValue). (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")

Sensitivity: C2 Internal

16 Resultados para Miembros Compensadores

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado con los datos, a nivel de Compensador, de las garantías exigidas y depositadas, así como los datos finales de movimientos de efectivo y facturación.

16.1 Garantías requeridas al Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central

CCPMARGINSCLM.ch.XML	
Grupo	Resultados para Miembros Compensadores a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Garantías exigidas y depositadas, desglosadas en conceptos
Destinatarios	Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

El esquema XSD relacionado (CCPMARGINSCLM_v1_7.xsd) está disponible en:
http://www.bmeclearing.es/docs/esp/Tecnologia/esquemas/CCPMARGINSCLM_v1_7.xsd

Versión XSD: 1.7

#	ELEMENTO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	SessionDate		Fecha de sesión
2	CCPCode		Código de contrapartida central
3	ClearingMember		Miembro Compensador
4	Equity		Recursos propios del Miembro Compensador
5	Solvencia		Coeficiente de Solvencia del Miembro Compensador a efectos de límites.
6	Currency	Ver Tabla 1 en documento "Tablas de codificación"	Divisa en la que se expresan los importes
7	RequiredMargins		Garantías exigidas al miembro Compensador
7.1	Amount		Importe total de las garantías exigidas
7.2	RequiredMarginDetail		Detalle de una de las garantías exigidas (un elemento para cada una de las garantías exigidas)
7.2.1	MarginType	Ver Tabla 3 en documento "Tablas de codificación"	Tipo de garantía exigida
7.2.2	ContractGroup		Grupo de contratos en el que se exige la garantía (no está presente cuando la garantía se exige a nivel de contrapartida central)
7.2.3	Amount		Importe de la garantía exigida
7.2.3.1	RequiredMarginMemberDetail		Desglose por Miembro de una garantía exigida (un elemento para cada Miembro)
7.2.3.1.1	Member		Miembro al que se exige la garantía
7.2.3.1.2	Amount		Importe de la garantía exigida
7.2.4	RequiredMarginComponent		Componente de una garantía exigida
7.2.4.1	MarginType	Ver Tabla 3 en documento "Tablas de codificación"	Tipo de garantía exigible

Sensitivity: C2 Internal

#	ELEMENTO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
7.2.4.2	TotalRequiredAmount		Importe de la garantía exigible
7.2.4.3	Credit		Crédito que concede la contrapartida central sobre el importe exigible (habitualmente en función de los recursos propios y el rating coeficiente de solvencia)
7.2.4.4	Amount		Importe exigido (TotalRequiredAmount – Credit)
7.2.4.5	ContractGroup		Grupo de contratos en los que se exige la garantía. No está presente cuando la garantía se exige a nivel de contrapartida central
7.2.5	CCD		Código Cliente Compensador Directo Patrocinado
8	PostedMargins		Garantías constituidas por el Compensador a cierre de sesión
8.1	Amount		Valoración total de las garantías constituidas
8.2	PostedMarginDetail		Detalle de un tipo de garantías constituidas (un subelemento por tipo de garantía)
8.2.1	MarginInstrument	ver Tabla 6 en documento "Tablas de Codificación"	Modo de materialización de garantías
8.2.2	Amount		Valoración de la garantía materializada de este modo
8.2.3	AmountDetail		Desglose de garantías depositadas según el MarginInstrument
8.2.3.1	CMBuffer		Total del valor efectivo depositado como colateral en la cuenta de colateral buffer del Compensador.
8.2.3.2	CMDefaultFund		Total del valor efectivo depositado como colateral en cuentas de colateral que ajustan automático o por déficit y cubren el Default Fund.
8.2.3.3	CMAdditionalMargin		Total del valor efectivo depositado como colateral cuentas de colateral que ajustan automático o por déficit y cubren garantías Individuales o Extraordinarias.
9	CashMovement		Movimientos de efectivo
9.1	Amount		Importe del movimiento de efectivo resultante cuando se constituyan garantías en efectivo (cargo si es < 0, abono si es > 0)
9.2	CashMovementDetail		Desglose de movimientos de efectivo
9.2.1	CMBuffer		Movimiento de efectivo de efectivo en la cuenta de colateral buffer del Compensador.
9.2.2	CMDefaultFund		Movimiento de efectivo en cuentas de colateral que ajustan automático o por déficit y cubren el Default Fund.
9.2.3	CMAdditionalMargin		Movimiento de efectivo en cuentas de colateral que ajustan automático o por déficit y cubren garantías Individuales o Extraordinarias.
10	LRIUsage		Consumo de Límite de Riesgo Intradía resultante a fin de sesión.
11	LRINextSession		Límite de Riesgo Intradía resultante para la siguiente sesión.

Sensitivity: C2 Internal

#	ELEMENTO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
12	DFSTInformation		Información relacionada con el Stress Test de la Garantía Colectiva
12.1	DFSTHolderPM		Sobrante de Garantías por Posición de la cuenta de colateral disponible para el Compensador en el Stress Test de la Garantía Colectiva
12.2	DFSTClearingMemberRisk		Riesgo Stress Test del Compensador
12.2.1	ContractGroup		Subgrupo de contratos
12.2.2	Amount		Importe de riesgo
13	IFNewTrades		Garantía Individual para Nuevas Operaciones
14	LRIEndOfSession		Límite de Riesgo Intradía resultante a fin de sesión
15	IntradayAdditionalMargins		Garantías Intradía
15.1	MarginType	Ver Tabla 3 en documento "Tablas de codificación"	Tipo de garantía exigida
15.2	ContractGroup		Grupo de contratos en el que se exige la garantía
15.3	Amount		Importe de la garantía exigida
15.4	RequiredMarginMemberDetail		Desglose por Miembro de una garantía exigida (un elemento para cada Miembro)
15.4.1	Member		Miembro al que se exige la garantía
15.4.2	Amount		Importe de la garantía exigida

Sensitivity: C2 Internal

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

CCPCASHMOVCLM.ch	
Grupo	Resultados para Miembros Compensadores a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Información del movimiento de efectivo a realizar por Miembro Compensador desglosado por Miembro, concepto y grupo de movimiento de efectivo. Incluye conceptos diarios y mensuales.
Destinatarios	Miembro, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de Grupo de Contratos. Para conceptos no relacionados con un Grupo de Contratos concreto contendrá el código de contrapartida central.
4	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
5	🗝	Member	String(4)		Miembro al que es atribuible el cargo o abono que se detalla en el registro (puede ir en blanco)
6	🗝	ConceptCode	String(2)	ver Tabla 4 en documento "Tablas de Codificación"	Concepto de movimiento de efectivo. Para los contratos sobre crypto divisas, el concepto de movimiento de efectivo 1 (Garantías) será solo informativo y no formará parte de los flujos de liquidación diaria.
7	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
8	🗝	PaymentMethod	String(2)	ver Tabla 5 en documento "Tablas de Codificación"	Método de pago
9		ConceptDescription	String(50)		Descripción del concepto (si el código de concepto es "99")
10		CashAmount	Amt		Importe del movimiento de efectivo resultante (cargo si es < 0, abono si es > 0)
11		ValueDate	LocalDate		Fecha valor del movimiento de efectivo
12	🗝	CashMovGroup	String(8)		Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos.

Sensitivity: C2 Internal

16.3 Información del Riesgo de Concentración del Miembro Compensador – modelo de escenarios

CCONCENTRATIONRISK.ch	
Grupo	Resultados para Miembros Compensadores
Descripción	Información del riesgo de concentración del Miembro Compensador y Subyacente (modelo de escenarios)
Destinatarios	Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	🗝	ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 13 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP.ch	Código de subgrupo de contratos
5	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
6		LongPositionDelta	Amt		Delta posición abierta compradora (incluye todos los titulares del MC + titulares de sus MNC)
7		ShortPositionDelta	Amt		Delta posición abierta vendedora (incluye todos los titulares del MC + titulares de sus MNC)
8		DeltaApplied	Amt		Delta máxima entre la posición abierta de compra y la de venta (incluye todos los titulares del MC + titulares de sus MNC).
9		IliquiditySurcharge	Amt		Incremento del IM debido al ATP

Sensitivity: C2 Internal

16.4 Información de las Pruebas de Resistencia a nivel miembro – modelo de escenarios

CTOTALSTRESSTESTING.ch	
Grupo	Resultados para Miembros Compensadores
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía por Stress Test a nivel Miembro Compensador
Destinatarios	Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación”	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"
5		WorstHistScenario	String(8)	Formato YYYYMMDD	Fecha del peor escenario histórico
6		WorstHistScenarioRisk	Amt		Peor escenario histórico (ST Hist Base)
7		WorstHypoScenario	String(18)		Nombre del peor escenario hipotético
8		WorstHypoScenarioRisk	Amt		Peor escenario hipotético (ST Hipo Base)
9		ConcentrationRiskCM	Amt		Ajuste por riesgo de concentración del Miembro Compensador siempre que el campo Clearing Member y Member coincidan.
10		IliquiditySurcharge	Amt		Incremento del IM debido al ATP de todos clientes Miembro
11		IMBaseCM	Amt		IM calculado en el EOD del MC siempre que el campo Clearing Member y Member coincidan.
12		STBaseMC	Amt		Stress Test Base a nivel Miembro Compensador siempre que el campo Clearing Member y Member coincidan.

Sensitivity: C2 Internal

17 Resultados para Agentes de Pago

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado con los movimientos de efectivo de liquidación para la entidad Domiciliataria.

17.1 Movimientos de efectivo para el Agente de Pagos a nivel de Contrapartida Central

CCPCASHMOVTREAS.ch	
Grupo	Resultados para Agentes de Pago
Descripción	Movimientos de efectivo a realizar por el Agente de Pagos
Destinatarios	Entidad Domiciliataria, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	CAMPO	TIPO	VALORES VÁLIDOS	DESCRIPCIÓN
1	🗝	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	🗝	CCPCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	🗝	TreasuryEntity	String(4)		Agente de Pagos
4	🗝	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador al que corresponde el movimiento de efectivo
5	🗝	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
6	🗝	PaymentMethod	String(2)	ver Tabla 5 en documento "Tablas de Codificación"	Método de pago
7		CashAmount	Amt		Importe del movimiento de efectivo resultante (cargo si es < 0, abono si es > 0)
8		ValueDate	LocalDate		Fecha valor del movimiento de efectivo
9	🗝	Type	char	1= Exento de impuestos 2= Sujeto a Impuestos	BME CLEARING: Este campo no aplica. Valor siempre 1. CRCC: Indica si el importe corresponde a conceptos de liquidación que están exentos de impuestos o sujetos a impuestos
10	🗝	CashMovGroup	String(8)		Grupo de movimientos de efectivo asociados al Agente de Pagos.

Sensitivity: C2 Internal

Tramontana, 2 bis
28231 Las Rozas (Madrid)
www.bmeclearing.es

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