



Especificaciones Técnicas Ficheros
BME CLEARING

Índice

1 DESCRIPCIÓN DEL PRODUCTO	6
1.1 HORARIO DEL SERVICIO	6
1.2 ATENCIÓN AL CLIENTE	6
2 FORMATO Y ENTREGA DE LOS DATOS	7
2.1 FORMATOS DE LOS FICHEROS	7
2.2 FORMATO DE LOS DATOS	7
2.3 CABECERAS DE LOS FICHEROS TXT	8
2.4 ENTREGA DE LOS DATOS	8
2.5 NOMBRE DE LOS FICHEROS	8
3 BME CLEARING SEGMENTOS	13
4 MAESTRO DE VALORES CCP	14
4.1 CCONTRACTS_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRACTS_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRACTS_CD_AAAAMMDD.TXT	15
4.2 CCONTRREL_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRREL_C7_AAAAMMDD.TXT	17
4.3 CHOLIDAYS_C2_AAAAMMDD.TXT / CHOLIDAYS_C7_AAAAMMDD.TXT / CHOLIDAYS_CD_AAAAMMDD.TXT	18
4.4 CENTITIES_C2_AAAAMMDD.TXT / CENTITIES_C7_AAAAMMDD.TXT / CENTITIES_CD_AAAAMMDD.TXT	18
4.5 CTRADE_TYP_C2_AAAAMMDD.TXT / CTRADE_TYP_C7_AAAAMMDD.TXT / CTRADE_TYP_CD_AAAAMMDD.TXT	19
4.6 CCONTRDEL_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRDEL_C7_AAAAMMDD.TXT	19
4.7 CCONTRRELDet_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRRELDet_C7_AAAAMMDD.TXT	20
4.8 CUNDERLYINGS_C2_AAAAMMDD.TXT / CUNDERLYINGS_C2_AAAAMMDD.TXT	21

4.9 MCONTRACTS_C2_AAAAMMDD.TXT / MCONTRACTS_C7_AAAAMMDD.TXT / MCONTRACTS_CD_AAAAMMDD.TXT	22
4.10 CCURRENCY_C2_AAAAMMDD.TXT / CCURRENCY_C7_AAAAMMDD.TXT / CCURRENCY_CD_AAAAMMDD.TXT	24
4.11 CCONTRGRP_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRGRP_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRGRP_CD_AAAAMMDD.TXT	24
4.12 CCONTRTYP_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRTYP_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRTYP_CD_AAAAMMDD.TXT	25
4.13 AVISOS DE AJUSTES, CIRCULARES E INSTRUCCIONES	27
4.14 CDEFERRALFEEDBACK_CD_AAAAMMDD.TXT	27
5 PRECIOS DE LIQUIDACIÓN.....	29
5.1 CCONTRSTAT_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRSTAT_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRSTAT_CD_AAAAMMDD.TXT	29
6 CÁLCULOS DE GARANTÍAS Y RIESGOS.....	32
6.1 CCONTRGRP_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRGRP_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRGRP_CD_AAAAMMDD.TXT	34
6.2 CCONTRTYP_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRTYP_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRTYP_CD_AAAAMMDD.TXT	34
6.3 CVOLATILITYSKEW_C2_AAAAMMDD.TXT / CVOLATILITYSKEW_C7_AAAAMMDD.TXT	36
6.4 CTHEORPRICES_C2_AAAAMMDD.TXT / CTHEORPRICES_C7_AAAAMMDD.TXT	38
6.5 CDELTA_C2_AAAAMMDD.TXT / CDELTA_C7_AAAAMMDD.TXT	39
6.6 CVALARRAYS_C2_AAAAMMDD.TXT / CVALARRAYS_C7_AAAAMMDD.TXT	40
6.7 CINTRASPR_C2_AAAAMMDD.TXT / CINTRASPR_C7_AAAAMMDD.TXT	41
6.8 CINTERSPR_C2_AAAAMMDD.TXT / CINTERSPR_C7_AAAAMMDD.TXT	42
6.9 CDELIVERABLES_C2_AAAAMMDD.TXT / CDELIVERABLES_C7_AAAAMMDD.TXT	43
6.10 AVISOS DE AJUSTES, CIRCULARES E INSTRUCCIONES	44
6.11 CMARGINPARAMETERS_CD_AAAAMMDD.TXT	44
6.12 CLIKUIDITYMARGIN_CD_AAAAMMDD.TXT	45
6.13 CIMFACTORS_CD_AAAAMMDD.TXT	46
6.14 CSTRESSTESTPARAMETERS_cd_AAAAMMDD.TXT	47

6.15	CSCENARIOS_CD_AAAAMMDD.TXT	48
6.16	ROLLINGCALENDAR_CD_AAAAMMDD.TXT	49
6.17	CIMSINGLEPOSITION_CD_AAAAMMDD.TXT	50
7	ANEXOS. TABLAS DE CODIFICACIÓN	51
7.1	ANEXO TABLA 1. DIVISAS	51
7.2	ANEXO TABLA 2. VALORES DE CFICODE	51
7.2.1	Derivados sobre Índices	51
7.2.2	Derivados sobre Acciones	52
7.2.3	Derivados sobre Renta Fija.....	53
7.2.4	Derivados sobre Divisas	54
7.2.5	Derivados sobre Materias Primas.....	54
7.2.1	Derivados sobre Energía	55
7.3	ANEXO TABLA 4. CÓDIGOS DE CONTRAPARTIDA CENTRAL Y GRUPO DE CONTRATOS DE LIQUIDACIÓN Y NEGOCIACIÓN.....	56
7.4	ANEXO TABLA 5. SUBGRUPOS DE CONTRATOS	56
7.4.1	MEFF – Contratos sobre Bono, Índices y Acciones en Grupo de Contratos Financiero.....	56
7.4.2	MEFF - Contratos sobre divisa en Grupo de Contratos Financieros	59
7.4.3	MEFF – Grupo de Contratos de Energía	60
7.5	ANEXO TABLA 21 ACTIVOS SUBYACENTES (GRUPO DE CONTRATOS FINANCIERO).....	61
7.5.1	MEFF – Grupo de Contratos Financieros	61
7.5.2	MEFF – Contratos sobre Divisa.....	64
7.5.3	MEFF – Grupo de Contratos de Energía	65
7.6	ANEXO TABLA 28 FAMILIAS DE PRODUCTOS	65
7.7	ANEXO TABLA TIPOS DE ACTIVO	67

7.8 ANEXO TABLA CODIGOS MIC	68
7.1 ANEXO TABLA 14 TIPOS DE ENTIDADES PARTICIPANTES	68
7.2 ANEXO TABLA 15. CÓDIGOS DEPOSITARIOS CENTRALES DE VALORES.....	69
8 GLOSARIO GENERAL BME CLEARING.....	70

1 Descripción del producto

El producto BME CLEARING contiene información de:

- Todo BME CLEARING códigos 7000
- MAESTRO VALORES CCP códigos 7100
- PRECIOS DIARIOS DE LIQUIDACION códigos 7200
- CALCULOS DE RIESGOS Y GARANTÍAS códigos 7300

1.1 HORARIO DEL SERVICIO

Los ficheros estarán disponibles de forma habitual a partir de las 22:00 CET todos los días hábiles del calendario Bursátil oficial.

1.2 ATENCIÓN AL CLIENTE

DIRECCIÓN	EMAIL	TELEFONO
Palacio de la Bolsa Plaza de la Lealtad 1 28014 - Madrid	marketdata@grupobme.es	+ 34 91 709 58 10

Los usuarios tienen a su disposición un servicio de soporte de 09:00 a 18:30 CET de lunes a viernes. BME Market Data mantendrá periódicamente informado al Cliente sobre cualquier modificación en los ficheros, así como cualquier mejora técnica que se produjera.

2 Formato y entrega de los datos

2.1 FORMATOS DE LOS FICHEROS

BME MARKET DATA proporciona la información en ficheros con formato TXT. Todos los campos están separados por el carácter punto y coma (“;”). Todos los registros de cada uno de los ficheros están delimitados por los caracteres CR, LF.

2.2 FORMATO DE LOS DATOS

Formato de 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 – Códigos de divisa” en Anexo.
- ❑ **LocalDate:** Fecha local en formato AAAAMMDD. Valores válidos: AAAA = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31.
- ❑ **LocalTime:** Hora local de generación del fichero en formato HH:MM:SS. Valores válidos: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59

2.3 CABECERAS DE LOS FICHEROS TXT

No tienen Cabeceras los ficheros

2.4 ENTREGA DE LOS DATOS

La información es accesible vía Internet mediante el protocolo sftp (secure ssh file transfer protocol).

2.5 NOMBRE DE LOS FICHEROS

Nombre de los ficheros por producto y tipo:

PRODUCTO	CODIGO	FICHERO	DESCRIPCION
MAESTRO VALORES CCP	7100, 7110	CCONTRACTS_C2_AAAAMMDD.TXT	
	7100, 7120	CCONTRACTS_C7_AAAAMMDD.TXT	Contiene información de los Contratos. Datos Generales. Información general de los contratos disponibles en la sesión.
	7100, 7120	CCONTRACTS_CD_AAAAMMDD.TXT	
	7100, 7110	CCONTRREL_C2_AAAAMMDD.TXT	

7100, 7120	CCONTRREL_C7_AAAAMMDD.TXT	Relación entre el contrato original y los contratos resultantes de ajustes. Datos Generales. Relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor
7100, 7110	CENTITIES_C2_AAAAMMDD.txt	Ficheros con Información pública de las entidades que intervienen en el grupo de contratos.
7100, 7120	CENTITIES_C7_AAAAMMDD.txt	
7100, 7110	CHOLIDAYS_C2_AAAAMMDD.txt	Ficheros con calendario de festivos de liquidación.
7100, 7120	CHOLIDAYS_C7_AAAAMMDD.txt	
7100, 7120	CHOLIDAYS_CD_AAAAMMDD.TXT	
7100, 7110	CTRADEYP_C2_AAAAMMDD.txt	Ficheros con información sobre los tipos de operación tratados en el grupo de contratos
7100, 7120	CTRADEYP_C7_AAAAMMDD.txt	
7100, 7120	CTRADEYP_CD_AAAAMMDD.txt	
7100, 7110	CCONTRDEL_C2_AAAAMMDD.txt	Ficheros con información de los contratos dados de Baja
7100, 7120	CCONTRDEL_C7_AAAAMMDD.txt	
7100, 7110	CCONTRREDET_C2_AAAAMMDD.TXT	Detalle de la relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de que en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Para Energía informa de las relaciones resultantes al realizar la cascada real.
7100, 7120	CCONTRREDET_C7_AAAAMMDD.TXT	
7100, 7110	CUNDERLYINGS_C2_AAAAMMDD.TXT	Contiene información de los activos subyacentes
7100, 7120	CUNDERLYINGS_C7_AAAAMMDD.TXT	
7100, 7110	MCONTRACTS_C2_AAAAMMDD.txt	Información general de los contratos disponibles en la sesión D+1
7100, 7120	MCONTRACTS_C7_AAAAMMDD.txt	
7100, 7120	MCONTRACTS_CD_AAAAMMDD.txt	
7100, 7110	CCURRENCY_C2_AAAAMMDD.txt	Divisas utilizadas en la cámara, tipos de cambio a la divisa de liquidación

	7100, 7120	CCURRENCY_C7_AAAAMMDD.txt	
	7100, 7120	CCURRENCY_CD_AAAAMMDD.txt	
	7100, 7110	CCONTRGRP_C2_AAAAMMDD.TXT	
	7100, 7120	CCONTRGRP_C7_AAAAMMDD.TXT	Contiene información de los Subgrupos de Contratos.
	7100, 7120	CCONTRGRP_CD_AAAAMMDD.TXT	
	7100, 7110	CCONTRTYP_C2_AAAAMMDD.TXT	
	7100, 7120	CCONTRTYP_C7_AAAAMMDD.TXT	Contiene información de los Tipos de Contrato.
	7100, 7120	CCONTRTYP_CD_AAAAMMDD.TXT	
	7100, 7120	CDEFERRALFEEPAR_CD_AAAAMMDD.TXT	Datos Generales. Parámetros para el cálculo de la comisión por diferimiento
PRECIOS DIARIOS DE LIQUIDACIÓN	7200, 7210	CCONTRSTAT_C2_AAAAMMDD.TXT	
	7200, 7220	CCONTRSTAT_C7_AAAAMMDD.TXT	Precios de cierre. Datos diarios de los contratos del grupo de contratos, precios, volatilidades.
	7200, 7220	CCONTRSTAT_CD_AAAAMMDD.TXT	
CÁLCULOS DE GARANTÍAS Y RIESGOS	7300, 7310	CCONTRGRP_C2_AAAAMMDD.TXT	
	7300, 7320	CCONTRGRP_C7_AAAAMMDD.TXT	Contiene información de los Subgrupos de Contratos.
	7300, 7310	CCONTRTYP_C2_AAAAMMDD.TXT	
	7300, 7320	CCONTRTYP_C7_AAAAMMDD.TXT	Contiene información de los Tipos de Contrato.
	7300, 7310	CVOLATILITYSKEW_C2_AAAAMMDD.TXT	
	7300, 7320	CVOLATILITYSKEW_C7_AAAAMMDD.TXT	Curva de volatilidades utilizada en el cálculo de precios teóricos.
	7300, 7310	CTHEORPRICES_C2_AAAAMMDD.TXT	
	7300, 7320	CTHEORPRICES_C7_AAAAMMDD.TXT	Precios teóricos de los contratos utilizados para el cálculo de garantías.

7300, 7310	CDELTA_C2_AAAAMMDD.TXT	Deltas de los contratos utilizadas para el cálculo de garantías.
7300, 7320	CDELTA_C7_AAAAMMDD.TXT	
7300, 7310	CVALARRAYS_C2_AAAAMMDD.TXT	Parámetros de cada una de las matrices de cálculo de garantía.
7300, 7320	CVALARRAYS_C7_AAAAMMDD.TXT	
7300, 7310	CINTRASPR_C2_AAAAMMDD.TXT	Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con el mismo código de matriz.
7300, 7320	CINTRASPR_C7_AAAAMMDD.TXT	
7300, 7310	CINTERSPR_C2_AAAAMMDD.TXT	Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con diferente código de matriz.
7300, 7320	CINTERSPR_C7_AAAAMMDD.TXT	
7300, 7310	CDELIVERABLES_C2_AAAAMMDD.TXT	Información de los posibles títulos entregables asociados a un contrato de derivados.
7300, 7320	CDELIVERABLES_C7_AAAAMMDD.TXT	
7300, 7320	CMARGINPARAMETERS_CD_AAAAMMDD.TXT	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Información de la parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición (modelo de escenarios).
7300, 7320	CLIQUIDITYMARGIN_CD_AAAAMMDD.TXT	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. 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)
7300, 7320	CIMFACTORS_CD_AAAAMMDD.TXT	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Información para cada par de divisas del factor de riesgo soberano y decay factor que aplica (modelo de escenarios)
7300, 7320	CSTRESSTESTPARAMETERS_CD_AAAAMMDD.TXT	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Información de la parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición (modelo de escenarios).
7300, 7320	CSCENARIOS_CD_AAAAMMDD.TXT	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. 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).
7300, 7320	ROLLINGCALENDAR_CD_AAAAMMDD.TXT	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Calendario, a nivel de subyacente, de las sesiones en las que no se deberá generar el ajuste técnico para la posición abierta

7300, 7320

CIMSINGLEPOSITION_CD_AAAAMMDD.TXT

Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Importe de garantías requeridas por una posición de un 1 contrato.

El producto completo BME CLEARING es el 7000.

3 BME Clearing Segmentos

Los productos BME CLEARING incluyen en la actualidad información de los siguientes segmentos:

- C2 BME Clearing Derivados Financieros
- C7 BME Clearing Power
- CD BME Clearing CAMARA MEFF FX
- CN BME Clearing CAMARA MEFF FX

4 Maestro de Valores CCP

Incluye información de asociada a:

- BME CLEARING DERIVADOS FINANCIEROS C2
- BME CLEARING POWER C7
- BME Clearing CAMARA MEFF FX CD
- BME Clearing CAMARA MEFF FX CN

Los ficheros son los siguientes:

FICHERO	DERIVADOS FINANCIEROS	POWER	FOREX	DESCRIPCION
CCONTRACTS_C2_AAAAMMDD.TXT CCONTRACTS_C7_AAAAMMDD.TXT CCONTRACTS_CD_AAAAMMDD.TXT	X	X	X	Contiene información de los Contratos.
CCONTRREL_C2_AAAAMMDD.TXT CCONTRREL_C7_AAAAMMDD.TXT	X	X	X	Relación entre el contrato original y los contraltos resultantes de ajustes.
CCONTRDEL_C2_AAAAMMDD.txt CCONTRDEL_C7_AAAAMMDD.txt	X	X	X	Ficheros con información de los contratos dados de Baja
CCONTRREDET_C2_AAAAMMDD.TXT CCONTRREDET_C7_AAAAMMDD.TXT	X	X	X	Detalle de la relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de que en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Para Energía informa de las relaciones resultantes al realizar la cascada real.
CUNDERLYINGS_C2_AAAAMMDD.TXT CUNDERLYINGS_C2_AAAAMMDD.TXT	X	X		Contiene información de los activos subyacentes
CCURRENCY_C2_AAAAMMDD.txt CCURRENCY_C7_AAAAMMDD.txt CCURRENCY_CD_AAAAMMDD.txt	X	X	X	Divisas utilizadas en la cámara, tipos de cambio a la divisa de liquidación

CENTITIES_C2_AAAAMMDD.txt CENTITIES_C7_AAAAMMDD.txt CENTITIES_CD_AAAAMMDD.TXT	X	X	X	Ficheros con Información pública de las entidades que intervienen en el grupo de contratos.
CHOLIDAYS_C2_AAAAMMDD.txt CHOLIDAYS_C7_AAAAMMDD.txt CHOLIDAYS_CD_AAAAMMDD.txt	X	X	X	Ficheros con calendario de festivos de liquidación.
CTRADEYTP_C2_AAAAMMDD.txt CTRADEYTP_C7_AAAAMMDD.txt CTRADEYTP_CD_AAAAMMDD.txt	X	X	X	Ficheros con información sobre los tipos de operación tratados en el grupo de contratos
MCONTRACTS_C2_AAAAMMDD.txt MCONTRACTS_C7_AAAAMMDD.txt MCONTRACTS_CD_AAAAMMDD.txt	X	X	X	Información general de los contratos disponibles en la sesión D+1
CCONTRGRP_C2_AAAAMMDD.TXT CCONTRGRP_C7_AAAAMMDD.TXT CCONTRGRP_CD_AAAAMMDD.TXT	X	X	X	Contiene información de los Subgrupos de Contratos.
CCONTRTYP_C2_AAAAMMDD.TXT CCONTRTYP_C7_AAAAMMDD.TXT CCONTRTYP_CD_AAAAMMDD.TXT	X	X	X	Contiene información de los Tipos de Contrato.
CDEFERRALFEEPAR_CD_AAAAMMDD.TXT			X	Datos Generales. Parámetros para el cálculo de la comisión por diferimiento

4.1 CCONTRACTS_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRACTS_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRACTS_CD_AAAAMMDD.TXT

Información general de los contratos disponibles en la sesión.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7, CD	CONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato	

C2, C7, CD	CONTRACTSUBGROUPCODE	String (2)	Subgrupo de contrato	VER ANEXO TABLA 5
C2, C7, CD	CONTRACTTYPECODE	String (4)	Tipo de contrato	
C2, C7, CD	STRIKEPRICE	Price	Precio de ejercicio	
C2, C7, CD	MATURITYDATE	LocalDate	Fecha de vencimiento	AAAAMMDD
C2, C7, CD	TRADINGENDDATE	LocalDate	Fecha de fin de negociación	AAAAMMDD
C2, C7, CD	EXERCISEUNDERLYINGCONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato subyacente a efectos de ejercicio	
C2, C7, CD	MARGINUNDERLYINGCONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato subyacente para el cálculo de garantías	
C2, C7, CD	ARRAYCODE	String (3)	Código de matriz de garantías	
C2, C7, CD	FILLER	String (2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7, CD	FILLER	String (2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7, CD	EXPIRYSPAN	String (1)	Tipo de vencimiento usado para el cálculo de garantías	"S" - tramo 1 "M" - tramo 2 "L" - tramo 3 "X" - tramo 4 "Y" - tramo 5
C2, C7, CD	MATURITYMONTHYEAR	String (8)	Identificador del vencimiento	"AAAAMM" - MENSUALES Y TRIMESTRALES "AAAAMMDD" - NO ESTÁNDAR "AAAAMMwW" - SEMANALES siendo: "AAAA" - AÑO "MM" - MES "DD" - DÍA "w" - w "W" - SEMANA
C2, C7, CD	ISINCODE	String (12)	Código isin del contrato	A efecto informativo ya que puede no venir informado. Los 2 primeros caracteres son el código del país. Los 9 siguientes contienen el código nacional de identificación del valor para cada país. Último carácter es el dígito de control

C2, C7, CD	STARTMATURITYMONTHYEAR	LocalDate	Fecha inicio de entrega para los contratos de energía	AAAAMMDD
C2, C7, CD	ENDMATURITYMONTHYEAR	LocalDate	Fecha fin de entrega para los contratos de energía	AAAAMMDD
C2, C7, CD	VersionNumber	Integer	Versión del contrato (0 si no ha sufrido ajustes)	
C2, C7, CD	ForwardMaturityDate	LocalDate	Para los contratos con diferimiento, es la fecha teórica de vencimiento del forward. En general, D+3.	AAAAMMDD
C2, C7, CD	SpotMaturityDate	LocalDate	Para los contratos con diferimiento, es la fecha teórica de vencimiento del spot. En general, D+2.	AAAAMMDD

4.2 CCONTRREL_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRREL_C7_AAAAMMDD.TXT

Códigos resultantes para cascada teórica. Relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de que en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Estos ficheros no se suministran todos los días.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7	CONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato original	
C2, C7	NUMBEROFRELATEDCONTRACTS	Price	Número de relaciones que se definen a continuación	MÁXIMO 31
C2, C7	RELATEDCONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato resultante	
C2, C7	CONTRACTINITIALDATE	LocalDate	Fecha inicial del contrato	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTFINALDATE	LocalDate	Fecha final del contrato	AAAAMMDD

4.3 CHOLIDAYS_C2_AAAAMMDD.TXT / CHOLIDAYS_C7_AAAAMMDD.TXT / CHOLIDAYS_CD_AAAAMMDD.TXT

Información genérica del Entorno de Liquidación.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7, CD	HOLIDAYDATE	LocalDate	FECHA DEL FESTIVO	
C2, C7, CD	REGISTRATIONOPEN	Char	Abierto a Registro	S/N

4.4 CENTITIES_C2_AAAAMMDD.TXT / CENTITIES_C7_AAAAMMDD.TXT / CENTITIES_CD_AAAAMMDD.TXT

Información pública de las entidades que intervienen en el grupo de contratos

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7, CD	ENTITYCODE	String (4)	Código de la Entidad Participante en el grupo de contratos.	
C2, C7, CD	ENTITYTYPE	Char	Tipo de la Entidad Participante.	VER ANEXO TABLA 14 TIPOS DE ENTIDADES PARTICIPANTES
C2, C7, CD	ENTITYDESCRIPTION	String (75)	Nombre de la Entidad Participante.	
C2, C7, CD	ENTITYECBCODE	String (6)	Código de la Entidad Participante en el Banco Central Europeo.	

C2, C7, CD	LEI	String (20)	LEI de la entidad.
-------------------	-----	-------------	--------------------

4.5 CTRADE_TYP_C2_AAAAMMDD.TXT / CTRADE_TYP_C7_AAAAMMDD.TXT / CTRADE_TYP_CD_AAAAMMDD.TXT

Información sobre los tipos de operación tratados en el grupo de contratos:

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7, CD	TRADETYPE	Char	Tipo de Operación	VER ANEXO TABLA 19
C2, C7, CD	TRADETYPEDESCRIPTION	String (20)	Descripción del tipo de Operación	

4.6 CCONTRDEL_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRDEL_C7_AAAAMMDD.TXT

Información de contratos dados de baja. Estos ficheros no se suministran todos los días.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7	CONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato original	
C2, C7	ISINCode	String (12)	Código ISIN del contrato a efectos informativos. Puede no estar presente.	

4.7 CCONTRELDCT_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRELDCT_C7_AAAAMMDD.TXT

Detalle de la relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de que en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Para Energía informa de las relaciones resultantes al realizar la cascada real. Estos ficheros no se suministran todos los días.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7	CONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato original	
C2, C7	MATURITYDATE	LocalDate	Fecha de vencimiento	AAAAMMDD
C2, C7	CASCADEDATE	LocalDate	Fecha de cascada real	AAAAMMDD
C2, C7	NOMINAL	Amt	Nominal del contrato	
C2, C7	UNITOFMEASURE	Char(20)	Unidad de medida del multiplicador	
C2, C7	CONTRACTINITIALDATE	LocalDate	Fecha inicial del contrato. En Energía es la fecha inicial del período de entrega del contrato inicial.	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTFINALDATE	LocalDate	Fecha final del contrato. En Energía es la fecha final del período de entrega del contrato inicial	AAAAMMDD
C2, C7	NUMBEROFRELATEDCONTRACTS	Int	Número de relaciones que se definen a continuación	MÁXIMO 31
C2, C7	RELATEDCONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato resultante	
C2, C7	RELATEDMATURITYDATE	LocalDate	Fecha de vencimiento	AAAAMMDD
C2, C7	RELATEDNOMINAL	Amt	Nominal del contrato	

C2, C7	RELATEDCONTRACTINITIALDATE	LocalDate	Fecha inicial del contrato. En Energía es la fecha inicial del período de entrega del contrato resultante.	AAAAMMDD
C2, C7	RELATEDCONTRACTFINALDATE	LocalDate	Fecha final del contrato. En Energía es la fecha final del período de entrega del contrato resultante.	AAAAMMDD

4.8 CUNDERLYINGS_C2_AAAAMMDD.TXT / CUNDERLYINGS_C2_AAAAMMDD.TXT

Contiene información de los activos subyacentes asociados a los contratos de derivados:

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7	CONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato original	
C2, C7	UnderlyingISINCode	String(12)	Código ISIN del activo subyacente	
C2, C7	UnderlyingDescription	String(20)	Descripción del activo subyacente	
C2, C7	UnderlyingContractGroup	String(2)	Código de grupo de contratos en que está listado el activo subyacente	
C2, C7	CFICode	String(6)	Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962.	
C2, C7	AssetType	String(3)	Tipo de activo	VER ANEXO TABLA 2
C2, C7	Currency	Currency	Divisa del activo	VER ANEXO TABLA 1
C2, C7	ExpiryDate	LocalDate	Fecha de vencimiento del activo	AAAAMMDD
C2, C7	LastAuctionDate	LocalDate	Fecha de última subasta del activo	AAAAMMDD

C2, C7	StartCouponDate	LocalDate	Fecha en la que el activo empieza a devengar cupón. Sólo para bonos y obligaciones	AAAAMMDD
C2, C7	CouponNo	int	Número de cupones anuales. Sólo para bonos y obligaciones	> 0 y <= 12
C2, C7	Coupon	Float	Cupón en porcentaje del nominal. Sólo para bonos y obligaciones	
C2, C7	CalcMethod	Char	Método de cálculo del cupón corrido, dependiendo de la forma de estimar el número de días entre las fechas de pago de cupón entre las que está comprendida la fecha de cálculo. Sólo para bonos y obligaciones. Base real: Se tiene en cuenta el número de días real entre las fechas de pago de cupón	1 = Base real

4.9 [MCONTRACTS_C2_AAAAMMDD.TXT](#) / [MCONTRACTS_C7_AAAAMMDD.TXT](#) / [MCONTRACTS_CD_AAAAMMDD.TXT](#)

Información general de los contratos disponibles en la sesión D+1, contiene los contratos disponibles en la sesión D+1.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	X(8)	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	X(2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7, CD	CONTRACTCODE	X(22)	Código de contrato	
C2, C7, CD	CONTRACTSUBGROUPCODE	X(2)	Subgrupo de contrato	Descripción incluida en el fichero CCONTRGRP Tabla 20
C2, C7, CD	CONTRACTTYPECODE	X(4)	Tipo de contrato	Descripción incluida en el fichero CCONTRTYP
C2, C7, CD	STRIKEPRICE	9(5)V9(4)	Precio de ejercicio	

C2, C7, CD	MATURITYDATE	X(8)	Fecha de vencimiento	AAAAMMDD
C2, C7, CD	TRADINGSTARTDATE	X(8)	Fecha de inicio de negociación	AAAAMMDD
C2, C7, CD	TRADINGENDDATE	X(8)	Fecha de fin de negociación	AAAAMMDD
C2, C7, CD	TSBUYINGCONTRACTCODE	X(22)	Código del contrato comprador time spread (para la orden de compra)	
C2, C7, CD	TSELLINGCONTRACTCODE	X(22)	Código del contrato vendedor time spread (para la orden de venta)	
C2, C7, CD	TSZERBASE	9(5)V9(4)	Base cero para cotización de time spread	
C2, C7, CD	MATURITYMONTHYEAR	X(8)	Identificador del vencimiento.	"AAAAMM" - MENSUALES Y TRIMESTRALES "AAAAMMDD" - NO ESTÁNDAR "AAAAMMwW" - SEMANALES siendo: "AAAA" - AÑO "MM" - MES "DD" - DÍA "w" - w "W" - SEMANA
C2, C7, CD	ISINCODE	X(12)	Código isin del contrato.	A efecto informativo ya que puede no venir informado. Los 2 primeros caracteres son el código del país. Los 9 siguientes contienen el código nacional de identificación del valor para cada país. Ultimo carácter es el dígito de control
C2, C7, CD	StartMaturityMonthYear	X(8)	Fecha de inicio de entrega (contratos de energía)	AAAAMMDD
C2, C7, CD	EndMaturityMonthYear	X(8)	Fecha de fin de entrega (contratos de energía)	AAAAMMDD
C2, C7, CD	AssetClass	X(4)	Tipos de Activos	COMM: commodities CRDT: Credit CURR: currency EQUI: equities INTR: Interest rate EMAL: Emission allowances
C2, C7, CD	Baseproduct	X(4)	Ver Reglamento Delegado UE 2017/585	Sólo para AssetClass=COMM
C2, C7, CD	SubProduct	X(4)	Ver Reglamento Delegado UE 2017/585	

C2, C7, CD	FurtherSubproduct	X(4)	Ver Reglamento Delegado UE 2017/585
C2, C7, CD	SSTI_Pre	AMT	Límite SSTI-pre (Size Specific to Instrument)
C2, C7, CD	LIS_Pre	AMT	LIS-pre (Large in Scale) Limit
C2, C7, CD	SSTI_Post	AMT	Límite SSTI-post (Size Specific to Instrument)
C2, C7, CD	LIS_Post	AMT	LIS-post (Large in Scale) Limit
C2, C7, CD	VersionNumber	X(N)	Versión del contrato (0 si no ha sufrido ajustes)

4.10 CCURRENCY_C2_AAAAMMDD.TXT / CCURRENCY_C7_AAAAMMDD.TXT / CCURRENCY_CD_AAAAMMDD.TXT

Divisas utilizadas en la cámara, tipos de cambio a la divisa de liquidación.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7, CD	Currency	String (3)	Código de divisa. En los contratos de divisa es la divisa cotizada o segunda del par.	Código ISO divisa.
C2, C7, CD	SettlCurrency	String (3)	Código de divisa. Divisa en la que se liquidan los cálculos	Código ISO divisa.
C2, C7, CD	ConversionRate	Price	Tipo de cambio de conversión a la divisa de liquidación.	

4.11 CCONTRGRP_C2_AAAAMMDD.TXT/ CCONTRGRP_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRGRP_CD_AAAAMMDD.TXT

Subgrupos de contratos, datos de liquidación.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de session	AAAAMMDD
C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7, CD	CONTRACTSUBGROUPCODE	String (2)	Código de contrato	VER ANEXO TABLA 5
C2, C7, CD	CONTRACTSUBGROUPDESCRIPTION	String (20)	Descripción del subgrupo de contratos	
C2, C7, CD	CONTRACTSUBGROUPUNDERLYING	String (22)	Código de contrato de contado del subgrupo	

4.12 CCONTRTYP_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRTYP_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRTYP_CD_AAAAMMDD.TXT

Tipos de contratos, datos de liquidación.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7, CD	CONTRACTSUBGROUPCODE	String (2)	Código de contrato	VER ANEXO TABLA 5
C2, C7, CD	CONTRACTTYPECODE	String (4)	Tipo de contrato	
C2, C7, CD	CONTRACTTYPEDESCRIPTION	String (20)	Descripción del tipo de contrato	
C2, C7, CD	PRICEMULTIPLIER	Price	Multiplicador que debe aplicarse al precio del contrato	
C2, C7, CD	NOMINAL	Price	Nominal de los contratos de este tipo	
C2, C7, CD	CURRENCY	String (3)	Divisa en la que se expresa el precio de los contratos de este tipo	VER ANEXO TABLA 1
C2, C7, CD	CALCMETHOD	String (1)	Método de cálculo de precios para los contratos de este tipo	"1" - Black-76 "2" - Binominal

C2, C7, CD	FILLER	String (6)	Filler	
C2, C7, CD	CONTRACTFAMILY	String (5)	Familia del contrato	VER ANEXO TABLA 28
C2, C7, CD	ALL	String (12)	Identificador completo	CFICODE + “ ” + SUBYACENTE (TABLA 21)
C2, C7, CD	PRICETYPE	String (1)	Tipo de precio	1 - Precio 2 - Rentabilidad
C2, C7, CD	SECURITYTYPE	String (1)	Tipo de producto	
C2, C7, CD	FLEXIBLEINDICATOR	String (1)	Indica si es estándar o no	“Y” - No standard “N” - Standard
C2, C7, CD	EXERCISESTYLE	String (1)	Tipo de ejercicio	“A” - Americano “E” - Europeo
C2, C7, CD	SETTMETHOD	String (1)	Método de liquidación	“P” - física “C” - cash
C2, C7, CD	PUTORCALL	String (1)	Tipo de opción	“P” - Put “C” - Call
C2, C7, CD	PERIODICITY	String (1)	Periodicidad	“Y” - Anual “S” - Semestral “Q” - Trimestral “M” - Mensual “m” - Balance del mes “K” - Semanal (L-D) “k” - Balance de la semana “B” - Semanal (L-V) “E” - Semanal (S-D) “D” - Diario
C2, C7, CD	ADJUSTMENTSRULE	String (1)	Tipo de ajuste	“E” - Sólo extraordinarios “T” - Todos
C2, C7, CD	CFICODE	String (6)	CFICode oficial EMIR Reporting	ver Anexo tabla 2 CFI CODE
C2, C7, CD	UnitOfMeasure	X(20)	Unidad de medida del multiplicado	
C2, C7, CD	BaseCurrency	X(3)	Divisa en la que se expresa el nominal de los contratos de este tipo	Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación”

C2, C7, CD	SettleCurrency	X(3)	ivisa a la que se convertirán las liquidaciones de estos contratos	Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"
-------------------	----------------	------	--	---

4.13 AVISOS DE AJUSTES, CIRCULARES E INSTRUCCIONES

Periódicamente se producen hechos corporativos como ampliaciones de capital o splits / contrasplits en los subyacentes de los productos derivados, esto se traduce en ajustes en los contratos de futuro y opciones que se comunicarán en un pdf que se envía vía email en el momento de su comunicación por parte del mercado.

Se enviarán por email todas las circulares e instrucciones que publique BME CLEARING.

4.14 CDEFERRALFEEDPAR_CD_AAAAMMDD.TXT

Datos Generales. Parámetros para el cálculo de la comisión por diferimiento

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
CD	ContractCode	String(22)	Código de contrato	
CD	FloorMarkUp	Amt	Mark-up floor	
CD	CapMarkUp	Amt	Mark-up cap	
CD	NumberOfTranches	int	Número de tramos que se definen a continuación. Máximo 15	<=15
CD	TrancheThreshold	float	Umbral del tramo	
CD	BuyMarkUp	float	Mark-up compra tramo	

CD

SellMarkUp

float

Mark-up venta tramo

5 Precios de Liquidación

Incluye información de Aplicable a:

- BME CLEARING DERIVADOS FINANCIEROS C2
- BME CLEARING POWER C7
- BME CLEARING DERIVADOS FINANCIEROS FX CD, CN

Los ficheros son los siguientes:

FICHERO	DERIVADOS FINANCIEROS	FOREX	POWER	DESCRIPCION
CCONTRSTAT_C2_AAAAMMDD.TXT CCONTRSTAT_C7_AAAAMMDD.TXT CCONTRSTAT_CD_AAAAMMDD.TXT	X	X	X	Precios de cierre de opciones y futuros.

5.1 CCONTRSTAT_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRSTAT_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRSTAT_CD_AAAAMMDD.TXT

Ficheros de cierre de opciones y futuros incluidos en los segmentos renta variable, renta fija y derivados de la energía:

- CCONTRSTAT_C2_AAAAMMDD.TXT Precios de cierre de derivados financieros.
- CCONTRSTAT_C7_AAAAMMDD.TXT Precios de cierre de Derivados Energía.
- CCONTRSTAT_CD_AAAAMMDD.TXT Precios de cierre de derivados financieros FX

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD

C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	Ver Anexo tabla 4
C2, C7, CD	CONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato	
C2, C7, CD	HIGHPRICE	Price	Precio alto de la sesión	
C2, C7, CD	LOWPRICE	Price	Precio bajo de la sesión	
C2, C7, CD	FIRSTPRICE	Price	Primer precio de la sesión	
C2, C7, CD	LASTPRICE	Price	Último precio de la sesión	
C2, C7, CD	SETTLPRICE	Price	Precio de liquidación en la sesión	
C2, C7, CD	SETTLVOLATILITY	Amt	Volatilidad de liquidación al cierre de la sesión	Este campo no está informado para opciones largas.
C2, C7, CD	SETTLDELTA	Amt	Delta de liquidación al cierre de la sesión	Este campo no está informado para opciones largas.
C2, C7, CD	PREVIOUSDAYSETTLPRICE	Price	Precio de liquidación en la sesión anterior	Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de liquidación del contrato.
C2, C7, CD	PREVIOUSDAYSETTLVOLATILITY	Amt	Volatilidad de liquidación al cierre de la sesión anterior	Este campo no está informado para opciones largas. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de liquidación del contrato.
C2, C7, CD	PREVIOUSDAYSETTLDELTA	Amt	Delta de liquidación al cierre de la sesión anterior	Este campo no está informado para opciones largas. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de liquidación del contrato.
C2, C7, CD	TOTALREGVOLUME	Qty	Volumen total registrado	
C2, C7, CD	NUMBEROFTRADES	Qty	Número de operaciones registrado	
C2, C7, CD	OPENINTEREST	Qty	Posición abierta por titular	
C2, C7, CD	ACCRUEDINTEREST	Price	Cupón corrido incorporado al precio de liquidación de la sesión. Sólo para bonos y obligaciones	
C2, C7, CD	YIELD	Price	Rendimiento	
C2, C7, CD	ForwardPrice	Price	Precio de referencia (forward) para D+1 (solo se informa para contratos de divisa)	

C2, C7, CD

PreviousDayForwardPrice

Price

Precio de referencia (forward) al cierre de la sesión anterior (solo se informa para contratos con diferimiento)

6 Cálculos de Garantías y Riesgos

Incluye información de Aplicable a:

- BME CLEARING DERIVADOS FINANCIEROS C2
- BME CLEARING POWER C7
- BME CLEARING DERIVADOS FINANCIEROS FX CN, CD

Los ficheros son los siguientes:

FICHERO	DERIVADOS FINANCIEROS	POWER	FOREX	DESCRIPCION
CCONTRGRP_C2_AAAAMMDD.TXT CCONTRGRP_C7_AAAAMMDD.TXT CCONTRGRP_CD_AAAAMMDD.TXT	X	X	X	Contiene información de los Subgrupos de Contratos
CCONTRTYP_C2_AAAAMMDD.TXT CCONTRTYP_C7_AAAAMMDD.TXT CCONTRTYP_CD_AAAAMMDD.TXT	X	X	X	Contiene información de los Tipos de Contrato
CVOLATILITYSKEW_C2_AAAAMMDD.TXT CVOLATILITYSKEW_C7_AAAAMMDD.TXT	X			Curva de volatilidades utilizada en el cálculo de precios teóricos
CTHEORPRICES_C2_AAAAMMDD.TXT CTHEORPRICES_C7_AAAAMMDD.TXT	X	X		Precios teóricos de los contratos utilizados para el cálculo de garantías.
CDELTA_C2_AAAAMMDD.TXT CDELTA_C7_AAAAMMDD.TXT	X	X		Deltas de los contratos utilizadas para el cálculo de garantías.
CVALARRAYS_C2_AAAAMMDD.TXT CVALARRAYS_C7_AAAAMMDD.TXT	X	X		Parámetros de cada una de las matrices de cálculo de garantía
CINTRASPR_C2_AAAAMMDD.TXT CINTRASPR_C7_AAAAMMDD.TXT	X	X		Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con el mismo código de matriz.

CINTERSPR_C2_AAAAMMDD.TXT CINTERSPR_C7_AAAAMMDD.TXT	X	X	Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con diferente código de matriz.	
CDELIVERABLES_C2_AAAAMMDD.TXT CDELIVERABLES_C7_AAAAMMDD.TXT	X	X	Información de los posibles títulos entregables asociados a un contrato de derivados.	
CMARGINPARAMETERS_CD_AAAAMMDD.TXT			X	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Información de la parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición (modelo de escenarios).
CLIQUIDITYMARGIN_CD_AAAAMMDD.TXT			X	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. 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)
CIMFACTORS_CD_AAAAMMDD.TXT			X	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Información para cada par de divisas del factor de riesgo soberano y decay factor que aplica (modelo de escenarios)
CSTRESSTESTPARAMETERS_CD_AAAAMMDD.TXT			X	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Información de la parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición (modelo de escenarios).
CSCENARIOS_CD_AAAAMMDD.TXT			X	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. 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).
ROLLINGCALENDAR_CD_AAAAMMDD.TXT			X	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Calendario, a nivel de subyacente, de las sesiones en las que no se deberá generar el ajuste técnico para la posición abierta
CIMSINGLEPOSITION_CD_AAAAMMDD.TXT			X	Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Importe de garantías requeridas por una posición de un 1 contrato.

A continuación se detallarán los contenidos de cada uno de los ficheros.

6.1 CCONTRGRP_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRGRP_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRGRP_CD_AAAAMMDD.TXT

Subgrupos de contratos, datos de liquidación.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de session	AAAAMMDD
C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7, CD	CONTRACTSUBGROUPCODE	String (2)	Código de contrato	VER ANEXO TABLA 5
C2, C7, CD	CONTRACTSUBGROUPDESCRIPTION	String (20)	Descripción del subgrupo de contratos	
C2, C7, CD	CONTRACTSUBGROUPUNDERLYING	String (22)	Código de contrato de contado del subgrupo	

6.2 CCONTRTYP_C2_AAAAMMDD.TXT / CCONTRTYP_C7_AAAAMMDD.TXT / CCONTRTYP_CD_AAAAMMDD.TXT

Tipos de contratos, datos de liquidación.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7, CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7, CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
C2, C7, CD	CONTRACTSUBGROUPCODE	String (2)	Código de contrato	VER ANEXO TABLA 5
C2, C7, CD	CONTRACTTYPECODE	String (4)	Tipo de contrato	
C2, C7, CD	CONTRACTTYPEDESCRIPTION	String (20)	Descripción del tipo de contrato	
C2, C7, CD	PRICEMULTIPLIER	Price	Multiplicador que debe aplicarse al precio del contrato	
C2, C7, CD	NOMINAL	Price	Nominal de los contratos de este tipo	
C2, C7, CD	CURRENCY	String (3)	Divisa en la que se expresa el precio de los contratos de este tipo	VER ANEXO TABLA 1

C2, C7, CD	CALCMETHOD	String (1)	Método de cálculo de precios para los contratos de este tipo	"1" - Black-76 "2" - Binominal
C2, C7, CD	INTERNAL CODE	String (6)	Código Interno	
C2, C7, CD	CONTRACTFAMILY	String (5)	Familia del contrato	VER ANEXO TABLA 28
C2, C7, CD	All	String (12)	Identificador completo	CFICODE + " " + SUBYACENTE (TABLA 21)
C2, C7, CD	PRICETYPE	String (1)	Tipo de precio	1 - Precio 2 - Rentabilidad
C2, C7, CD	SECURITYTYPE	String (1)	Tipo de producto	
C2, C7, CD	FLEXIBLEINDICATOR	String (1)	Indica si es estándar o no	"Y" - No standard "N" - Standard
C2, C7, CD	EXERCISESTYLE	String (1)	Tipo de ejercicio	"A" - Americano "E" - Europeo
C2, C7, CD	SETTMETHOD	String (1)	Método de liquidación	"P" - física "C" - cash
C2, C7, CD	PUTORCALL	String (1)	Tipo de opción	"P" - Put "C" - Call
C2, C7, CD	PERIODICITY	String (1)	Periodicidad	"Y" - Anual "S" - Semestral "Q" - Trimestral "M" - Mensual "m" - Balance del mes "K" - Semanal (L-D) "k" - Balance de la semana "B" - Semanal (L-V) "E" - Semanal (S-D) "D" - Diario
C2, C7, CD	ADJUSTMENTSRULE	String (1)	Tipo de ajuste	"E" - Sólo extraordinarios "T" - Todos
C2, C7, CD	CFICODE	String (6)	CFICode oficial EMIR Reporting	ver Anexo tabla 2 CFI CODE
C2, C7, CD	UnitOfMeasure	X(20)	Unidad de medida del multiplicado	

C2, C7, CD	BaseCurrency	X(3)	Divisa en la que se expresa el nominal de los contratos de este tipo	Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"
C2, C7, CD	SettlCurrency	X(3)	Divisa a la que se convertirán las liquidaciones de estos contratos	Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"

6.3 CVOLATILITYSKEW_C2_AAAAMMDD.TXT / CVOLATILITYSKEW_C7_AAAAMMDD.TXT

Skew de volatilidades. Curva de volatilidades utilizada en el cálculo de precios teóricos.

TIPO ACTIVO	CÓD. DEL CAMPO	LONG.	DESCRIPCION	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	Ver Anexo tabla 3
C2, C7	Underlying	String(22)	Subyacente	
C2, C7	MaturityDate	LocalDate	Fecha de vencimiento	
C2, C7	InstrumentType	char	Indicador que informa si el registro se refiere a las opciones call, opciones put, o ambas	"C" = Call "P" = Put "?" = Todos (Call y Put)
C2, C7	VolatilityATM	float	Volatilidad at the money. En tanto por ciento.	
C2, C7	Divisor	int	Divisor de puntos porcentuales. Indica a que porcentaje se aplica cada incremento de volatilidad .	
C2, C7	MinimumVolatility	float	Volatilidad mínima. En tanto por ciento.	
C2, C7	MaximumVolatility	float	Volatilidad máxima. En tanto por ciento.	
C2, C7	NumberOfRanges	int	Número de rangos que contiene este registro. Seguirán cuatro campos como los que se describen a continuación por cada rango .	< = 8
C2, C7	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.
C2, C7	VariationPoints1	float	Puntos porcentuales de incremento / decremento para precio de ejercicio >= precio del subyacente	
C2, C7	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.
C2, C7	VariationPoints2	float	Puntos porcentuales de incremento / decremento para precio de ejercicio < precio del subyacente	

Actualmente no es posible ampliar el fichero CVOLATILITYSKEW.C2 o hacer un fichero nuevo añadiendo los strikes ITM y OTM pero lo que si puede hacer es que a partir de los datos incluidos en el fichero CVOLATILITYSKEW.C2 (para opciones ATM) se puede calcular la volatilidad para las opciones ITM y OTM del mismo subyacente y vencimiento.

Tiene que aplicar los siguientes conceptos:

- La curva skew es la curva que muestra las variaciones de la volatilidad implícita ante incrementos / decrementos del precio de ejercicio de opciones (siendo ambas del mismo vencimiento y subyacente).
- Para calcular la volatilidad de las opciones ITM y OTM del mismo subyacente y vencimiento a partir de la volatilidad de las opciones ATM tiene que aplicar esta regla:
 - caída del 3% del strike, la volatilidad aumenta un 0.5% y
 - subida del 3% del strike la volatilidad cae un 0.3%.

Ejemplo Numérico, cálculo de la volatilidad implícita para un Strike determinado utilizando la curva de Skew.

Opción 14 Call SAN tercer vencimiento, prima 0.84.

La volatilidad implícita para esta Opción es 21.42%, siendo esta la opción ATM.

El Skew up es 0.50% y el Skew Down es 0.30%

Precio de cierre de SAN: 14.02.

Determinar la volatilidad implícita para el Strike 20 Call SAN tercer vencimiento.

La opción SAN 20 varía en strike un 42.85% respecto a la opción SCH 14.

$(20 - 14)/14 = 42.85\%$ variación Strike respecto al ATM.

Utilizamos el Skew down, es decir restaremos un 0.30% de Volatilidad cada 3% de variación. En el caso que el Strike fuera inferior al ATM, nos moveríamos por el Skew up, es decir aumentaríamos un 0.50% de volatilidad cada 3% de variación.

Si 3% de variación resta 0.30% de volatilidad respecto a la ATM

El 42.85% de variación restará 4.285% de vola respecto a la ATM.

Al ser subida en strike aplicamos el skew down, restamos un 0.30% por cada 3% de variación de strike, en este caso la disminución de la volatilidad sería de 4.285%

Por tanto, la volatilidad de la 20 Call SCH tercer vencimiento será 17.135%. $(21.42\% - 4.285\%)$. Si la volatilidad de la Opción 14 Call SCH es de 21.42%, la volatilidad de la opción 20 Call SCH sería $21.42\% - 4.285\%$ o sea 17.135%.

6.4 CTHEORPRICES_C2_AAAAMMDD.TXT / CTHEORPRICES_C7_AAAAMMDD.TXT

Precios Teóricos. Datos para Cálculo de Garantías. Liquidación. Precios teóricos de los contratos utilizados para el cálculo de garantías.

TIPO ACTIVO	CÓD. DEL CAMPO	LONG.	DESCRIPCION	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	Ver Anexo tabla 3
C2, C7	ContractCode	String (22)	Código de contrato	
C2, C7	Side	Char	Indica si el registro contiene precios teóricos para posiciones compradoras o vendedoras	"1"=Compra "2"=Venta
C2, C7	NumberOfTheoreticalPrices	Int	Número de precios teóricos contenidos en el registro. A continuación se encuentran tantos campos como indique éste	
C2, C7	TheoreticalPrices	Price	Precio teórico	

6.5 CDELTA_C2_AAAAMMDD.TXT / CDELTA_C7_AAAAMMDD.TXT

Deltas. Datos para Cálculo de Garantías. Liquidación. Deltas de los contratos utilizadas para el cálculo de garantías.

TIPO ACTIVO	CÓD. DEL CAMPO	LONG.	DESCRIPCION	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	Ver Anexo tabla 3
C2, C7	CONTRACTCODE	String(22)	Código de contrato	
C2, C7	SIDE	Char	Indica si el registro contiene precios teóricos para posiciones compradoras o vendedoras	"1"=Compra "2"=Venta
C2, C7	NUMBEROFDELTA	Int	Número de deltas contenidas en el registro. A continuación se encuentran tantos campos como indique éste	
C2, C7	DELTA	Price	Delta	

6.6 CVALARRAYS_C2_AAAAMMDD.TXT / CVALARRAYS_C7_AAAAMMDD.TXT

Parámetros de la matriz de garantías. Datos para Cálculo de Garantías. Parámetros de cada una de las matrices de cálculo de garantía.

TIPO ACTIVO	CÓD. DEL CAMPO	LONG.	DESCRIPCION	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	Ver Anexo tabla3
C2, C7	ArrayCode	String(3)	Código de matriz de garantías	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	ExpirySpan	char	Tipo de vencimiento	Códigos: A, B, C, D, E, F, G, H, L, M, S, W, X, Y, Z
C2, C7	NumberOfColumns	int	Número de columnas	<=41
C2, C7	PriceFluctuationType	char	Tipo de fluctuación de precios	"P"=Porcentual "T"=Por precio
C2, C7	PriceIncFluctuation	float	Fluctuación de crecimiento (izquierda)	
C2, C7	PriceDecFluctuation	float	Fluctuación de decrecimiento (derecha)	
C2, C7	VolatilityVariationType	char	Forma de aplicar la variación de la volatilidad	"P"=Porcentual "T"=Aditiva
C2, C7	VolatilityVariation	float	Variación de volatilidad	
C2, C7	ContractSubgroupCode	String(2)	Subgrupo de contrato referencia para compensación entre subyacentes distintos	
C2, C7	ContractTypeCode	String(4)	Tipo de contrato referencia para compensación entre subyacentes distintos	
C2, C7	LargePosThreshold	float	Delta a partir de la cual aplican las garantías para grandes posiciones.	

C2, C7	FILLER	int	Filler (contenido no relevante)
---------------	--------	-----	---------------------------------

6.7 CINTRASPR_C2_AAAAMMDD.TXT / CINTRASPR_C7_AAAAMMDD.TXT

Compensación intra-matriz. Datos para Cálculo de Garantías. Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con el mismo código de matriz.

TIPO ACTIVO	CÓD. DEL CAMPO	LONG.	DESCRIPCION	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	Ver Anexo tabla3
C2, C7	ArrayCode	String(3)	Código de matriz de garantías	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(4)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(4)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	Factor	float	Factor	
C2, C7	MinimumValue	Float	Valor mínimo	
C2, C7	Spread	float	Spread	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	

C2, C7	DayCalc	Char	"S" = La distancia entre vencimientos se cuenta en días "N" = La distancia entre vencimientos se cuenta en meses
---------------	---------	------	---

6.8 CINTERSPR_C2_AAAAMMDD.TXT / CINTERSPR_C7_AAAAMMDD.TXT

Compensación inter-matriz. Datos para Cálculo de Garantías. Tabla de compensaciones a aplicar en el cálculo de garantías para posiciones de signo contrario sobre contratos con diferente código de matriz.

TIPO ACTIVO	CÓD. DEL CAMPO	LONG.	DESCRIPCION	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	FECHA DE SESIÓN	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	CÓDIGO DE GRUPO DE CONTRATOS	Ver Anexo tabla3
C2, C7	OffsetPriority	String(3)	Prioridad	
C2, C7	ArrayCode1	String(3)	Código de matriz 1	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(4)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	GroupOffsetDiscount1	Amt	Descuento en grupo de compensación 1	
C2, C7	OffsetMultiplier1	float	Multiplicador de compensación 1	
C2, C7	ArrayCode2	String(3)	Código de matriz 2	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(4)	Filler (contenido no relevante)	

C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	FILLER	String(2)	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	GroupOffsetDiscount2	Amt	Descuento en grupo de compensación 2	
C2, C7	OffsetMultiplier2	float	Multiplicador de compensación 2	
C2, C7	FILLER	Amt	Filler (contenido no relevante)	
C2, C7	DiscountType	char	Tipo de descuento que se aplica	"D"=Divisa "P"=Porcentaje

6.9 CDELIVERABLES_C2_AAAAMMDD.TXT / CDELIVERABLES_C7_AAAAMMDD.TXT

Información de los posibles títulos entregables asociados a un contrato de derivados.

TIPO ACTIVO	CÓD. DEL CAMPO	LONG.	DESCRIPCION	FORMATO / VALORES POSIBLES
C2, C7	SESSIONDATE	LocalDate	FECHA DE SESIÓN	AAAAMMDD
C2, C7	CONTRACTGROUP	String (2)	CÓDIGO DE GRUPO DE CONTRATOS	Ver Anexo tabla3
C2, C7	CONTRACTCODE	String (22)	Código de contrato de derivados que genera la obligación de entrega.	
C2, C7	CODCSD	Char	Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía.	Ver tabla 15
C2, C7	DERIVERABLECONTRACTCODE	String (22)	Código de título entregable empleado por la cámara.	
C2, C7	DERIVERABLEORDERNO	Int	Número de orden de emisión del entregable.	>0
C2, C7	DERIVERABLEISINCODE	String(12)	Código ISIN del título entregable	
C2, C7	MATURITYDATE	Localdate	Fecha de vencimiento y de entrega	AAAAMMDD
C2, C7	FACTOR	Float	Factor de conversión. Aplica a la entrega de bonos.	

C2, C7	ACCRUEDINTEREST	Amt	Cupón corrido. Aplica a la entrega de bonos.
C2, C7	FIELD1	String(20)	BME CLEARING: Este campo no aplica.
C2, C7	FIELD2	String(20)	BME CLEARING: Este campo no aplica.
C2, C7	BVCONTRACTCODE	String(35)	BME CLEARING: Este campo no aplica.
C2, C7	CFICODE	String(6)	CODIGO CFI

6.10 AVISOS DE AJUSTES, CIRCULARES E INSTRUCCIONES

Periódicamente se producen circulares e instrucciones operativas sobre cálculos relativos a liquidación y garantías. Se enviarán por email todas las circulares e instrucciones que publique BME CLEARING relativo a los mismos.

6.11 CMARGINPARAMETERS_CD_AAAAMMDD.TXT

Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Información de la parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición (modelo de escenarios).

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
CD	MporHouse	Int	Número de días Mpor House	
CD	MporClient	Int	Número de días Mpor Cliente	
CD	HvarCl	float	Nivel de confianza HVAR	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (4 decimales)

CD	EsCI	float	Nivel de confianza ES	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (4 decimales). Debería corresponder a la media de los 18 peores escenarios
CD	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.
CD	NonScaledScenariosNumberFV	Int	Número de escenarios no escalados a realizar full valuation (no aplica a FX RSF)	
CD	ScaledScenariosNumberFV	Int	Número de escenarios escalados a realizar full valuation (no aplica a FX RSF)	
CD	IMbaseBuffer	float	Multiplicador sobre el IM Base	
CD	IMFloorFactor	float	Multiplicador sobre el IM Base para obtener la garantía mínima	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 20% sería 0.20 (4 decimales)
CD	Currency	Currency	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"
CD	DaysSmoothingParam	Int	N (DaySmoothingParam) corresponde al valor a computar en el smoothing parameter definido como $2/(N+1)$.	El valor por defecto es 10.

6.12 CLIQUIDITYMARGIN_CD_AAAAMMDD.TXT

Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. 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)

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4

CD	ContractSubgroupCode	String(2)	Código de subgrupo de contratos	ver Tabla 20 en documento “Tablas de Codificación” o contenido del fichero CCONTRGRP
CD	ContractSubgroupDescription	String(20)	Descripción del subgrupo de contratos	Ver tabla 21 en documento “Tablas de codificación”
CD	QuantityMax	Int	Volumen Maximo en mercado	
CD	NumberOfIntervals	Int	Número de intervalos que se definen a continuación.	Máximo 10.
CD	QuantityInterval	Int	El valor de este campo por QuantityMax marca la frontera con el siguiente tramo de volumen máximo de mercado	(habitualmente 5 intervalos)
CD	Surcharge	float	Sobrecoste por iliquidez expresado en la divisa cotizada	

6.13 CIMFACTORS_CD_AAAAMMDD.TXT

Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Información para cada par de divisas del factor de riesgo soberano y decay factor que aplica (modelo de escenarios)

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
CD	ContractSubgroupCode	String(2)	Código de subgrupo de contratos	ver Tabla 20 en documento “Tablas de Codificación” o contenido del fichero CCONTRGRP
CD	ContractSubgroupDescription	String(20)	Descripción del subgrupo de contratos	Ver tabla 21 en documento “Tablas de codificación”
CD	RiskFactorBuffer	float	Factor multiplicativo que aplica al cálculo de retornos.	

CD	DecayFactorSpot	float	Valor entre 0 y 1 usado en el método EWMA.	Valor entre 0 y 1 usado en el método EWMA.
CD	DecayFactorSwapPoints	float	Valor entre 0 y 1 usado en el método EWMA.	Valor entre 0 y 1 usado en el método EWMA.

6.14 CSTRESSTESTPARAMETERS_CD_AAAAMMDD.TXT

Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Información de la parametrización del modelo de cálculo de garantías por posición (modelo de escenarios).

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
CD	StressHistPeriod	Int	Número de escenarios históricos usados para calcular el Stress Test:	"-1" = todos los escenarios "1, 2,...,n" = número de escenarios a utilizar en el cálculos
CD	StressHypoPeriod	Int	Número de escenarios hipotéticos usados para calcular el Stress Test:	"-1" = todos los escenarios "1, 2,...,n" = número de escenarios a utilizar en el cálculos
CD	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)
CD	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)
CD	StressNumScenariosDDBB	Int	Número de peores escenarios que se grabarán en base de datos como resultado del Stress Test	

CD	StressAvgHist	char	Promediar o no las pérdidas y ganancias generadas por escenarios históricos que correspondan al nivel de confianza establecido. "N"= No, "S"= Sí	N"= No, "S"= Sí
CD	StressAvgHypo	char	Promediar o no las pérdidas y ganancias generadas por escenarios hipotéticos que correspondan al nivel de confianza establecido. "N"= No, "S"= Sí	N"= No, "S"= Sí
CD	Currency	Currency	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Stress Test"	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"

6.15 CSCENARIOS_CD_AAAAMMDD.TXT

Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. 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).

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
CD	ContractSubgroupCode	String(2)	Código de subgrupo de contratos	ver Tabla 20 en documento "Tablas de Codificación" o contenido del fichero CCONTRGRP
CD	ContractTypeCode	String(4)	Tipo de contrato	
CD	ScenarioType	String(4)	Puede ser un escenario histórico (HIST) o un escenario hipotético (HYPO)	
CD	ScenarioID	String(18)	Fecha del escenario para Históricos Nombre del escenario para Hipotéticos	
CD	Currency	Currency	Divisa en la que se expresan los retornos	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"

CD	ReturnShiftNonScalated	float	Retorno no escalado	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (como máximo 15 decimales)
CD	ReturnShiftScalated	float	Retorno escalado	Porcentaje, expresado en tanto por uno: 5% sería 0,05 (como máximo 15 decimales)

6.16 ROLLINGCALENDAR_CD_AAAAMMDD.TXT

Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Calendario, a nivel de subyacente, de las sesiones en las que no se deberá generar el ajuste técnico para la posición abierta

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
CD	ContractSubgroupCode	String(2)	Código de subgrupo de contratos	ver Tabla 20 en documento “Tablas de Codificación” o contenido del fichero CCONTRGRP
CD	ContractSubgroupDescription	String(20)	Descripción del subgrupo de contratos	Ver tabla 21 en documento “Tablas de codificación”
CD	NumberOfHolidays	Int	Número de días festivos que se definen a continuación. Máximo 40	<=40
CD	HolidayDate	LocalDate	Fecha de la sesión en que no se aplica ajuste técnico a los contratos de este subgrupo de contratos.	

6.17 CIMSINGLEPOSITION_CD_AAAAMMDD.TXT

Datos para el cálculo de garantías – modelo de escenarios. Importe de garantías requeridas por una posición de un 1 contrato.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
CD	SESSIONDATE	LocalDate	Fecha de sesión	AAAAMMDD
CD	CONTRACTGROUP	String (2)	Código de grupo de contratos	VER ANEXO TABLA 4
CD	ContractSubgroupCode	String(2)	Código de subgrupo de contratos	ver Tabla 20 en documento “Tablas de Codificación” o contenido del fichero CCONTRGRP
CD	ContractSubgroupDescription	String(20)	Descripción del subgrupo de contratos	Ver tabla 21 en documento “Tablas de codificación”
CD	Currency	Currency	Divisa de los datos de riesgo a continuación o "Divisa Cálculo Garantías"	ver Tabla 1 en documento “Tablas de Codificación”
CD	InitialMarginLongOnecontract	Amt	Initial Margin requerido por una posición de un 1 contrato comprado	
CD	InitialMarginShortOnecontract	Amt	Initial Margin requerido por una posición de un 1 contrato vendido	
CD	ContractTypeCode	String(4)	Tipo de contrato	

7 Anexos. Tablas de Codificación

7.1 ANEXO TABLA 1. DIVISAS

Los códigos de divisa utilizados son los que están definidos en el estándar ISO-4217. Para obtener los valores actuales puede consultarse la siguiente dirección: <http://www.xe.com/iso4217.htm>

Por ejemplo:

CÓDIGO	CONCEPTO
AUD	Dólar australiano
BRL	Real Brasileño
CAD	Dólar canadiense
CHF	Franco suizo
EUR	Euro
GBP	Libra Esterlina
JPY	Yen japonés
MXN	Peso mexicano
NZD	Dólar neozelandés
USD	Dólar estadounidense

7.2 ANEXO TABLA 2. VALORES DE CFICODE

7.2.1 Derivados sobre Índices

DESCRIPCIÓN	CFICODE
Futuro financiero estandarizado sobre índice. Liquidación por diferencias	FFICSX
Futuro financiero no estándar sobre índice. Liquidación por diferencias	FFICNX
Estrategias	KEXXXX
Time-spread de futuros sobre índices. Liquidación por diferencias	KEXXXX
Opción call europea estandarizada sobre índice. Liquidación por diferencias	OCEFCS
Opción call europea no estándar sobre índice. Liquidación por diferencias	OCEFCN
Opción put europea estandarizada sobre índice. Liquidación por diferencias	OPEFCS
Opción put europea no estándar sobre índice. Liquidación por diferencias	OPEFCN
Instrumento de referencia para índice (contrato externo) Referential instrument on an index (IBEX series) Referential instrument (Impacto Dividendo)	TIECPX

7.2.2 Derivados sobre Acciones

DESCRIPCIÓN	CFICODE
Futuro financiero estandarizado sobre acciones. Entrega física	FFSPSX
Futuro financiero no estándar sobre acciones. Entrega física	FFSPNX
Futuro financiero estandarizado sobre acciones. Liquidación por diferencias	FFSCSX
Futuro financiero no estándar sobre acciones. Liquidación por diferencias	FFSCNX
Futuro financiero estandarizado sobre otros (dividendos). Liquidación por diferencias	FFVCSX
Futuro financiero no estándar sobre otros (dividendos). Liquidación por diferencias	FFVCNX
Estrategias	KEXXXX
Time spread de futuros sobre acciones con entrega física	KEXXXX
Time spread de futuros sobre acciones con liquidación por diferencias	KEXXXX

Time-spread de futuros sobre otros (dividendos) índices. Liquidación por diferencias	KEXXXX
Facility futuros sobre acciones	KEXXXX
Opción call americana estandarizada sobre acciones. Entrega física	OCASPS
Opción call americana no estándar sobre acciones. Entrega física	OCASPN
Opción put americana estandarizada sobre acciones. Entrega física	OPASPS
Opción put americana no estándar sobre acciones. Entrega física	OPASPN
Opción call europea estandarizada sobre acciones. Entrega física	OCESPS
Opción call europea no estándar sobre acciones. Entrega física	OCESPN
Opción put europea estandarizada sobre acciones. Entrega física	OPESPS
Opción put europea no estándar sobre acciones. Entrega física	OPESPN
Opción call europea estandarizada sobre acciones. Liquidación por diferencias	OCESCS
Opción call europea no estándar sobre acciones. Liquidación por diferencias	OCESCN
Opción put europea estandarizada sobre acciones. Liquidación por diferencias	OPESCS
Opción put europea no estándar sobre acciones. Liquidación por diferencias	OPESCN
Referential instrument for stocks derivatives (external contract)	MRSXXX
Acciones (contado)	ESXXXX
Instrumento de referencia (dividend)	TDSXXX

7.2.3 Derivados sobre Renta Fija

Descripción	CFI Code
Futuro financiero estandarizado sobre renta fija. Entrega física	FFDPSX
Futuro financiero estandarizado sobre renta fija. Liquidación por diferencias	FFDCSX
Time-spread de futuros sobre renta fija con entrega física	KMXXXX

Estrategias	KMXXXX
Opción call europea estandarizada sobre renta fija. Entrega física	OCEDPS
Opción put europea estandarizada sobre renta fija. Entrega física	OPEDPS
Opción call europea no estándar sobre renta fija. Entrega física	OCEDPN
Opción put europea no estándar sobre renta fija. Entrega física	OPEDPN
Opción call europea estandarizada sobre renta fija. Liquidación por diferencias	OCEDCS
Opción put europea estandarizada sobre renta fija. Liquidación por diferencias	OPEDCS
Opción call europea no estándar sobre renta fija. Liquidación por diferencias	OCEDCN
Opción put europea no estándar sobre renta fija. Liquidación por diferencias	OPEDCN

7.2.4 Derivados sobre Divisas

Descripción	CFICode
Futuro financiero estandarizado sobre divisas. Liquidación por diferencias	FFCCSX
Opción call europea estandarizada sobre divisas. Liquidación por diferencias.	OCECCS
Opción put europea estandarizada sobre divisas. Liquidación por diferencias.	OCECCS
Futuro FX Rolling Spot	FFCCSX
Spot sobre divisa	IFXXXP

7.2.5 Derivados sobre Materias Primas

Descripción	CFICode
Futuro estandarizado sobre commodity agrícola. Entrega física	FCAPSX
Time-spread de futuros sobre commodity agrícola	KTXXXX

Estrategias	KTXXXX
Mercancías subyacentes	TTAXXX

7.2.1 Derivados sobre Energía

Descripción	CFIcode
Futuro estándar Anual sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Futuro estándar Trimestral sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Futuro estándar Mensual sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Futuro estándar Semanal (L-D) sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Futuro estándar Semanal (L-V) sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Futuro estándar Semanal (S-D) sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Swap estándar Anual sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Swap estándar Trimestral sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Swap estándar Mensual sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Swap estándar Semanal (L-D) sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Swap estándar Semanal (L-V) sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Swap estándar Semanal (S-D) sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Swap estándar Diario sobre Energía. Liquidación por diferencias	FCHCSX
Futuros sobre Gas. Liquidación por entrega.	N/A
Spot sobre Gas. Liquidación por entrega.	N/A

7.3 ANEXO TABLA 4. CÓDIGOS DE CONTRAPARTIDA CENTRAL Y GRUPO DE CONTRATOS DE LIQUIDACIÓN Y NEGOCIACIÓN

Código	Descripción	Tipo
M3	MEFF – Grupo de contratos Financiero	Negociación
M7	MEFF – Grupo de contratos de Energía	Negociación
MD	MEFF – Derivados sobre divisa en Grupo de contratos Financieros	Negociación
C2	BME Clearing Derivados Financieros	Liquidación
C7	BME Clearing Energía	Liquidación
CM	BME Clearing - ECC	Liquidación
C8	BME Clearing Repo	Liquidación
C0	BME Clearing Renta Variable	Liquidación
C9	BME Clearing IRS	Liquidación
CD	BME Clearing Derivados Financieros Divisas	Liquidación
CN	BME Clearing – ECC Divisas	Liquidación

7.4 ANEXO TABLA 5. SUBGRUPOS DE CONTRATOS

7.4.1 MEFF – Contratos sobre Bono, Índices y Acciones en Grupo de Contratos Financiero

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
02	BONO 10
19	IBEX MICRO
20	MINI IBEX

21	IBEX
22	IBEX PLUS RETURN
23	BBVA
24	ABERTIS
25	ENDESA
27	IBERDROLA
28	SCH
30	REPSOL
31	TELEFONICA
33	ACERINOX
35	BANKINTER
37	NATURGY
38	INDRA
41	AMADEUS
43	INDITEX
45	ACS
46	B.SABADELL
48	ACCIONA
50	SACYR
51	FCC
52	ENAGAS
53	RED ELECTRICA
54	SIEMENS GAMESA
56	MEDIASET

57	MAPFRE
58	ANTENA 3TV
65	NH HOTELES
67	BME
68	GRIFOLS
72	ARCELORMITTAL
73	TÉCNICAS REUNIDAS
74	OBRASCÓN HUARTE
75	FERROVIAL
76	EBRO FOODS
78	IAG
80	CAIXABANK
81	BANKIA
82	DIA
84	ABENGOA B
85	VISCOFAN
87	AENA
99	IBEX IMPACTO DIV
D1	TEF DIVIDENDOS
D2	SAN DIVIDENDOS
D3	BBVA DIVIDENDOS
D4	REP DIVIDENDOS
D5	IBE DIVIDENDOS
D6	ITX DIVIDENDOS

D7	CAIXABANK DIVIDENDOS
D8	GAS NATURAL DIVIDENDOS
D9	ABERTIS DIVIDENDOS
E1	TELEFONICA DIV25
E2	SANTANDER DIV25
E3	BBVA DIV25
E4	REPSOL DIV25
E5	IBERDROLA DIV25
E6	INDITEX DIV25
E7	CAIXABANK DIV25
E8	GAS NATURAL DIV25
E9	ABERTIS DIV25
S1	IBEX BANKS / IBEX35 BANCOS
S2	IBEX UTILITIES / IBEX35 ENERGIA

7.4.2 MEFF - Contratos sobre divisa en Grupo de Contratos Financieros

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
F0	EUR/AUD
F1	EUR/CAD
F2	EUR/CHF
F3	EUR/GBP
F4	EUR/JPY
F5	EUR/NOK

F6	EUR/NZD
F7	EUR/SEK
F8	EUR/USD
F9	GBP/AUD
G0	GBP/CAD
G1	GBP/CHF
G2	GBP/JPY
G3	GBP/NOK
G4	GBP/NZD
G5	GBP/SEK
G6	GBP/USD

7.4.3 MEFF – Grupo de Contratos de Energía

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
01	FUTURE BASE MIBEL
02	SWAP BASE MIBEL
03	FUTURE MINI BASE MIBEL
04	SWAP MINI BASE MIBEL
05	SWAP BASE WIND
11	FUTURE PEAK MIBEL
12	SWAP PEAK MIBEL
13	FUTURE MINI PEAK MIBEL
14	SWAP MINI PEAK MIBEL

7.5 ANEXO TABLA 21 ACTIVOS SUBYACENTES (GRUPO DE CONTRATOS FINANCIERO)

7.5.1 MEFF – Grupo de Contratos Financieros

VALOR	DESCRIPCIÓN
ABG.P	ABENGOA B
ABE	ABERTIS
ABED	ABERTIS DIV
ABEDD	ABERTIS DIV25
ANA	ACCIONA
ACX	ACERINOX
ACS	ACS
AEG	AEGON
AENA	AENA
AMS	AMADEUS
A3M	ANTENA 3TV
SAB	B.SABADELL
BKIA	BANKIA
BKT	BANKINTER
BBVA	BBVA
BBVD	BBVA DIVIDENDOS

BBVDD	BBVA DIV25
BME	BME
B10	BONO 10
CABK	CAIXABANK
CABD	CAIXABANK DIV
CABDD	CAIXABANK DIV25
CAR	CARREFOUR SUPER.
DIA	DIA
EBRO	EBRO FOODS
ENG	ENAGAS
ELE	ENDESA
FCC	FCC
FER	FERROVIAL
SGRE	SIEMENS GAMESA
GAS	GAS NATURAL
GASD	GAS NATURAL DIV
GASDD	GAS NATURAL DIV25
GRF	GRIFOLS
IAG	IAG
IBEDD	IBE DIV25
IBED	IBE DIVIDENDOS
IBE	IBERDROLA
FIE	IBEX
IBB	IBEX BANCARIO

IBC	IBEX CONSTRUCCIÓN
IBH	IBEX IMPACTO DIV
FIEM	IBEX MINI
FIEC	IBEX MICRO
FIT	IBEX RETURN
IBU	IBEX UTILITIES
ITX	INDITEX
IDR	INDRA
ITXD	ITX DIVIDENDOS
ITXDD	ITX DIV25
MAP	MAPFRE
TL5	MEDIASET
MVC	METROVACESA
NHH	NH HOTELES
OHL	OBRASCÓN HUARTE LAIN
REE	RED ELECTRICA
REPDD	REP DIV25
REPD	REP DIVIDENDOS
REP	REPSOL
SCYR	SACYR VALLE
SANDD	SAN DIV25
SAND	SAN DIVIDENDOS
SAN	SCH
SIE	SIEMENS

TRE	TÉCNICAS REUNIDAS
TEFDD	TEF DIV25
TEFD	TEF DIVIDENDOS
TEF	TELEFONICA
VIS	VISCOFAN

7.5.2 MEFF – Contratos sobre Divisa

VALOR	DESCRIPCIÓN
sEURAUD	EURAUD
sEURCHF	EURCHF
sEURGBP	EURGBP
sEURJPY	EURJPY
sEURUSD	EURUSD
sGBPCHF	GBPCHF
sGBPUSD	GBPUSD
sUSDBRL	USDBRL
sUSDCAD	USDCAD
sUSDCHF	USDCHF
sUSDJPY	USDJPY
sUSDMXN	USDMXN
sAUDJPY	AUDJPY
sAUDUSD	AUDUSD
sNZDUSD	NZDUSD

sEURMXN	EURMXN
sEURBRL	EURBRL

7.5.3 MEFF – Grupo de Contratos de Energía

VALOR	DESCRIPCIÓN
MIBFTB	FUTURO BASE MIBEL
MIBSWB	SWAP BASE MIBEL
MIBFTBM	FUTURO MINI BASE MIBEL
MIBSWBM	SWAP MINI BASE MIBEL
MIBFTP	FUTURO PUNTA MIBEL
MIBSWP	SWAP PUNTA MIBEL
MIBFTPM	FUTURO MINI PUNTA MIBEL
MIBSWPM	SWAP MINI PUNTA MIBEL
EOLSWB	SWAP BASE EÓLICO
GASPVB	FUTURO Y SPOT GAS PVB

7.6 ANEXO TABLA 28 FAMILIAS DE PRODUCTOS

VALOR	DESCRIPCIÓN
EIBXO	Estrategias s/ Opciones MINI IBEX 35
ESTCF	Estrategias s/Futuros s/Acciones

ESTCO	Estrategias s/ Opciones s/Acciones
FBONO	BONO E10 Futuros RF
FENGM	Fut.Energía Mensual
FENGQ	Fut.Energía Trimestral
FENGW	Fut.Energía Semanal
FENGY	Fut.Energía Anual
FIBX	Futuros IBEX 35
FIBXC	Futuros MICRO IBEX 35
FIBXD	Futuros Ibx impacto Div
FIBXM	Futuros MINI IBEX 35
FIBXS	Futuros IBEX Sectoriales
FIBXT	Futuros IBEX Total Return
FSTCD	Futuros s/Div acc
FSTCE	Futuros Dividendo Acciones 25
FSTCK	Futuros s/Acciones
OIBXM	Opciones MINI IBEX 35
OSTCK	Opciones s/Acciones
SENGD	Swaps Ener. Diario
SENGM	Swaps Ener. Mensual
SENGQ	Swaps Ener. Trimestral

SENGW	Swaps Ener. Semanal
SENGY	Swaps Ener. Annual
TBONO	BONO E10 Time-spread RF
TIBX	Time-spread IBEX 35
TIBXD	Time-spread Ibox impacto Div
TIBXM	Time-spread MINI IBEX 35
TSTCD	Time-spread s/Div acc
TSTCK	Time-spread s/Acciones
FXROL	Rolling Spot Futures

7.7 ANEXO TABLA TIPOS DE ACTIVO

CODIGO	CONCEPTO
ACE	Acciones Españolas
BA	German Bond
BAU	Austrian Bond
BB	Belgian Bond
BF	French Bond
BH	Dutch Bond
BI	Italian Bond
BON	Bonos del Estado Españoles (up to 5 years)

BPV	Basque Bond
BRU	UK Bond
BU	American Bond
CSH	Efectivo
IDX	Deuda indexada
LET	Letras del Tesoro
OBL	Obligaciones del Estado

7.8 ANEXO TABLA CODIGOS MIC

Operating MIC	Segment MIC	DESCRIPCIÓN
BMEX	XMRV	MEFF - Derivados Financieros
BMEX	XMPW	MEFF - Derivados Energía
BMEX	XMFX	MEFF - Derivados Financieros FX

7.1 ANEXO TABLA 14 TIPOS DE ENTIDADES PARTICIPANTES

DESCRIPCIÓN	VALOR
L	CLEARING / Miembro Compensador
G	Miembro Compensador General
P	Miembro no Compensador Cuenta Propia

N	Miembro no Compensador
D	Ciente Compensador Directo
T	Ciente Compensador Directo Patrocinado
O	Miembro no Compensador Ordinario

7.2 ANEXO TABLA 15. CÓDIGOS DEPOSITARIOS CENTRALES DE VALORES

CODIGO	DESCRIPCION
0	NO APLICA
1	IBERCLEAR
2	CLEARSTREAM
3	EUROCLEAR
4	DECEVAL
5	DCV
6	CUD

8 Glosario General BME CLEARING

Activo Subyacente: Instrumento Financiero o índice objeto de un Contrato.

Autoridad Competente: Autoridad o Autoridades que tengan legalmente atribuidas potestades respecto de la autorización y supervisión de la actuación de los Miembros, de los Clientes y de BME CLEARING.

Clase de Contratos: Contratos referidos al mismo Activo Subyacente.

Circular: Norma aprobada por BME CLEARING, de carácter general y de obligado cumplimiento, que desarrolla el Reglamento y las Condiciones Generales.

Cliente: Persona física o jurídica titular de una Cuenta abierta en el Registro General o en el Registro de Detalle.

Compensación: actuación de agregación en una Posición neta resultante, de las obligaciones de pago de efectivo o de entrega de valores derivadas de los Contratos registrados en las correspondientes Cuentas.

Condiciones Generales: Normas que, desarrollando el Reglamento y formando parte integrante del mismo, establecen los términos y condiciones aplicables a los servicios y funciones que BME CLEARING lleva a cabo en relación con los Contratos que son objeto de su actividad como Entidad de Contrapartida Central. Las Condiciones Generales podrán establecer condiciones y requisitos específicos en relación con la actividad de los Miembros y de los Clientes a propósito del Contrato al que se refieran.

Contrapartida Central: actuación de interposición por cuenta propia respecto de los procesos de compensación y liquidación de las obligaciones derivadas de la participación de sus Miembros en los sistemas de compensación y liquidación de valores o instrumentos financieros reconocidos de conformidad con la Ley 41/1999, de 12 de noviembre, sobre sistemas de pagos y liquidación de valores, así como respecto de operaciones no realizadas en mercados oficiales.

Contrato: Término genérico que incluye todos los negocios jurídicos sobre valores negociables e instrumentos financieros derivados respecto de los que BME CLEARING actúa como ECC.

Cuenta: cada uno de los soportes electrónicos que forman parte del Registro de Operaciones y en los que se anotan los Contratos y Operaciones relativos al titular de la Cuenta, las Posiciones y las Garantías que resultan de los mismos. Es, también, un término genérico que incluye todas las Cuentas de un Miembro o de un Cliente, tanto en el Registro General como en el Registro de Detalle, en su caso.

Las Cuentas del Registro General pueden ser de las siguientes clases: Cuenta Diaria, Cuenta Propia, Cuenta Propia Patrocinada, Cuenta de Cliente Individual, Cuenta de Clientes sin Segregación y Cuenta de Clientes con Segregación. Las Cuentas de Registro de Detalle pueden ser de las siguientes clases: Cuenta sin Segregación y Cuenta con Segregación.

Día Hábil: Aquel día establecido como tal en el calendario que BME CLEARING publicará antes del inicio de cada año natural para cada Clase de Contrato.

Entidad de Contrapartida Central: entidad que realiza funciones de Contrapartida Central de acuerdo con las disposiciones del artículo 44 ter de la Ley 24/1988, de 28 de julio, del Mercado de Valores.

Garantía: activo aportado a favor de BME CLEARING o de los Miembros, conforme a lo dispuesto en el Reglamento y demás normativa aplicable a la ECC, cuya función es cubrir los riesgos de Incumplimiento de las obligaciones contraídas por Miembros y Clientes.

Grupo de Contratos: Son aquellas Clases de Contratos consideradas conjuntamente a los efectos de la normativa aplicable y Garantías exigibles. Las Condiciones Generales de cada Contrato establecerán el Grupo de Contratos al que pertenecen.

Incumplimiento: Situación en la que un Miembro o Cliente no cumple las obligaciones estipuladas en este Reglamento y normativa complementaria incurriendo en alguna de las circunstancias previstas en el Capítulo 8 de este Reglamento.

Intervalo de Valoración: Precio máximo y mínimo del Activo Subyacente utilizados para el cálculo de Garantías.

Instrucción: Norma aprobada por BME CLEARING, de carácter concreto y de obligado cumplimiento, que desarrolla o aplica las Condiciones Generales y las Circulares.

Instrumento Financiero: Término genérico que incluye todos los valores negociables y los instrumentos financieros derivados a los que se refiere el artículo 2 de la Ley 24/1988, de 28 de julio, del Mercado de Valores, que son objeto de Contratos respecto de las cuales BME CLEARING actúe como ECC, de conformidad con el Reglamento y su normativa de desarrollo.

Liquidación: Término genérico que incluye todas las actuaciones de determinación de importes debidos que se llevan a cabo en relación con los Contratos y Operaciones registrados, de acuerdo con lo establecido en este Reglamento y en las Condiciones Generales.

BME CLEARING: BME CLEARING, S.A.U.

Miembro: Denominación genérica que incluye cualquier tipo de Miembro de la ECC de los definidos en el Capítulo 2 del Reglamento: Miembro No Compensador, Miembro No Compensador por Cuenta Propia, Miembro Compensador Individual y Miembro Compensador General.

Miembro Registrador: Miembro No Compensador o Compensador, Individual o General, autorizado por BME CLEARING para gestionar un Registro de Detalle.

Miembro/Cliente Incumplidor: Miembro o Cliente que incurran en el régimen de Incumplimientos recogido en el Capítulo 8 del Reglamento.

Operación: Término genérico que engloba cualquier actuación de Registro, Compensación o Liquidación que, efectuada respecto de los Contratos sobre los que BME CLEARING actúa como ECC, de conformidad con lo previsto en el Reglamento y su normativa complementaria, determina la producción de anotaciones en las Cuentas.

Posición: El conjunto de Operaciones vivas registradas en una Cuenta en cualquier momento.

Registro: Acto por el que BME CLEARING, a los efectos de llevar a cabo sus funciones como Entidad de Contrapartida Central, anota los datos de una Operación en las Cuentas correspondientes del Registro General y, en su caso, por el que los Miembros Registradores anotan simultáneamente los datos de la Operación en sus Cuentas del Registro de Detalle.

Registro de Operaciones: término que engloba el sistema de registro formado por el Registro General y el Registro de Detalle.

Registro General: Sistema de registro de Operaciones, gestionado por BME CLEARING, de los Contratos y Operaciones anotados en las Cuentas abiertas por los Miembros en BME CLEARING.

Registro de Detalle: Sistema de registro de Operaciones, gestionado por cada Miembro Registrador, de los Contratos y las Operaciones registrados en las Cuentas abiertas por los Clientes en dichos Miembros.

Reglamento: El Reglamento, que constituye norma de ordenación y disciplina del Mercado de Valores, siendo de obligado cumplimiento para todos los participantes en la ECC. Las Condiciones Generales de los Contratos forman parte integrante del mismo.

Solicitud de Registro: Acto por el que un Miembro o, actuando por cuenta de un Miembro, un mercado o sistema de negociación para el que BME CLEARING actúa como ECC, solicita a BME CLEARING el Registro de una Operación.

Supervisor General de la ECC: Persona nombrada por BME CLEARING que desempeña la función de vigilar el ordenado desarrollo de las actividades de la ECC, aplicando el Reglamento y demás normas de aplicación.

Supervisor de la ECC: Persona que desempeña la función de vigilar el ordenado desarrollo de las actividades de la ECC, aplicando el Reglamento y demás normas de aplicación, por delegación del Supervisor General de la ECC.

Transacción: Acto de casar dos órdenes de compra o venta en el sistema electrónico de negociación, o de aceptar las operaciones negociadas directamente entre sus participantes, que tiene lugar en el mercado o sistema de negociación para los que BME CLEARING actúa como ECC y que una vez comunicadas a BME CLEARING por dicho mercado o sistema de negociación y confirmadas por BME CLEARING se anotan en el Registro General.

Traspaso: Anotación mediante la cual se cambia de una Cuenta a otra el Registro de un Contrato, de una Operación o de la totalidad o una parte de una Posición.