

# MeffStation

# Ficheros de Datos de Liquidación

BME CLEARING S/MART v12.34

**BME CLEARING**

Agosto 2025

## Historial de Revisiones

| FECHA ACTUALIZACIÓN | VERSIÓN | DESCRIPCIÓN  | AUTOR                     |
|---------------------|---------|--|---------------------------|
| 9 de octubre 2023   | 11.27   | Cambios en ficheros CPLEDGES, CALLOCAS y CALLOCBs.<br>Nuevo fichero COLLATERALFEES.  | BME Clearing Architecture |
| 10 de enero 2024    | 11.30   | Cambios en ficheros CCPOLLATERALFEES, CPHYSDEL, CDELIVSETTL y CPHYSDELDETS.<br>Nuevo fichero CPHYSDELFEES.                     | BME Clearing Architecture |
| 21 de febrero 2024  | 11.30   | Cambios en ficheros CASHMOVBRKD, CCPCASHMOVCC, CCPALLOCAS, CCPMARGINSCLM y CCPCASHMOVCLM<br>Cambio en fichero CCPOLLATERALFEES | BME Clearing Architecture |
| 14 de marzo 2024    | 11.32   | Cambios en fichero CVALARRAYS. Cambios en fichero CCONTRSTAT. Cambios en fichero CCPOLLATERALFEES.                             | 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 |
| Noviembre de 2024   | 12.34   | Nuevo campo clave en CFEESBRKD   | BME Clearing Architecture |
| 9 de enero de 2025  | 12.34   | Nuevos valores admitidos y nuevas descripciones de valores en campo Periodicity en CCONTRTYP                                   | BME Clearing Architecture |

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.

© 2025 BME. Todos los derechos reservados.

## Índice

|          |  |           |
|----------|--|-----------|
| <b>1</b> | <b>INTRODUCCIÓN .....</b>  | <b>12</b> |
| 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        |
| <b>2</b> | <b>DATOS GENERALES .....</b>   | <b>17</b> |
| 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        |
| <b>3</b> | <b>INFORMACIÓN PÚBLICA DIARIA.....</b>                               | <b>33</b> |
| 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        |
| <b>4</b> | <b>DATOS PRIVADOS DE CONFIGURACIÓN .....</b>                         | <b>37</b> |
| 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        |

|          |   |           |
|----------|---|-----------|
| 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        |
| <b>5</b> | <b>DATOS PARA CÁLCULO DE GARANTÍAS .....</b>                              | <b>48</b> |
| 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        |
| <b>6</b> | <b>DATOS PARA CÁLCULO DE GARANTÍAS – MODELO DE ESCENARIOS.....</b>        | <b>59</b> |
| 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        |
| <b>7</b> | <b>OPERACIONES.....</b>   | <b>67</b> |
| 7.1      | Operaciones .....   | 67        |
| 7.2      | Operaciones que no liquidan en la sesión .....                            | 70        |
| <b>8</b> | <b>GESTIÓN DE OPERACIONES .....</b>                                       | <b>73</b> |
| 8.1      | Operaciones vivas .....   | 73        |
| 8.2      | Asignaciones y traspasos realizados .....                                 | 75        |
| 8.3      | Give-Outs.....  | 76        |
| 8.4      | Give-Ins para miembro Destino .....                                       | 77        |

|           |   |            |
|-----------|---|------------|
| 8.5       | Give-Ins para Compensador de Miembro Destino.....                                 | 79         |
| <b>9</b>  | <b>POSICIÓN ABIERTA .....</b>   | <b>81</b>  |
| 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         |
| <b>10</b> | <b>EJERCICIO – VENCIMIENTO – ENTREGA .....</b>                                    | <b>88</b>  |
| 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         |
| <b>11</b> | <b>COMISIONES.....</b>  | <b>98</b>  |
| 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        |
| <b>12</b> | <b>RESULTADOS A NIVEL DE CUENTA DE POSICIÓN .....</b>                             | <b>106</b> |
| 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        |
| 12.6      | Pagos compensatorios .....  | 114        |

|           |  |            |
|-----------|--|------------|
| <b>13</b> | <b>RESULTADOS A NIVEL DE CUENTA DE GARANTÍAS .....</b>   | <b>115</b> |
| 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<br>124                |            |
| 13.9      | Detalle del cálculo de garantía por posición mínima por cuenta de garantías y subyacente –<br>modelo de escenarios ..... | 126        |
| 13.10     | Información de las Pruebas de Resistencia a nivel cuenta de garantías – modelo de escenarios<br>127                      |            |
| 13.11     | Garantías exigidas por cuenta de garantías no asociadas a cuentas de posición.....                                       | 128        |
| <b>14</b> | <b>REGISTRO DE DETALLE. RESULTADOS A NIVEL DE CUENTA DE RESULTADOS POR CUENTA DE<br/>COLATERAL A NIVEL ECC .....</b>     | <b>129</b> |
| 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<br>134                      |            |
| 14.6      | Garantías exigidas y colateral depositado por cuenta de colateral no asociadas a cuentas de<br>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        |
| <b>15</b> | <b>REGISTRO DE DETALLE. RESULTADOS A NIVEL DE CUENTA DE POSICIÓN.....</b>  | <b>140</b> |
| 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        |
| 15.5      | Detalle del cálculo de garantía diaria por cuenta de posición y subyacente – modelo de escenarios<br>145                 |            |

|           |   |            |
|-----------|---|------------|
| 15.6      | Detalle del cálculo de garantía por posición mínima por cuenta de posición – modelo de escenarios | 147        |
| <b>16</b> | <b>RESULTADOS PARA MIEMBROS COMPENSADORES .....</b>   | <b>148</b> |
| 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        |
| <b>17</b> | <b>RESULTADOS PARA AGENTES DE PAGO .....</b>  | <b>154</b> |
| 17.1      | Movimientos de efectivo para el Agente de Pagos a nivel de Contrapartida Central .....            | 154        |

## 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 |
| CDEFERRALFEEDPAR.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 |

|                                 |     |
|---------------------------------|-----|
| 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  |
| CSPOTTRADESBRKDDDET.ch .....    | 91  |
| CDELIVERABLES.DB .....          | 93  |
| CPHYSDDELDETS.ch .....          | 95  |
| CPHYSDDEL.ch .....              | 96  |
| CPHYSDDELFEES.ch .....          | 96  |
| CFEESBRKD.ch .....              | 98  |
| CFEES.ch .....                  | 100 |
| CDEFERRALFEE.ch .....           | 101 |
| CPOSADJFEE.ch .....             | 103 |
| CCPCOLLATERALFEES.ch .....      | 104 |
| 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 |
| CCACCOUNTSETTL.ch .....              | 129 |
| CCPLEDGES.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 |

## 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.

- 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)         |

(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 "Y" 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").

- **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.

#### 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.

## 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 |

## 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<br>2: Fin sesión | Estado de los ficheros                               |

## 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           |

## 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   |

## 2.5 Subgrupos de contratos

| CCONTRGRP.ch  |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Datos Generales   |
| Descripción   | Subgrupos de contratos del grupo<br>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 |

## 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<br>"2"=Binomial<br>"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 |   | All                     | String(12) |  | Identificador All  |
| 13 |   | PriceType               | Int        | 1 = Precio<br>2= Rentabilidad  |  |
| 14 |   | SecurityType            | String(1)  | "E"= Strategy<br>"F"=Future<br>"G"=xRolling<br>"M"=Forward<br>"O"=Option<br>"R"=Roll-over<br>"W"=Swap<br>"S"=Spot<br>"X"=Other | Tipo de producto   |
| 15 |   | FlexibleIndicator       | String(1)  | "Y" - No estándar<br>"N" - Estándar  | Para indicar si es estándar o no   |
| 16 |   | ExerciseStyle           | String(1)  | "A"- Americano<br>"E" - Europeo  | Tipo de Ejercicio  |
| 17 |   | SettMethod              | String(1)  | "P" - física   | Método de liquidación  |

| #  | * | CAMPO           | TIPO      | VALORES VÁLIDOS  | DESCRIPCIÓN   |
|----|---|-----------------|-----------|--|---|
|    |   |                 |           | "C" - cash   |   |
| 18 |   | PutorCall       | String(1) | "P" - Put<br>"C" - Call  | Tipo de opción  |
| 19 |   | Periodicity     | String(1) | "Y" - Anual<br>"H" - Semestral<br>"S" - Temporada<br>"Q" - Trimestral<br>"M" - Mensual<br>"m" - Resto de mes<br>"K" - Semanal (L-D)<br>"k" - Resto de semana<br>"B" - Semanal (L-V)<br>"E" - Semanal (S-D)<br>"D" - Diario (excepto Futuro GNL TTF)<br>"d" - Diario (Futuro GNL TTF)<br>"A" - Mensual (Auxiliar) |   |
| 20 |   | AdjustmentsRule | String(1) | "E" - Sólo extraordinarios<br>"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   |

## 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<br>YYYYMMDD<br>YYYYMMwW<br>(YYYY=año,<br>MM=mes,<br>DD=día,<br>w="w",<br>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. |

| #  | * | 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<br>C: Por comprador<br>V: Por vendedor<br>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<br>F: Fis Analytics<br>M: Coste de préstamo MEFF<br>0: Cero<br>‘’: No aplica | Tipo de referencia financiación en compras.<br>En FLEX sólo se informará uno de los dos lados (compras o ventas), el correspondiente a la contrapartida financiada. |
| 24 |   | BuyReferenceRateMarkup    | float     | -100.0000<br>100.0000  | Markup sobre tipo de referencia en compras<br>En porcentaje con signo y 4 decimales   |
| 25 |   | SellReferenceRate         | String(1) | S: €STR<br>F: Fis Analytics<br>M: Coste de préstamo MEFF<br>0: Cero<br>‘’: No aplica | Tipo de referencia financiación en ventas<br>En FLEX sólo se informará uno de los dos lados (compras o ventas), el correspondiente a la contrapartida financiada.   |
| 26 |   | SellReferenceRateMarkup   | float     | -100.0000<br>100.0000  | Markup sobre tipo de referencia en ventas<br>En porcentaje con signo y 4 decimales  |
| 27 |   | DividendPercentageApplied | float     | 0.00-100.00  | Porcentaje flujo de liquidación de dividendos<br>En porcentaje sin signo y 2 decimales..  |
| 28 |   | DividendDateOffset        | int       | 0-999  | Diferencial de fecha de pago/ cobro del flujo de dividendo ordinario<br>0 indica fecha exdate<br>999 indica fecha efectiva de pago                                  |
| 29 |   | RetailArrayCode           | String(3) |  | Código de matriz de garantías para el cálculo de minoristas   |
| 30 |   | RetailExpirySpan          | char      | Códigos:A..Z, 0..9   | Tipo de vencimiento usado para el cálculo de garantías para minoristas  |

## 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. |

## 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   |

## 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 |

## 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.<br>Sólo para bonos y obligaciones   |
| 13 |   | CouponNo                | int        | > 0 y <= 12                                       | Número de cupones anuales.<br>Sólo para bonos y obligaciones  |
| 14 |   | Coupon                  | Float      |   | Cupón en porcentaje del nominal.<br>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.<br>Sólo para bonos y obligaciones<br>Base real: Se tiene en cuenta el número de días real entre las fechas de pago de cupón |

## 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.<br>En Energía es la fecha inicial del período de entrega del contrato resultante. |
| 7R |   | ContractFinalDate        | LocalDate  |                 | Fecha final del contrato.<br>En Energía es la fecha final del período de entrega del contrato resultante.     |

## 2.13 Detalle de códigos resultantes para la cascada

| CCONTRELEDET.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.     |

## 2.14 Parametrización para cálculo de comisiones por diferimiento

| CDEFERRALFEEDPAR.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                                       |

## 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

| CONTRSTAT.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.<br>Este campo no está informado para opciones largas.  |
| 10 |   | SettlDelta                 | float      |                 | Delta de liquidación al cierre de la sesión.<br>Este campo no está informado para opciones largas.  |
| 11 |   | PreviousDaySettlPrice      | Price      |                 | Precio de liquidación en la sesión anterior.<br>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.<br>Este campo no está informado para opciones largas.<br>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.<br>Este campo no está informado para opciones largas.<br>Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de liquidación del contrato.       |

| #  | * | CAMPO                  | TIPO  | VALORES VÁLIDOS | DESCRIPCIÓN  |
|----|---|------------------------|-------|-----------------|--|
| 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.<br>Sólo para bonos y obligaciones |
| 18 |   | Yield                  | Price |                 |  |
| 19 |   | ReferencePrice         | Price |                 | Precio Forward para FX.<br>Precio de referencia para los contratos entregables para Gas            |
| 20 |   | PreviousReferencePrice | Price |                 | Precio Forward para FX.<br>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  |

### 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. |

### 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  |

## 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.<br>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<br>"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<br>Antiguo campo ClearingGroup, que se reinterpreta como Cuenta de Garantías.   |

| #  | * | 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 |   | SIBECClient                   | 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<br>N=No<br>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<br>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<br>N:Neto  | Tipo de anotación  |
| 28 |   | TitEICCode                    | String(1)  | S=Si<br>N=No  | Titularidad EICCode  |
| 29 |   | TypeEntity                    | String(1)  | N - No Aplica<br>I - Cliente Institucional<br>M - Cliente minorista<br>B - Proveedor Liquidez | Tipo de Entidad  |

## 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<br>IF: individual Fund<br>DF: Default Fund<br>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<br>S = Sí afectado por Restricciones Regulatorias |
| <b>11</b> |   | <b>MarginCalcType</b>   | <b>String(1)</b> | <b>G: Bruto<br/>N: Neto</b>  | <b>Tipo de cálculo de garantías</b>  |

### 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<br>Y: Ajuste efectivo automático<br>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<br>A - agency<br>N - No Aplica                             | Modelo   |
| 13 |   | IndirectClearing        | String(1)  | S=Si<br>N=No   | Indicador de Clearing Indirecto                                |

#### 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<br>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<br>N=No                                       | Indicador de Clearing Indirecto                                |

## 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 |

## 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   |

## 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 |

## 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.<br>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.<br>Este campo no estará cumplimentado cuando el filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe máximo específico a comprobar |

#### 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            |

#### 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        |

## 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<br>"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<br>"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 Regulator                    |
| 18 |   | MinTheoreticalPriceApplies | String(1) | "N"=No<br>"S"=Si  | Indica si el precio mínimo aplica o no  |
| 19 |   | MinTheoreticalPrice        | Price     |   | Valor mínimo cuando aplique   |

## 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<br>"N"=La distancia entre vencimientos se cuenta en meses |                                 |

### 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<br>"P"=Porcentaje | Tipo de descuento que se aplica      |

## 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<br>"2"=Venta | Indica si el registro contiene precios teóricos para posiciones compradoras o vendedoras  |
|    |   |                           |            |                         | Número de precios teóricos contenidos en el registro. Corresponde al campo NumberOfColumns del fichero CVALARRAYS.  |
| 5N |   | NumberOfTheoreticalPrices | int        |                         | 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)  |

## 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<br>"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<br>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)  |

## 5.6 Deltas (con el criterio de cálculo institucional)

| CDELTA.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<br>"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.<br>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)  |

## 5.7 Deltas (con el criterio de cálculo minorista)

| CDELTA <sub>S</sub> _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<br>"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<br>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)   |

## 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<br>"3"=Actualiza-ción<br>efectivo compras<br>"4"=Actualiza-ción<br>efectivo 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.                          |

## 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  | <input type="checkbox"/> | SessionDate                | LocalDate  |                  | Fecha de la sesión  |
| 2  | <input type="checkbox"/> | ContractGroup              | String(2)  |                  | Código de grupo de contratos  |
| 3  | <input type="checkbox"/> | 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<br>"0"=No | Indica si se trata de un dividendo confirmado o no  |

## 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<br>"P"=Put<br>"?"=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.  |

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

## 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"   |

| #  | * | 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. |

## 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  |

### 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.               |

## 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:<br>"-1" = todos los escenarios<br>"1, 2,...,n" = número de escenarios a utilizar en el cálculos  |
| 4  |   | StressHypoPeriod          | Int       |   | Número de escenarios hipotéticos usados para calcular el Stress Test:<br>"-1" = todos los escenarios<br>"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"   |

## 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 escenario histórico (HIST) o un escenario hipotético (HYPO)     |
| 6 | ↔ | ScenarioID             | String(18) |   | Fecha del escenario para Históricos<br>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 máximo 15 decimales)        | Retorno no escalado  |
| 9 |   | ReturnShiftScalated    | float      | Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (como máximo 15 decimales)        | Retorno escalado   |

## 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 contratos de este subgrupo de contratos. |

## 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  |

## 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<br>"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<br>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<br>- Si es una operación procedente de una orden, es la referencia asignada en la orden<br>- Si es una aplicación, es la referencia asignada por el intermediario<br>- Si es una asignación de diaria o un traspaso contiene la referencia de la operación de procedencia. |
| 13 |   | OpenCloseIndicator | char       | "O"=Abre<br>"C"=Cierra  | Indica si la operación abre o cierra posición abierta   |
| 14 |   | FILLER             |            |                         |   |
| 15 |   | FILLER             |            |                         |   |

| #  | * | 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.<br>En un repo, es la referencia común a las 2 patas del mismo.  |
| 31 |   | OrigTradeReference2     | String(18)     |   | Referencia original secundaria de la operación.<br>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                             |

| #  | * | 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 |                 |   |

## 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<br>"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<br>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<br>- Si es una operación procedente de una orden, es la referencia asignada en la orden<br>- Si es una aplicación, es la referencia asignada por el intermediario<br>- Si es una asignación de diaria o un traspaso contiene la referencia de la operación de procedencia. |
| 13 |   | OpenCloseIndicator | char       | "O"=Abre<br>"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 |   | SettleDate         | 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   |

| #  | * | CAMPO                   | TIPO           | VALORES VÁLIDOS | DESCRIPCIÓN   |
|----|---|-------------------------|----------------|-----------------|---|
|    |   |                         |                |                 | 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.<br>En un repo, es la referencia común a las 2 patas del mismo.  |
| 31 |   | OrigTradeReference2     | String(18)     |                 | Referencia original secundaria de la operación.<br>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   |
| 37 |   | MarketSegmentID         | String(4)      |                 | Segment MIC, para operaciones que procedan de una plataforma de negociación   |
| 38 |   | PremiumMargin           | Amt            |                 |   |

| #  | * | CAMPO | TIPO      | VALORES VÁLIDOS | DESCRIPCIÓN |
|----|---|-------|-----------|-----------------|-------------|
| 39 |   | FTL   | LocalDate |                 |             |

## 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<br>"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   |

| #  | * | 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.<br>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.<br>En un repo, es la referencia común a las 2 patas del mismo.  |
| 21 |   | OrigTradeReference2 | String(18)     |                 | Referencia original secundaria de la operación.<br>En un repo, es la referencia correspondiente a la ida o la vuelta del mismo.                               |
| 22 |   | PremiumMargin       | Amt            |                 |   |
| 39 |   | FTL                 | LocalDate      |                 |   |

## 8.2 Asignaciones y traspasos realizados

| CTRAFTRADES.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<br>"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 |   | SettleDate      | LocalDate  |                         | Fecha de liquidación   |
| 17 |   | GrossTradeAmt   | Amt        |                         | Nominal / Efectivo de la transacción                             |

### 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<br>"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.<br>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 |   | SettleDate         | LocalDate  |   | Fecha de liquidación.<br>Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.<br>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   |

## 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<br>Identificador del operador de Miembro Destino que actuó aceptando o rechazando el Give-Up   |
| 6  |   | GiveInUserID    | String(3)  |   | En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS"<br>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.<br>Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.  |
| 9  |   | Side            | Char       | "1"=Compra<br>"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 |   | SettleDate      | LocalDate  |   | Fecha de liquidación.<br>Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.<br>Este campo está cumplimentado cuando el Give-up ha sido aceptado..                                  |

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

## 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<br>En el caso de Give-Ups aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS"<br>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<br>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.<br>Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.   |
| 11 |   | Side            | char       | "1"=Compra<br>"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.<br>Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.   |

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

## 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  |

## 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  |

### 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.<br>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  |

## 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.<br>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  |

## 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  |

## 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  |

## 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<br>"2"=Incremento de posición | Indica si se realiza una reducción o incremento de posición      |
| 10 |   | AdjustmentTime  | LocalTime  |   | Hora del ajuste de posición                                      |

## 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.<br>Está en blanco si la petición es para todo el volumen existente. |
| 8 |   | ExerciseRequest | char       | "S"=Ejercer<br>"N"=No Ejercer<br>"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  |

## 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<br>"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<br>"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.<br>En entrega de valores de renta fija es el importe efectivo de la entrega = n° contratos * (precio de liquidación en tanto por 1 * nominal de un contrato * factor de conversión + cupón corrido). |
| 15 | ↔ | CapacityInd                   | char       | "P" = Propia<br>"A" = Ajena       | Indicador de capacidad   |
| 16 | ↔ | CounterpartyMemberCapacityInd | char       | "P" = Propia<br>"A" = Ajena       | Indicador de capacidad del Miembro contrapartida   |
| 17 | ↔ | Tradeld                       | 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.  |

### 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<br>Nota: Campo que se eliminará en futuras versiones, equivale al nuevo campo MarginAccount (campo 17)   |
| 5  | ↔ | DeliverableContractCode | String(22) |   | Código de título entregable  |
| 6  | ↔ | ExerciselIndicator      | char       | "A"=Anticipado<br>"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<br>"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.<br>En entrega de valores de renta fija es el importe efectivo de la entrega = n° 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<br>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  |

## 10.4 Operaciones de contado desglosadas por cuenta de posición

| CSPOTTRADESBRKDDT.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  | ↔ | ExerciselIndicator      | char       | "A"=Anticipado<br>"V"=Vencimiento (opciones)<br>"F"=Vencimiento (futuros) | Indica si la entrega proviene de ejercicio anticipado o al vencimiento  |
| 7  |   | Quantity                | Qty        |   | Volumen que se entrega.<br>En valores de renta fija: valor nominal<br>En valores de renta variable: N° acciones   |
| 8  | ↔ | Side                    | char       | "1"=Compra<br>"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.<br><br>En CRCC es el importe efectivo de la entrega = n° 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)<br><br>CRCC: Número de operación de entrega   |
| 15 |   | CapacityInd             | Char       | A: Ajena<br>P: Propia   | Indicador de capacidad de la operación de entrega   |

| #  | * | 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 |   | SIBECient              | 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)  |                 |  |

## 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  |   | MaturityDate            | 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  |
|    |   |                         |            |   | BME CLEARING: Este campo no aplica.  |
| 11 |   | Field1                  | String(20) |   | CRCC:<br>* Si el activo está depositado en DECEVAL: este campo corresponde al Código ISIN ANNA. String(12)<br>* Si el activo está depositado en DCV: este campo corresponde al Código título que identifica al activo en DCV. String(3)                              |
|    |   |                         |            |   | BME CLEARING: Este campo no aplica.  |
| 12 |   | Field2                  | String(20) | 0=DECEVAL<br>1=CLEARSTREAM<br>2=BANK OF NEW YORK<br>3 = DCV | CRCC:<br>* Si el activo está depositado en DECEVAL: este campo corresponde al Código Depósito donde se encuentra el ISIN.String(10)<br>* Si el activo está depositado en DCV: este campo corresponde al Número de emisión que identifica al activo en DCV. String(7) |

| #  | * | CAMPO          | TIPO       | VALORES VÁLIDOS | DESCRIPCIÓN   |
|----|---|----------------|------------|-----------------|---|
| 13 |   | BVContractCode | String(35) |                 | BME CLEARING: Este campo no aplica<br>CRCC: Nemo técnico del título en la BVC |
| 14 |   | CFIcode        | String(6)  |                 | Código CFI  |

## 10.6 Detalle de entrega física de gas

| CPHYSEDELDETS.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<br>"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<br>"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<br>"N"=Notificación<br>"A"=Aceptada                          | Estado de la nominación   |

## 10.7 Nominaciones para entrega física de gas a nivel de EIC

| CPHYSDDEL.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<br>"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<br>"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<br>"N"=Notificación<br>"A"=Aceptada                          | Estado de la nominación                    |

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

| CPHYSDDELFEES.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              |

“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        |

## 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<br>"2"=Venta  | Signo  |
|    |   |                   |           |  | En caso de cargo de comisiones, esta fecha siempre es igual a la fecha de la sesión.   |
| 5  | ↔ | LastDateFeesCalc  | LocalDate |  | En caso de devolución, este campo indica la ultima fecha de sesión en la que se ha realizado 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<br>2=Cap<br>3=Floor<br>4=Por MWh<br>5=Por efectivo<br>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<br>Fecha de la operación previa.   |
| 11 |   | PreviousTradeDate | LocalDate |  | 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  |

| #  | * | 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<br>"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   |
|    |   |                    |            |                        | Importe de la comisión. Puede ser cero.   |
| 22 |   | TotalFee           | Amt        |                        | 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<br>- Si es una operación procedente de una orden, es la referencia asignada en la orden<br>- Si es una aplicación, es la referencia asignada por el intermediario<br>- 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  |

## 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<br>2=Cap<br>3=Floor<br>4=Por MWh<br>5=Por efectivo<br>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   |

### 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<br>2=cap<br>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<br>2=cap<br>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 días de diferimiento en cualquier caso. |

| #  | * | 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 días de diferimiento en cualquier caso. |
| 18 | ↔ | ClearingMember  | String(4) |                 | Miembro Compensador  |

## 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                          |

## 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<br>"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<br>"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.  |

| #  | * | 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. Para los casos en que se necesario desglosar el cálculo de comisión en 2 tramos (finales de mes e inicio) |
| 26 | ↔ | Tranche                 | String(1) | Valores 0/1     | 1 = Tramo único o de fecha sesión a fecha liquidación<br><br>0 = Tramo de inicio de mes en caso de haber desglose                              |

## 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<br>"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          |

## 12.2 Variation Margin

| CVARMARGIN.ch |   |
|---------------|---|
| Grupo         | Resultados a nivel de Cuenta de Posición  |
| Descripción   | <p>Detalle de la liquidación de pérdidas y ganancias:</p> <p>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</p> <p>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.</p> |
| 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<br>"2"=Operación para mark-to-market<br>"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<br>"2"=Venta  | Signo   |
| 9  |   | Quantity               | Qty        |  | Volumen   |
| 10 |   | InitialPrice           | Price      |  | <p>Precio de valoración inicial:</p> <p>Si PositionTradeIndicator = "1", es el precio de cierre de la sesión anterior.</p> <p>Si PositionTradeIndicator = "2" o "4", es el precio de la operación</p> <p>CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad.</p> |
| 11 |   | InitialValue           | Amt        |  | <p>Valoración inicial de la posición / operación referida en el registro.</p> <p>Es el resultado de multiplicar el precio de valoración inicial por el volumen y el multiplicador del contrato.</p> <p>Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas</p>                           |
| 12 |   | SettlePrice            | Price      |  | Precio de valoración final:   |

| #  | * | CAMPO           | TIPO      | VALORES VÁLIDOS                                   | DESCRIPCIÓN   |
|----|---|-----------------|-----------|---|---|
|    |   |                 |           |   | Si la sesión ha finalizado es el precio de liquidación del contrato.<br>Si la sesión no ha finalizado es el precio de la última operación del contrato.<br>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.<br>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.<br>En los contratos de divisa es la divisa cotizada o segunda del par.   |
| 16 |   | InitialDate     | LocalDate |   | Fecha de la valoración inicial.<br>Si PositionTradeIndicator = "1", es la fecha de la última sesión en la que se liquidaron pérdidas y ganancias.<br>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   |

## 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.<br>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<br>"2"=Venta       | Signo  |
| 9  |   | Quantity               | Qty        |                               | Volumen  |
| 10 |   | InitialPrice           | Price      |                               | Precio de valoración inicial: Esto es, precio de la operación<br>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.<br>Es el resultado de multiplicar el precio de valoración inicial por el volumen y el multiplicador del contrato.<br>En operaciones (simples y repos) de deuda se actualiza, además, este valor efectivo según el tipo de interés.<br>Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas |
| 12 |   | SettlePrice            | Price      |                               | Precio de valoración:<br>Si la sesión ha finalizado es el precio de liquidación del contrato.<br>Si la sesión no ha finalizado es el precio de la última operación del contrato.<br>CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad  |

| #  | * | CAMPO             | TIPO      | VALORES VÁLIDOS                                   | DESCRIPCIÓN   |
|----|---|-------------------|-----------|---|---|
| 13 |   | CurrGrossTradeAmt | Amt       |   | Valoración actual de la operación referida en el registro.<br>Es el resultado de multiplicar el precio de valoración actual por el volumen y el multiplicador del contrato.<br>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   |

## 12.4 Valoración para productos sin liquidación diaria de variation margin

| CVALUATIONOTH.ch |  |
|------------------|--|
| Grupo            | Resultados a nivel de Cuenta de Posición   |
| Descripción      | <p>Detalle de la valoración de las operaciones o posiciones para aquellos productos que no tienen liquidación diaria de pérdidas y ganancias.</p> <p>- 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.</p> <p>- 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.</p> <p>Este fichero contiene los mismos campos y en el mismo orden que el fichero CVARMARGIN</p> |
| 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  | ↔ | PositionTradelIndicator | char       | "1"=Posición abierta al inicio de la sesión<br>"2"=Operación del día | Indica si se está valorando la posición abierta al inicio de la sesión o de una operación  |
| 7  | ↔ | TradelID                | int        |  | Si PositionTradelIndicator = 2, es el número de registro de liquidación de la operación  |
| 8  | ↔ | Side                    | char       | "1"=Compra<br>"2"=Venta  | Signo  |
| 9  |   | Quantity                | Qty        |  | Volumen  |
| 10 |   | InitialPrice            | Price      |  | <p>Precio de valoración inicial:</p> <p>Si PositionTradelIndicator = "1", es el precio de cierre de la sesión anterior.</p> <p>Si PositionTradelIndicator = "2", es el precio de la operación</p> <p>CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad</p> |
| 11 |   | InitialValue            | Amt        |  | <p>Valoración inicial de la posición / operación referida en el registro.</p> <p>Es el resultado de multiplicar el precio de valoración inicial por el volumen y el multiplicador del contrato.</p> <p>Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas</p>                      |
| 12 |   | SettlPrice              | Price      |  | Precio de valoración final:  |

| #  | * | CAMPO             | TIPO      | VALORES VÁLIDOS                                   | DESCRIPCIÓN   |
|----|---|-------------------|-----------|---|---|
|    |   |                   |           |   | Si la sesión ha finalizado es el precio de liquidación del contrato.<br>Si la sesión no ha finalizado es el precio de la última operación del contrato.<br>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.<br>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.<br>Si PositionTradeIndicator = 1, es la fecha de la sesión previa.<br>Si PositionTradeIndicator = 2, es la fecha de la sesión.  |

## 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  |

## 12.6 Pagos compensatorios

| CCOMPAYMENT.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<br>"2"=Venta                           | Signo de la operación  |
| 8  |   | Quantity                  | Qty        |   | Volumen de la operación  |
| 9  |   | DividendPercentageApplied | Amt        |   | Porcentaje flujo de liquidación de dividendos.<br>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  |

## 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<br>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   |

| #  | * | CAMPO           | TIPO       | VALORES VÁLIDOS   | DESCRIPCIÓN   |
|----|---|-----------------|------------|---|---|
| 20 |   | Scenariolni     | 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        |   |   |
|    |   |                 |            |   | Este campo junto con el campo ArrayCode determina el criterio utilizado para el cálculo de garantías:   |
| 24 | ↔ | CalculationType | String(1)  | 1: Cálculo Ordinario<br>2: Cálculo con Restricciones Regulatorias | CalculationType = 1 y ArrayCode institucional: Garantías BME CLEARING<br>CalculationType = 2 y ArrayCode institucional: Garantías BME CLEARING excluyendo los contratos xRolling sobre acciones<br>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  |

## 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<br>Cuenta de garantías                              |
| 4  | ↔ | MarginAccount        | String(3)  |   | 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  |

### 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 cuenta de garantías<br>Cuenta de garantías                              |
| 5  | ↔ | MarginAccount       | String(3)  |   | 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   |

## 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<br>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  |

### 13.5 Liquidación de entregas de gas por cuenta de garantías

| CDELIVSETTL.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<br>"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.

## 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.<br>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   |

### 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"<br>"HVAR"<br>"MAX_HVAR_ES"<br>"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 |   | IlliquiditySurcharge | Amt        |   | Incremento del IM debido al ATP (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")                      |
| 16 |   | SolvencyMultiplier   | float      |   | Multiplicador de Solvencia   |



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

| CINIMARGINALCSCENARIO.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"<br>"HVAR"<br>"MAX_HVAR_ES"<br>"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")   |

| #  | * | 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") |

### 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"<br>"HVAR"<br>"MAX_HVAR_ES"<br>"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") |

### 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 YYYYMMDD                                  | 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 |   | IlliquiditySurcharge | Amt        |   | Incremento del IM debido al ATP   |

### 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.                 |

## 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 Contrapartida 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<br>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   |

## 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)<br>Cuenta de colateral |
| 5  | ↔ | CollateralAccount       | String(3)  |  | 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      |  | Coefficiente 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.<br>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   |

| #  | * | 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<br>CRCC:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>• Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12)</li> <li>• Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3)</li> </ul>   |
| 19 |   | Field2            | String(20) |  | BME CLEARING: Reservado para uso futuro<br>CRCC:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>• Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10)</li> <li>• Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7)</li> </ul> |
| 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  |

### 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       | <b>Información del movimiento de efectivo de un Miembro Compensador desglosado por Miembro, Cuenta de Colateral, concepto y grupo de movimiento de efectivo. Incluye conceptos diarios y mensuales.</b> |
| 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.<br>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<br>Concepto de movimiento de efectivo.   |
| 8  | ↔ | ConceptCode             | String(2)  | ver Tabla 4 en documento "Tablas de Codificación" | 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   |

#### 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.<br>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   |

## 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 YYYYMMDD                                  | 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                                     |

## 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 | ↔ | CCPCCode                | 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 |

## 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  | ↔ | CCPCCode                | 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      |  | Coefficiente 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   |

| #  | * | 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.<br>BME CLEARING: Reservado para uso futuro   |
| 24 |   | Field1                  | String(20) |   | CRCC:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>• Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12)</li> <li>• Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3)</li> </ul> BME CLEARING: Reservado para uso futuro |
| 25 |   | Field2                  | String(20) |   | CRCC:<br><ul style="list-style-type: none"> <li>• Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10)</li> <li>• Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7)</li> </ul>                                       |
| 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   |

## 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      |  | Coefficiente 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 |

| #  | * | 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.  |
|    |   |                         |            |   | BME CLEARING: Reservado para uso futuro   |
| 24 |   | Field1                  | String(20) |   | CRCC: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12)</li> <li>• Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3)</li> </ul>   |
|    |   |                         |            |   | BME CLEARING: Reservado para uso futuro   |
| 25 |   | Field2                  | String(20) |   | CRCC: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10)</li> <li>• Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7)</li> </ul> |
| 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  |

## 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 |   | ScenariIni                 | Int       |   | Escenario más desfavorable sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones. |

| #  | * | CAMPO           | TIPO      | VALORES VÁLIDOS   | DESCRIPCIÓN   |
|----|---|-----------------|-----------|---|---|
| 21 |   | NetDeltaIni     | Amt       |   | Delta neta sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones   |
| 22 |   | PremiumMargin   | Amt       |   | Este campo junto con el campo ArrayCode determina el criterio utilizado para el cálculo de garantías:   |
| 23 | ↔ | CalculationType | String(1) | 1: Cálculo Ordinario<br>2: Cálculo con Restricciones Regulatorias | <ul style="list-style-type: none"> <li>CalculationType = 1 y ArrayCode institucional: Garantías BME CLEARING</li> <li>CalculationType = 2 y ArrayCode institucional: Garantías BME CLEARING excluyendo los contratos xRolling sobre acciones</li> <li>CalculationType = 2 y retail ArrayCode: Garantías por posiciones en xRolling sobre acciones bajo restricciones regulatorias.</li> </ul> |
| 24 |   | IMIncreased     | Amt       |   | IM calculado bajo el criterio determinado por CalculationType and Arraycode, incrementado por MarginBufferPercentage  |

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

| CACCOUNTSETTLEDET.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  |

### 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.<br>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   |

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

| CTOTALINITIALMARGINET.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"<br>"MAX_HVAR_ES"<br>"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 |   | IlliquiditySurcharge | Amt        |   | Incremento del IM debido al ATP (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")            |
| 16 |   | SolvencyMultiplier   | float      |   | Multiplicador de Solvencia   |

## 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"<br>"HVAR"<br>"MAX _HVAR_ES"<br>"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")  |
| 15 |   | IlliquiditySurcharge | Amt        |   | Incremento del IM debido al ATP (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2")   |

| #  | * | CAMPO            | TIPO  | VALORES VÁLIDOS | DESCRIPCIÓN  |
|----|---|------------------|-------|-----------------|--|
| 16 |   | RiskFactorBuffer | float |                 | Factor multiplicativo relativo a riesgo soberano (no aplica al método de cálculo "MEFFCOM2") |

## 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"<br>"HVAR"<br>"MAX_HVAR_ES"<br>"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") |

## 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](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   |

| #       | 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.  |

| #      | 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   | RequiredMarginMemberDe tail |   | 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   |

## 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.<br>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)   |
|    |   |                    |            |   | Concepto de movimiento de efectivo.  |
| 6  | ↔ | ConceptCode        | String(2)  | ver Tabla 4 en documento "Tablas de Codificación" | 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.   |

### 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 |   | IlliquiditySurcharge | Amt       |   | Incremento del IM debido al ATP   |

#### 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  |   | WorstHistScenari     | String(8)  | Formato YYYYMMDD                                  | Fecha del peor escenario histórico  |
| 6  |   | WorstHistScenariRisk | Amt        |   | Peor escenario histórico (ST Hist Base)   |
| 7  |   | WorstHypoScenari     | String(18) |   | Nombre del peor escenario hipotético  |
| 8  |   | WorstHypoScenariRisk | 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 |   | IlquiditySurcharge   | 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.               |

## 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.

### 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<br>BME CLEARING: Este campo no aplica. Valor siempre 1.                         |
| 9  | ↔ | Type           | char      | 1= Exento de impuestos<br>2= Sujeto a Impuestos   | 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.   |



Tramontana, 2 bis  
28231 Las Rozas (Madrid)  
[www.bmeclearing.es](http://www.bmeclearing.es)



---

Plaza de la Lealtad,1  
Palacio de la Bolsa  
28014 Madrid  
[www.bolsasymercados.es](http://www.bolsasymercados.es)

