



MEFFStation

FICHEROS DE DATOS DE LIQUIDACIÓN

MEFF S/MART v9.86

16 de junio de 2014

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.

© 2014 BME. Todos los derechos reservados.

Tabla de Contenidos

1.	Introducción	1
1.1	Alcance.....	1
1.2	Estructura del documento.....	1
1.3	Convenciones utilizadas en este documento	2
1.3.1	Información general de cada fichero.....	2
1.3.2	Definición de ficheros planos	2
1.3.3	Definición de ficheros XML	3
1.3.4	Tipos de datos	3
1.4	Futuras versiones de este documento	4
1.4.1	Nuevos campos	4
1.4.2	Campos eliminados	4
1.4.3	Nuevos ficheros	4
1.4.4	Resaltando cambios	4
2.	Datos Generales	5
2.1	Entorno de liquidación	5
2.2	Estado	6
2.3	Festivos	7
2.4	Entidades participantes	8
2.5	Subgrupos de contratos	9
2.6	Tipos de contrato.....	10
2.7	Contratos.....	12
2.8	Contratos estado "baja"	13
2.9	Códigos internos de contratos.....	14
2.10	Tipos de operación.....	15
2.11	Activos subyacentes.....	16
2.12	Códigos resultantes para cascada teórica.....	17
3.	Información Pública Diaria	18
3.1	Información diaria de contratos	18
4.	Datos Privados de Configuración	20
4.1	Cuentas	20
4.2	Referencias de Give-Out.....	22
4.3	Referencias de Give-In.....	23
4.4	Filtros de aceptación de Give-In para Miembro Destino.....	24
4.5	Filtros de aceptación de Give-In para Compensador de Miembro Destino	25
5.	Datos para Cálculo de Garantías	26
5.1	Parámetros de la matriz de garantías	26
5.2	Compensación intra-matriz.....	27
5.3	Compensación inter-matriz.....	28
5.4	Precios teóricos.....	29
5.5	Deltas	30
5.6	Curva de tipos de interés.....	31
5.7	Dividendos.....	32
5.8	Skew de volatilidades	33
6.	Operaciones	35
6.1	Operaciones	35
6.2	Operaciones que no liquidan en la sesión.....	38
7.	Gestión de Operaciones	41
7.1	Operaciones vivas.....	41
7.2	Asignaciones y traspasos realizados	43
7.3	Give-Outs	44
7.4	Give-Ins para miembro Destino	46
7.5	Give-Ins para Compensador de Miembro Destino	48
8.	Posición Abierta	50
8.1	Saldo de posición abierta	50
8.2	Saldo de posición abierta por Miembro Compensador.....	51
8.3	Saldo de posición abierta virtual para cálculo de garantías.....	52
8.4	Ajustes de posición	53

9.	Ejercicio – Vencimiento	54
9.1	Peticiones de ejercicio	54
9.2	Operaciones de contado del Miembro	55
9.3	Operaciones de contado desglosadas por titular	56
9.4	Títulos entregables	57
9.5	Liquidaciones pendientes en Depositario Central	58
10.	Garantías Depositadas	59
10.1	Detalle de las Garantías depositadas	59
10.2	Detalle de las Garantías depositadas a nivel de Contrapartida Central	61
10.3	Detalle de Asignación de Colateral	63
11.	Comisiones.....	65
11.1	Detalle de comisiones	65
11.2	Comisiones.....	67
12.	Resultados a nivel de Titular	69
12.1	Detalle del cálculo de garantía diaria	69
12.2	Primas de opciones	70
12.3	Variation Margin	71
12.4	Variation Margin pendiente.....	73
12.5	Valoración para productos sin liquidación diaria de variation margin	75
12.6	Liquidaciones y garantías por titular	77
12.7	Liquidaciones y garantías por titular a nivel de Contrapartida Central	78
12.7	Información de las Pruebas Retrospectivas	79
12.8	Información de las Pruebas de Resistencia	80
13.	Registro de detalle. Resultados a nivel de subcuenta	81
13.1	Detalle del cálculo de garantía diaria por subcuenta.....	81
13.2	Liquidaciones y garantías por subcuenta	83
13.3	Operaciones de contado desglosadas por subcuenta.....	84
14.	Resultados para Miembros Compensadores	85
14.1	Garantías requeridas al Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central	85
14.2	Movimientos de efectivo para el Miembro Compensador.....	87
14.3	Movimientos de efectivo para el Miembro Compensador a nivel de Contrapartida Central	88
15.	Resultados para Agentes.....	89
15.1	Movimientos de efectivo para la Entidad Domiciliataria	89
15.2	Movimientos de efectivo para la Entidad Domiciliataria a nivel de Contrapartida Central	90

Índice de Ficheros

CACCOUNTS.ch	20
CACCOUNTSETTL.ch	77
CACCOUNTSETTLDET.ch	83
CBACKTESTING.ch	79
CCASHMOVCLM.ch	87
CCASHMOVTREAS.ch	89
CCLEARINGHOUSE.ch	5
CCONTRACTS.ch	12
CCONTRCODES.ch	14
CCONTRDEL.ch	13
CCONTRGRP.ch	9
CCONTRREL.ch	17
CCONTRSTAT.ch	18
CCONTRTYP.ch	10
CCPACCOUNTSETTL.ch	78
CCPCALLOC.ch	63
CCPCASHMOVCLM.ch	88
CCPCASHMOVTREAS.ch	90
CCPMARGINSCLM.ch.XML	85
CCPPLEDGES.ch	61
CDELIVERABLES.ch	57
CDELTAS.ch	30
CDIVIDENDS.ch	32
CENTITIES.ch	8
CEXERCISERQT.ch	54
CFEES.ch	67
CFEESBRKD.ch	65
CGIVEIN.ch	46
CGIVEINCLM.ch	48
CGIVEINFILT.ch	24
CGIVEINFILTCLM.ch	25
CGIVEINREF.ch	23
CGIVEOUT.ch	44
CGIVEOUTREF.ch	22
CHISTTRADES.ch	41
CHOLIDAYS.ch	7
CINIMARGINCALC.ch	69
CINIMARGINCALCDET.ch	81
CINTERSPR.ch	28
CINTRASPR.ch	27
COPENPOSITION.ch	50
COPENPOSITIONCLM.ch	51
COPENPOSITIONREL.ch	52
CPLEDGES.ch	59
CPOSADJUST.ch	53
CPREMIUMS.ch	70
CSETTLCSD.ch	58
CSPOTTRADES.ch	55
CSPOTTRADESBRKD.ch	56
CSPOTTRADESBRKDDDET.ch	84
CSTATUS.ch	6
CSTRESSTESTING.ch	80
CTHEORPRICES.ch	29
CTRADES.ch	35
CTRADESNL.ch	38
CTRADETYP.ch	15

CTTRANSFTRADES.ch	43
CUNDERLYINGS.ch	16
CVALARRAYS.ch	26
CVALUATIONOTH.ch	75
CVARMARGIN.ch	71
CVARMARGINPEND.ch	73
CVOLATILITYSKEW.ch	33
CYIELDCURVE.ch	31

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 MEFF 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 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.
- 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 titular: datos relativos a las garantías exigidas y depositadas, así como a la negociación, primas de opciones y valoraciones de futuros, forwards y swaps.
- Registro de detalle. Resultados a nivel de subcuenta: datos relativos a las garantías exigidas y depositadas, 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: 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)
<i>Grupo</i>	(2)
<i>Descripción</i>	(3)
<i>Destinatarios</i>	(4)
<i>Privacidad</i>	(5)
<i>Timing</i>	(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.

#	*	<i>Campo</i>	<i>Tipo</i>	<i>Valores válidos</i>	<i>Descripción</i>
(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 “↔” 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 de generación del fichero en formato HH:MM:SS
Valores válidos: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59

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 18 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 2: Fin sesión	Estado de los ficheros

2.3 Festivos

	CHOLIDAYS.ch
Grupo	Datos Generales
Descripción	Calendario de festivos en los que la plataforma de liquidación está cerrada
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

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 14 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

2.5 Subgrupos de contratos

	CCONTRGRP.ch
Grupo	Datos Generales
Descripción	Subgrupos de contratos del grupo Su contenido es equivalente al de las tablas 20 y 21 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 21 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 20 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
9		CalcMethod	char	"1"=Black-76 "2"=Binomial "3"=Black Scholes	Método de cálculo de precios para los contratos de este tipo
10		CFICode	String(6)	ver Tabla 16 en documento "Tablas de Codificación"	Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962.
11		ContractFamily	String(5)	ver Tabla 28 en documento "Tablas de Codificación"	
12		All	String(12)		Identificador All
13		PriceType	Int	1 = Precio 2= Rentabilidad	
14		SecurityType	String(1)	"E"= Strategy "F"=Future "M"=Forward "O"=Option "R"=Roll-over "W"=Swap "X"=Other	Tipo de producto

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
15		FlexibleIndicator	String(1)	"Y" – No estándar "N" – Estándar	Para indicar si es estándar o no
16		ExerciseStyle	String(1)	"A" - Americano "E" - Europeo	Tipo de Ejercicio
17		SettMethod	String(1)	"P" – física "C" - cash	Método de liquidación
18		PutorCall	String(1)	"P" – Put "C" - Call	Tipo de opción
19		Periodicity	String(1)	"Y" – Anual "Q" – Trimestral "M" – Mensual "K" – Semanal (L-D) "B" – Semanal (L-V) "E" – Semanal (S-D) "D" – Diario	
20		AdjustmentsRule	String(1)	"E" – Sólo extraordinarios "T" - Todos	Tipo de ajuste
21		OfficialCFICode	String(6)	ver Tabla 16 en documento "Tablas de Codificación"	CFICode oficial EMIR Reporting

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 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		ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 20 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, B, C, D, E, F, G, H, L, M, S, W, X, Y, Z Códigos: A..Z, 0..9	Tipo de vencimiento usado para el cálculo de garantías
15		MaturityMonthYear	String(8)	Formatos: YYYYMM YYYYMMDD YYYYMMwW (YYYY=año, MM=mes, DD=día, w="w", W=semana	Identificador del vencimiento
16		ISINCode	String(12)		Código ISIN del contrato a efectos informativos. Puede no estar presente.

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

2.12 Códigos resultantes para cascada teórica

	CCONTRREL.ch
Grupo	Datos Generales
Descripción	Relación entre contrato original y sus contratos resultantes, en caso de en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Para MEFFPower informa de las relaciones resultantes de aplicar la cascada teórica.
Destinatarios	Todos los Operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	→	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	→	ContractCode	String(22)		Código de contrato original
4N		NumberOfRelatedContracts	Int		Número de relaciones que se definen a continuación. Máximo 31.
5R		RelatedContractCode	String(22)		Código de contrato resultante
6R		ContractInitialDate	LocalDate		Fecha inicial del contrato. En MEFFPower es la fecha inicial del período de entrega del contrato resultante.
7R		ContractFinalDate	LocalDate		Fecha final del contrato. En MEFFPower es la fecha final del período de entrega del contrato resultante.

3. Información Pública Diaria

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

3.1 Información diaria de contratos

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

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
15		NumberOfTrades	int		Número de operaciones registrado
16		OpenInterest	Qty		Posición abierta
17		AccruedInterest	Price		Cupón corrido incorporado al precio de liquidación de la sesión. Sólo para bonos y obligaciones
18		Yield	Price		

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

	CACCOUNTS.ch
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Información de las cuentas 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
4	→	Account	String(5)		Cuenta (Titular+Subcuenta)
5		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
6		FILLER	String(4)		Filler (contenido no relevante)
7		TreasuryEntity	String(4)		Entidad Domiciliataria
8		AccountClass	char	"D"=Diaria "P"=Propia "C"=Cliente Individual "G"=Cliente Individual de Grupo "A"=Propia o Clientes Agregada "S"=Clientes Segregados "T"=Patrocinada	Clase de la cuenta Nota: MEFF Renta Fija y MEFF Euroservices sólo: "C"=Cliente "P"=Propia "G"=Cliente de grupo
9		AccountType	char	"O"=Ordinaria "D"=Diaria	Tipo de la cuenta El valor de este campo sólo es relevantes para MEFF Renta Fija y MEFF Euroservices
10		FILLER	char		Filler (contenido no relevante)
11		ResidualAccount	String(5)		Este campo sólo es significativo cuando el registro se refiere a una cuenta diaria. Cuenta a la que se moverán las operaciones pendientes de asignar una vez finalizada la prórroga de asignación de cuenta diaria
12		FILLER	char		Filler (contenido no relevante)
13		Active	Char	"S"=Sí "N"=No	Indica si la cuenta está vigente o no

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
14		AuthEntity	Char		Entidad Autorizada a la que pertenece la cuenta
15		HolderType	String(2)	Ver Tabla 25 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de persona
16		ClearingGroup	String(3)		Para cuentas propias y cuentas de clientes agregadas, este campo contiene el código de cuenta propia en la que se informan las garantías

4.2 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

4.3 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 destino en la que debe registrarse el Give-In en caso de ser aceptado

4.4 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

4.5 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 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. 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. Este campo no estará cumplimentado cuando el filtro sea totalmente abierto, esto es, no haya un importe máximo específico a comprobar

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, B, C, D, E, F, G, H, L, M, S, W, X, Y, Z Códigos: A..Z, 0..9	Tipo de vencimiento
6		NumberOfColumns	Int	<=41	Número de columnas
7		PriceFluctuationType	char	"P"=Porcentual "T"=Por Precio	Tipo de fluctuación de precios
8		PriceIncFluctuation	float		Fluctuación de crecimiento (izquierda)
9		PriceDecFluctuation	float		Fluctuación de decrecimiento (derecha)
10		VolatilityVariationType	char	"P"=Porcentual "T"=Aditiva	Forma de aplicar la variación de la volatilidad
11		VolatilityVariation	float		Variación de volatilidad
12		ContractSubgroupCode	String(2)	ver Tabla 20 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	Int		Delta a partir de la cual aplican las garantías para grandes posiciones.
15		FILLER	Int		

5.2 Compensación intra-matriz

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

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

5.3 Compensación inter-matriz

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

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

5.4 Precios teóricos

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	→	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	→	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4	→	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Indica si el registro contiene precios teóricos para posiciones compradoras o vendedoras
5N		NumberOfTheoreticalPrices	int		Número de precios teóricos contenidos en el registro. A continuación se encuentran tantos campos como indique éste
6R		TheoreticalPrice	Price		Precio teórico

5.5 Deltas

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	→	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	→	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4	→	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Indica si el registro contiene deltas para posiciones compradoras o vendedoras
5N		NumberOfDeltas	int		Número de deltas contenidas en el registro. A continuación se encuentran tantos campos como indique éste
6R		Delta	float		Delta

5.6 Curva de tipos de interés

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	→	SessionDate	LocalDate		Fecha de la sesión
2	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	→	CalcType	char	"2"=Garantía "3"=Actualización efectivo compras "4"=Actualización 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.

5.7 Dividendos

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

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

5.8 Skew de volatilidades

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

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
14R		VariationPoints2	float		Puntos porcentuales de incremento / decremento para precio de ejercicio < precio del subyacente

6. Operaciones

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

6.1 Operaciones

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	→	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	→	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación (único a nivel de Grupo de Contratos)
4	→	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
5		Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta
6		UserID	String(3)		Identificador del usuario que realizó la operación En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS"
7		Account	String(5)		Cuenta
8		ContractCode	String(22)		Código de contrato
9		TradeType	char		Tipo de operación
10		Price	Price		Precio
11		Quantity	Qty		Volumen
12		TradeReference	String(18)		Referencia de la operación - Si es una operación procedente de una orden, es la referencia asignada en la orden - Si es una aplicación, es la referencia asignada por el intermediario - Si es una asignación de diaria o un traspaso contiene la referencia de la operación de procedencia.
13		OpenCloseIndicator	char	"O"=Abre "C"=Cierra	Información relevante sólo para cuentas de clientes segregados: indica si la operación abre o cierra posición abierta
14		TradingFee	Amt		Comisión de negociación. El importe se liquida con la cámara en la fecha de liquidación indicada en el campo SettleDate. Ver nota (1)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
15		ClearingFee	Amt		Comisión de liquidación. El importe se liquida con la cámara en la fecha de liquidación indicada en el campo SettleDate. Ver nota (1)
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 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(12)		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	LocalTime		Hora de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en liquidación, esta hora es igual a la hora de la operación inicial.
28		OrderNumber	String(12)		Número de orden asignado por el sistema central. Informado en caso de que la operación inicial provenga de una orden o un quote.
29		GrossTradeAmt	Amt		Nominal / Efectivo de la transacción
30		OrigTradeReference1	String(18)		Referencia original primaria de la operación. En un repo, es la referencia común a las 2 patas del mismo.
31		OrigTradeReference2	String(18)		Referencia original secundaria de la operación. En un repo, es la referencia correspondiente a la ida o la vuelta del mismo.
32		UTI	String(52)		Identificador de la operación para la notificación
33		NotTransferredQty	Qty		Volumen vivo de la operación. Número de contratos asociados a la operación, habiendo descontado aquellos que han sido traspasados

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
34		NextTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación posterior (operaciones precio medio).
35		Yield	Price		

(1) Con la entrada en vigor de las comisiones mínimas por transacción, los campos de comisión de negociación y liquidación ya no estarán informados a nivel de operación.

6.2 Operaciones que no liquidan en la sesión

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	→	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	→	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación (único a nivel de Grupo de Contratos)
4	→	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
5		Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta
6		UserID	String(3)		Identificador del usuario que realizó la operación En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS"
7		Account	String(5)		Cuenta
8		ContractCode	String(22)		Código de contrato
9		TradeType	char		Tipo de operación
10		Price	Price		Precio
11		Quantity	Qty		Volumen
12		TradeReference	String(18)		Referencia de la operación - Si es una operación procedente de una orden, es la referencia asignada en la orden - Si es una aplicación, es la referencia asignada por el intermediario - Si es una asignación de diaria o un traspaso contiene la referencia de la operación de procedencia.
13		OpenCloseIndicator	char	"O"=Abre "C"=Cierra	Información relevante sólo para cuentas de clientes segregados: indica si la operación abre o cierra posición abierta
14		TradingFee	Amt		Comisión de negociación. El importe se liquida con la cámara en la fecha de liquidación indicada en el campo SettleDate. Ver nota (1)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
15		ClearingFee	Amt		Comisión de liquidación. El importe se liquida con la cámara en la fecha de liquidación indicada en el campo SettleDate. Ver nota (1)
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 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(12)		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	LocalTime		Hora de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en liquidación, esta hora es igual a la hora de la operación inicial.
28		OrderNumber	String(12)		Número de orden asignado por el sistema central. Informado en caso de que la operación inicial provenga de una orden o un quote.
29		GrossTradeAmt	Amt		Nominal / Efectivo de la transacción
30		OrigTradeReference1	String(18)		Referencia original primaria de la operación. En un repo, es la referencia común a las 2 patas del mismo.
31		OrigTradeReference2	String(18)		Referencia original secundaria de la operación. En un repo, es la referencia correspondiente a la ida o la vuelta del mismo.
32		UTI	String(52)		Identificador de la operación para la notificación
33		NotTransferredQty	Qty		Volumen vivo de la operación. Número de contratos asociados a la operación, habiendo descontado aquellos que han sido traspasados

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
34		NextTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación posterior (operaciones precio medio).
35		Yield	Price		

(1) Con la entrada en vigor de las comisiones mínimas por transacción, los campos de comisión de negociación y liquidación ya no estarán informados a nivel de operación.

7. 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.

7.1 Operaciones vivas

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	→	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	→	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación (único a nivel de grupo de contratos)
4	→	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
5		Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta
6		Account	String(5)		Cuenta
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 operación inicial es su propio número de registro de liquidación (TradeID)

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
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	LocalTime		Hora de ejecución si proviene de sistema de negociación. Si la operación se registra en liquidación, esta hora es igual a la hora de la operación inicial.
19		GrossTradeAmt	Amt		Valoración inicial. Nominal/Efectivo de la operación en la parte correspondiente al volumen vivo, calculado al precio original de la operación.
20		OrigTradeReference1	String(18)		Referencia original primaria de la operación. En un repo, es la referencia común a las 2 patas del mismo.
21		OrigTradeReference2	String(18)		Referencia original secundaria de la operación. En un repo, es la referencia correspondiente a la ida o la vuelta del mismo.

7.2 Asignaciones y traspasos realizados

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

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

7.3 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 8 en documento "Tablas de Codificación"	Estado del Give-Up
5		GiveOutMember	String(4)		Miembro Origen
6		GiveOutUserID	String(3)		Identificador del operador de liquidación que solicitó la acción
7		ContractCode	String(22)		Código de contrato
8		PreviousTradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación para la que se ha solicitado el Give-Out
9		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de la que se ha solicitado el Give-Out
10		GiveOutAccount	String(5)		Cuenta origen
11		TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación de Give-Up. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.
12		Price	Price		Precio
13		Quantity	Qty		Número de contratos a traspasar
14		GiveOutMnemonic	String(10)		Mnemotécnico del Give-Out
15		GiveInMember	String(4)		Miembro Destino
16		GiveUpReference	String(18)		Referencia de Give-Up
17		TransactionTime	LocalTime		Hora en que el Give-Out pasa a este estado
18		SettlDate	LocalDate		Fecha de liquidación. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado. Este campo está cumplimentado cuando el Give-up ha sido aceptado.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
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

7.4 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 8 en documento "Tablas de Codificación"	Estado del Give-Up
5		GiveInMember	String(4)		Miembro Destino
6		GiveInUserID	String(3)		Identificador del operador de Miembro Destino que actuó aceptando o rechazando el Give-Up En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS" En el caso de Give-Ups sobre los que el Miembro Destino no haya efectuado ninguna acción aparecerá en blanco.
7		ContractCode	String(22)		Código de contrato
8		TradeID	Int		Número de registro de liquidación de la operación de Give-Up. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.
9		Side	Char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de la que se ha solicitado el Give-Up
10		GiveInAccount	String(5)		Cuenta 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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
18		SettlDate	LocalDate		Fecha de liquidación. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado. Este campo está cumplimentado cuando el Give-up ha sido aceptado..
19		GrossTradeAmt	Amt		Nominal / Efectivo de la transacción

7.5 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 8 en documento "Tablas de Codificación"	Estado del Give-Up
5		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador del Miembro Destino del Give-Up
6		UserID	String(3)		Identificador del operador del Compensador de Miembro Destino que actuó aceptando o rechazando el Give-Up En el caso de Give-Ups aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS" En el caso de Give-Ups sobre los que el Compensador no haya efectuado ninguna acción aparecerá en blanco.
7		GiveInMember	String(4)		Miembro Destino
8		GiveInUserID	String(3)		Identificador del operador de Miembro Destino que aceptó el Give-Up En el caso de Give-Ins aceptados automáticamente, el valor de este campo es "SYS"
9		ContractCode	String(22)		Código de contrato
10		TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación de Give-Up. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado.
11		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de la que se ha solicitado el Give-Up
12		GiveInAccount	String(5)		Cuenta 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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
18		SettlDate	LocalDate		Fecha de liquidación. Sólo debe ser tenido en cuenta cuando el Give-Up se haya aceptado. Este campo está cumplimentado cuando el Give-up ha sido aceptado.
19		GrossTradeAmt	Amt		Nominal / Efectivo de la transacción

8. 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.

8.1 Saldo de posición abierta

	COPENPOSITION.ch
Grupo	Posición Abierta
Descripción	Información de la posición abierta por cuenta 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
4	→	Account	String(5)		Cuenta
5	→	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		LongPosition	Qty		Posición compradora para la combinación de cuenta y contrato del registro
7		ShortPosition	Qty		Posición vendedora para la combinación de cuenta y contrato del registro

8.2 Saldo de posición abierta por Miembro Compensador

	COPENPOSITIONCLM.ch
Grupo	Posición Abierta
Descripción	Información de la posición abierta por Miembro Compensador y contrato (sólo aquellas que tienen posición)
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
5	→	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		Position	Qty		Posición neta
7		UTI	String(52)		Identificador de la posición para la notificación

8.3 Saldo de posición abierta virtual para cálculo de garantías

	COPENPOSITIONREL.ch
Grupo	Posición Abierta
Descripción	Información de la posición abierta por cuenta y contrato (sólo aquellas que tienen posición) a tener en cuenta para calcular la componente de initial margin de las garantías por posición, en caso de en el grupo de contratos haya contratos cuya posición deba desglosarse en otros de nominal menor. Para MEFFPower 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
4	→	Account	String(5)		Cuenta
5	→	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		LongPosition	Qty		Posición compradora para la combinación de cuenta y contrato del registro
7		ShortPosition	Qty		Posición vendedora para la combinación de cuenta y contrato del registro

8.4 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
5		Account	String(5)		Cuenta
6		ContractCode	String(22)		Código de contrato
7		UserID	String(3)		Identificador del operador de liquidación que solicitó la acción
8		AdjustmentQty	Qty	>0	Número de contratos en que se ajusta la posición
9		AdjustmentSign	char	"1"=Reducción de posición "2"=Incremento de posición	Indica si se realiza una reducción o incremento de posición
10		AdjustmentTime	LocalTime		Hora del ajuste de posición

9. Ejercicio – Vencimiento

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

9.1 Peticiones de ejercicio

	CEXERCISERQT.ch
Grupo	Ejercicio - Vencimiento
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
4	→	Account	String(5)		Cuenta
5	→	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6		UserID	String(3)		Identificador del operador de liquidación que solicitó la acción
7		Quantity	Qty		Número de contratos a ejercer. Este valor no debe ser tenido en cuenta cuando se trata de una petición de no ejercer. Está en blanco si la petición es para todo el volumen existente.
8		ExerciseRequest	char	"S"=Ejercer "N"=No Ejercer "A"=Automático	Indica si el registro se refiere a una petición expresa de ejercer o de no ejercer, o si se desea el ejercicio automático por el sistema

9.2 Operaciones de contado del Miembro

	CSPOTTRADES.ch
Grupo	Ejercicio - Vencimiento
Descripción	Información acerca de las operaciones de entregas a realizar fuera de MEFF: - Sobre acciones, como consecuencia del ejercicio de opciones realizado en la sesión. Se envía al negociador y a todos sus posibles Compensadores. - 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 Negociador, y a su Compensador.
Destinatarios	Miembro/ Miembro que actúa como Titular de Cuenta, Miembro Compensador
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

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

9.3 Operaciones de contado desglosadas por titular

	CSPOTTRADESBRKD.ch
Grupo	Ejercicio – Vencimiento
Descripción	Detalle a nivel titular de las operaciones a realizar fuera de MEFF: - Sobre acciones, como consecuencia del ejercicio de opciones realizado en la sesión. - 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	↔	Member	String(4)		Miembro al que pertenece el titular
4	↔	Holder	String(3)		Titular
5	↔	DeliverableContractCode	String(22)		Código de título entregable
6	↔	ExerciseIndicator	char	"A"=Anticipado "V"=Vencimiento	Indica si la entrega proviene de ejercicio anticipado o al vencimiento
7		Quantity	Qty		Volumen que se entrega.
8	↔	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de contado
9	↔	ReferencePrice	Price		Precio de referencia
10		TradeDate	LocalDate		Fecha de registro de las operaciones
11		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
12		CodCSD	char	Ver tabla 15 en documento "Tablas de Codificación"	Código de Depositario Central de Valores en el que se realiza la entrega
13		CashAmt	Amt		En entrega de valores de renta variable, corresponde al importe efectivo de la operación. En entrega de valores de renta fija es el importe efectivo de la entrega = nº contratos * (precio de liquidación en tanto por 1 * nominal de un contrato * factor de conversión + cupón corrido).
14	↔	TradeID	Int		Número de operación de entrega En MEFF 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.

9.4 Títulos entregables

	CDELIVERABLES.DB
Grupo	Ejercicio - Vencimiento
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 15 en documento "Tablas de Codificación"	Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía
5	↔	DeliverableContractCode	String(22)		Código de título entregable empleado por la cámara
6		DeliverableOrderNo	Int	>0	Número de orden de emisión del entregable
7		DeliverableISINCode	String(12)		Código ISIN del título entregable
8		MatutiryDate	LocalDate		Fecha de vencimiento y de entrega
9		Factor	Float		Factor de conversión. Aplica a la entrega de bonos
10		AccruedInterest	Amt		Cupón corrido. Aplica a la entrega de bonos
11		Field1	String(20)		MEFF: Este campo no aplica. CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL: este campo corresponde al Código ISIN ANNA. String(12) * Si el activo está depositado en DCV: este campo corresponde al Código título que identifica al activo en DCV. String(3)
12		Field2	String(20)	0=DECEVAL 1=CLEARSTREAM 2=BANK OF NEW YORK 3 = DCV	MEFF: Este campo no aplica. CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL: este campo corresponde al Código Depósito donde se encuentra el ISIN.String(10) * Si el activo está depositado en DCV: este campo corresponde al Número de emisión que identifica al activo en DCV. String(7)
13		BVCCContractCode	String(35)		MEFF: Este campo no aplica CRCC: Nemo técnico del título en la BVC
14		CFICode	String(6)		Código CFI

9.5 Liquidaciones pendientes en Depositario Central

	CSETTLCSD.ch
Grupo	Ejercicio - Vencimiento
Descripción	Información a nivel miembro de las liquidaciones pendientes de realizar en el Depositario Central
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	→	Holder	String(3)		Titular
6	→	CodCSD	char	Ver tabla 15 en documento "Tablas de Codificación"	Código de Depositario Central de Valores en el que se realiza la liquidación
7	→	ISINCode	String(12)		Código ISIN del activo subyacente
8	→	ValueDate	LocalDate		Fecha valor de la liquidación
9	→	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación a liquidar
10		NominalAmt	Amt		Nominal pendiente de liquidar
11		CashAmt	Amt		Importe efectivo pendiente de liquidar
12		Currency	Currency	Ver tabla 1 en el documento "Tablas de Codificación"	Divisa

10. Garantías Depositadas

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

10.1 Detalle de las Garantías depositadas

Este fichero se mantendrá en los entornos MEFF Renta Fija y MEFF Euroservices.

	CPLEDGES.ch
Grupo	Garantías Depositadas por Titulares
Descripción	Valoración de los activos depositados como garantías 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	→	ClearingHouseCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	→	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	→	Member	String(4)		Miembro al que pertenece el titular (puede estar en blanco para garantías depositadas por el Compensador)
5	→	Holder	String(3)		Titular (puede estar en blanco en el mismo caso que el campo anterior)
6	→	AssetTCode	String(12)		Código del activo entregado. En el caso de MEFF es el código de ISIN. Nótese que el código ISIN para el Euro es "EU0009656420"
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 15 en documento "Tablas de Codificación"	Nombre del Depositario Central del activo
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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
14		AssetValue	Amt		Valor del activo: Nominal * Precio * Haircut. 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 están expresados los importes de este registro
16	↔	MarginType	String(2)	ver Tabla 7 en documento "Tablas de Codificación"	Destino de la garantía. Indica el concepto para el que se destina el valor efectivo de las garantías
17	↔	CSDCode	char	ver Tabla 15 en documento "Tablas de Codificación"	Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía
18		CFICode	string(6)		Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962
19		Field1	String(20)		MEFF: Reservado para uso futuro CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12) * Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3)
20		Field2	String(20)		MEFF: Reservado para uso futuro CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10) * Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7)
21		Field3	String(20)		Reservado para uso futuro
22		Field4	String(20)		Reservado para uso futuro

10.2 Detalle de las Garantías depositadas a nivel de Contrapartida Central

	CCPPLEDGES.ch
Grupo	Garantías Depositadas por Titulares a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Valoración de los activos depositados como garantías 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	→	CCPCCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	→	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	→	Member	String(4)		Miembro al que pertenece el titular (puede estar en blanco para garantías depositadas por el Compensador)
5	→	Holder	String(3)		Titular (puede estar en blanco en el mismo caso que el campo anterior)
6	→	AssetTCode	String(12)		Código del activo entregado. En el caso de MEFF es el código de ISIN. Nótese que el código ISIN para el Euro es "EU0009656420"
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 15 en documento "Tablas de Codificación"	Nombre del Depositario Central del activo
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. Si es un repo, es su nominal valorado a precio de mercado

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
15	↔	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes de este registro
16	↔	CSDCode	char	ver Tabla 15 en documento "Tablas de Codificación"	Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía
17		CFICode	string(6)		Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962
18		Field1	String(20)		MEFF: Reservado para uso futuro CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12) * Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3)
19		Field2	String(20)		MEFF: Reservado para uso futuro CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10) * Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7)
20		Field3	String(20)		Reservado para uso futuro
21		Field4	String(20)		Reservado para uso futuro

10.3 Detalle de Asignación de Colateral

	CCPCALLOC.ch
Grupo	Asignación de Colateral por Titulares a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Valoración de los activos resultantes de la asignación de colateral en la fecha de la sesión, detallados 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		CCPCCode	String(2)		Código de contrapartida central
3		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4		Member	String(4)		Miembro al que pertenece el titular (puede estar en blanco para garantías depositadas por el Compensador)
5		Holder	String(3)		Titular (puede estar en blanco en el mismo caso que el campo anterior)
6		AssetTCode	String(12)		Código del activo entregado. En el caso de MEFF es el código de ISIN. Nótese que el código ISIN para el Euro es "EU0009656420"
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 15 en documento "Tablas de Codificación"	Nombre del Depositario Central del activo
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. Si es un repo, es su nominal valorado a precio de mercado

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
15		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes de este registro
16		CSDCode	char	ver Tabla 15 en documento "Tablas de Codificación"	Código del Depositario Central de Valores en el que está constituida la garantía
17		CFICode	string(6)		Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962
18		Field1	String(20)		MEFF: Reservado para uso futuro CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Isin unido. String(12) * Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Código título. String(3)
19		Field2	String(20)		MEFF: Reservado para uso futuro CRCC: * Si el activo está depositado en DECEVAL, este campo corresponde al Código Fungible. String(10) * Si el activo está depositado en DCV, este campo corresponde al Número de Emisión. String(7)
20		Field3	String(20)		Reservado para uso futuro
21		Field4	String(20)		Reservado para uso futuro

11. Comisiones

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

11.1 Detalle de comisiones

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	→	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	→	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación
4	→	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
5	→	LastDateFeesCalc	LocalDate		En caso de cargo de comisiones, esta fecha siempre es igual a la fecha de la sesión. En caso de devolución, este campo indica la ultima fecha de sesión en la que se ha realizó cálculo de comisiones para esta operación
6	→	FeeGroup	String(2)	ver Tabla 23 en documento "Tablas de Codificación"	Grupo de comisión asociado al subyacente, instrumento y tipo de cuenta
7		FeeType	String(2)	ver Tabla 24 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de comisión
8		FeeConcept	char	1= Por contrato 2=Cap 3=Floor 4=Por MWh 5=Por efectivo 6=Efectivo/plazo	Concepto de cobro
9		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresadas las comisiones
10		RegDate	LocalDate		Fecha de registro de la operación
11		PreviousTradeDate	LocalDate		Fecha de la operación previa. Este campo es útil para el seguimiento de comisiones en caso de give-outs y traspasos que cierran
12		Clearing Member	String(4)		Miembro Compensador
13		Member	String(4)		Miembro Negociador

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

11.2 Comisiones

	CFEES.ch
Grupo	Comisiones
Descripción	Información del total de comisiones devengadas en la sesión por cada Miembro Negociador
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 23 en documento "Tablas de Codificación"	Grupo de comisión asociado al subyacente, instrumento y tipo de cuenta
6	↔	FeeType	String(2)	ver Tabla 24 en documento "Tablas de Codificación"	Tipo de comisión
7	↔	FeeConcept	char	1= Por contrato 2=Cap 3=Floor 4=Por MWh 5=Por efectivo 6=Efectivo/plazo	Concepto de cobro
8	↔	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
9	↔	Member	String(4)		Miembro negociador
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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
18		FixedAmount	Amt		Importe fijo

12. Resultados a nivel de Titular

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

12.1 Detalle del cálculo de garantía diaria

	CINIMARGINCALC.ch
Grupo	Resultados a nivel de Titular
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada titular
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 el titular
4	→	Holder	String(3)		Titular
5	→	ArrayCode	String(3)		Código de matriz de garantías
6		NetPositionMargin	Amt		Garantía posición neta
7		TimeSpreadMargin	Amt		Garantía time-spread o por posición compensada dentro del mismo grupo
8		Scenario	int		Escenario más desfavorable
9		LongPositionDelta	Amt		Delta posición abierta compradora
10		ShortPositionDelta	Amt		Delta posición abierta vendedora
11		NetDelta	Amt		Delta neta
12		DeltaToOffset	Amt		Delta a aplicar en cada grupo de compensación
13		InterCommoditySpreadCredit	Amt		Descuento por spreads obtenido en las compensaciones
14		FinalDelta	Amt		Delta final
15		CommodityMargin	Amt		Garantía Grupo (previa a la compensación de subyacentes)
16		FinalCommodityMargin	Amt		Garantía final
17		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que están expresados los importes de este registro
18		NetCommodityMargin	Amt		Garantía Grupo tras la compensación de subyacentes
19		PendingVariationMargin	Amt		Ajuste de garantía por Variation Margin no liquidado
20		ScenarioIni	Int		Escenario más desfavorable sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones.
21		NetDeltaIni	Amt		Delta neta sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones

12.2 Primas de opciones

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	→	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	→	TradeID	int		Número de registro de liquidación de la operación
4	→	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación
5		Member	String(4)		Miembro al que pertenece la cuenta
6		Account	String(5)		Cuenta 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

12.3 Variation Margin

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

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

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
12		SettlPrice	Price		Precio de valoración final: Si la sesión ha finalizado es el precio de liquidación del contrato. Si la sesión no ha finalizado es el precio de la última operación del contrato. CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad.
13		SettlValue	Amt		Valoración final de la posición / operación referida en el registro. Es el resultado de multiplicar el precio de valoración final por el volumen y el multiplicador del contrato. Tiene signo positivo para las compras y negativo para las ventas
14		VariationMargin	Amt		Pérdidas y ganancias generadas por la posición / operación referida en el registro. Es la diferencia entre la valoración final y la valoración inicial.
15		Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa en la que está expresada la valoración
16		InitialDate	LocalDate		Fecha de la valoración inicial. Si PositionTradeIndicator = 1, es la fecha de la última sesión en la que se liquidaron pérdidas y ganancias. Si PositionTradeIndicator = 2, es la fecha de registro de la operación

12.4 Variation Margin pendiente

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

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

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

12.5 Valoración para productos sin liquidación diaria de variation margin

	CVALUATIONOTH.ch
Grupo	Resultados a nivel de Titular
Descripción	Detalle de la valoración de las operaciones o posiciones para aquellos productos que no tienen liquidación diaria de pérdidas y ganancias. - Para operaciones de sesiones previas: contiene, en base a la posición abierta a inicio de día, la valoración calculada según la diferencia entre el precio de cierre de la sesión anterior y el de la sesión actual. - Para operaciones del día: contiene, en base a dichas operaciones, la valoración calculada según la diferencia entre precio de la operación y precio de cierre de la sesión actual. Este fichero contiene los mismos campos y en el mismo orden que el fichero CARMARGIN
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
4	→	Account	String(5)		Cuenta
5	→	ContractCode	String(22)		Código de contrato
6	→	PositionTradeIndicator	char	"1"=Posición abierta al inicio de la sesión "2"=Operación del día	Indica si se está valorando la posición abierta al inicio de la sesión o de una operación
7	→	TradeID	int		Si PositionTradeIndicator = 2, es el número de registro de liquidación de la operación
8	→	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
9		Quantity	Qty		Volumen
10		InitialPrice	Price		Precio de valoración inicial: Si PositionTradeIndicator = "1", es el precio de cierre de la sesión anterior. Si PositionTradeIndicator = "2", es el precio de la operación CRCC: Para los productos con cotización por rentabilidad este precio es la rentabilidad

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

12.6 Liquidaciones y garantías por titular

	CACCOUNTSETTL.ch
Grupo	Resultados por Titular
Descripción	Importes por titular 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	→	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	→	Member	String(4)		Miembro al que pertenece el titular
4	→	Holder	String(3)		Titular
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		InitialMarginPledged	Amt		Valoración del colateral depositado por el titular. NOTA: Sólo viene informado para MEFF Renta Fija
8		InitialMarginDiff	Amt		Diferencia entre las garantías diarias exigidas y el colateral depositado
9		VariationMargin	Amt		Pérdidas y ganancias generadas
10		TradingFee	Amt		Comisiones de negociación Ver nota (1)
11		ClearingFee	Amt		Comisiones de liquidación Ver nota (1)
12		Premium	Amt		Primas de opciones

(1) Con la entrada en vigor de las comisiones mínimas por transacción, los campos de comisión de negociación y liquidación ya están informados a nivel de titular.

12.7 Liquidaciones y garantías por titular a nivel de Contrapartida Central

	CCPACCOUNTSETTL.ch
Grupo	Resultados por Titular a nivel de Contrapartida Central
Descripción	Importes por titular 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	→	Member	String(4)		Miembro al que pertenece el titular
5	→	Holder	String(3)		Cuenta
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 el titular.
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

12.7 Información de las Pruebas Retrospectivas

	CBACKTESTING.ch
Grupo	Resultados por Titular
Descripción	Importes por titular 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	↔	Member	String(4)		Miembro al que pertenece el titular
5	↔	Holder	String(3)		Cuenta
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

12.8 Información de las Pruebas de Resistencia

	CSTRESSTESTING.ch
Grupo	Resultados por Titular
Descripción	Importes por titular 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	→	Member	String(4)		Miembro al que pertenece el titular
5	→	Holder	String(3)		Cuenta
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 (sin tener en cuenta Variation Margin ni Garantías por Grandes Posiciones)
10		StressTestRisk	Amt		Riesgo en situación de Stress Test

13. Registro de detalle. Resultados a nivel de subcuenta

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado con los datos, a nivel de subcuenta, relativos a las garantías exigidas 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 MEFF, y contendrán información para cada una de las subcuentas de sus cuentas de cliente agregadas o segregadas.

13.1 Detalle del cálculo de garantía diaria por subcuenta

	CINIMARGINCALCDET.ch
Grupo	Registro de detalle. Resultados a nivel de subcuenta
Descripción	Información detallada del cálculo de la garantía diaria de cada subcuenta
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	↔	Account	String(5)		Subcuenta de una cuenta de clientes agregada o segregada
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		NetDeltalni	Amt		Delta neta sin tener en cuenta escenarios de grandes posiciones

13.2 Liquidaciones y garantías por subcuenta

	CACCOUNTSETTLDET.ch
Grupo	Registro de detalle. Resultados a nivel de subcuenta
Descripción	Importes por subcuenta 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
4	→	Account	String(5)		Subcuenta de una cuenta de clientes agregada o segregada
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

13.3 Operaciones de contado desglosadas por subcuenta

	CSPOTTRADESBRKDDDET.ch
Grupo	Registro de detalle. Resultados a nivel de subcuenta
Descripción	Detalle a nivel de subcuenta de las operaciones sobre acciones a realizar fuera de MEFF, 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 el titular
4	→	Account	String(5)		Subcuenta de una cuenta de clientes agregada o segregada
5	→	DeliverableContractCode	String(22)		Código de título entregable (código de contrato de contado)
6	→	ExerciseIndicator	char	"A"=Anticipado "V"=Vencimiento	Indica si la entrega proviene de ejercicio anticipado o al vencimiento
7		Quantity	Qty		Volumen que se entrega. En valores de renta fija: valor nominal En valores de renta variable: N° acciones
8	→	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo de la operación de contado
9	→	ReferencePrice	Price		Precio de referencia
10		TradeDate	LocalDate		Fecha de registro de las operaciones de contado
11		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
12		CodCSD	char	Ver tabla 15 en documento "Tablas de Codificación"	Código de Depositario Central de Valores en el que se realiza la entrega
13		CashAmt	Amt		En MEFF sólo se usa en entrega de acciones, y corresponde al importe efectivo de la operación. En CRCC 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 En MEFF siempre es cero.

14. 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.

14.1 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_0.xsd) está disponible en:
http://www.meff.com/docs/esp/Tecnologia/esquemas/CCPMARGINSCLM_v1_0.xsd

Versión XSD: 1.0

#	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	Rating		Rating 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
7.2.4	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)
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
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
9	CashAmount		Importe del movimiento de efectivo resultante cuando se constituyan garantías en efectivo a través de la liquidación multilateral de TARGET2 (carga si es < 0, abono si es > 0)
10	LRIUsage		Consumo de Límite de Riesgo Intradía resultante a fin de sesión.
11	LRINextSession		Límite de Riesgo Intradía resultante para la siguiente sesión.
12	DFSTInformation		Información relacionada con el Stress Test de la Garantía Colectiva
12.1	DFSTHolderPM		Sobrante de Garantías por Posición del Titular 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

14.2 Movimientos de efectivo para el Miembro Compensador

Este fichero se mantendrá en los entornos MEFF Renta Fija y MEFF Euroservices.

	CCASHMOVCLM.ch
Grupo	Resultados para Miembros Compensadores
Descripción	Información del movimiento de efectivo total a realizar en la liquidación multilateral por un Miembro Compensador desglosado por Negociador y concepto. 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	→	ClearingHouseCode	String(2)		Código de cámara
3	→	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
4	→	Member	String(4)		Miembro negociador al que es atribuible el cargo o abono que se detalla en el registro (puede ir en blanco)
5	→	ConceptCode	String(2)	ver Tabla 4 en documento "Tablas de Codificación"	Concepto de movimiento de efectivo
6	→	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
7	→	PaymentMethod	String(2)	ver Tabla 5 en documento "Tablas de Codificación"	Método de pago
8		ConceptDescription	String(50)		Descripción del concepto (si el código de concepto es "99")
9		CashAmount	Amt		Importe del movimiento de efectivo resultante (cargo si es < 0, abono si es > 0)
10		ValueDate	LocalDate		Fecha valor del movimiento de efectivo

14.3 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 en la liquidación multilateral por un Miembro Compensador desglosado por Negociador y concepto. 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	→	CCPCCode	String(2)		Código de contrapartida central
3	→	ContractGroup	String(2)		Código de Grupo de Contratos. Para conceptos no relacionados con un Grupo de Contratos concreto contendrá el código de contrapartida central.
4	→	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
5	→	Member	String(4)		Miembro negociador al que es atribuible el cargo o abono que se detalla en el registro (puede ir en blanco)
6	→	ConceptCode	String(2)	ver Tabla 4 en documento "Tablas de Codificación"	Concepto de movimiento de efectivo
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

15. Resultados para Agentes

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

15.1 Movimientos de efectivo para la Entidad Domiciliataria

Este fichero se mantendrá en los entornos MEFF Renta Fija y MEFF Euroservices.

	CCASHMOVTREAS.ch
Grupo	Resultados para Agentes
Descripción	Movimientos de efectivo a realizar por la Entidad Domiciliataria
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	→	ClearingHouseCode	String(2)		Código de cámara
3	→	TreasuryEntity	String(4)		Entidad Domiciliataria
4	→	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador al que corresponde el movimiento de efectivo
5	→	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
6	→	PaymentMethod	String(2)	ver Tabla 5 en documento "Tablas de Codificación"	Método de pago
7		CashAmount	Amt		Importe del movimiento de efectivo resultante (cargo si es < 0, abono si es > 0)
8		ValueDate	LocalDate		Fecha valor del movimiento de efectivo
9	→	Type	char	1= Exento de impuestos 2= Sujeto a Impuestos	MEFF: Este campo no aplica. Valor siempre 1. CRCC: Indica si el importe corresponde a conceptos de liquidación que están exentos de impuestos o sujetos a impuestos

15.2 Movimientos de efectivo para la Entidad Domiciliataria a nivel de Contrapartida Central

	CCPCASHMOVTREAS.ch
Grupo	Resultados para Agentes
Descripción	Movimientos de efectivo a realizar por la Entidad Domiciliataria
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)		Entidad Domiciliataria
4	→	ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador al que corresponde el movimiento de efectivo
5	→	Currency	Currency	ver Tabla 1 en documento "Tablas de Codificación"	Divisa
6	→	PaymentMethod	String(2)	ver Tabla 5 en documento "Tablas de Codificación"	Método de pago
7		CashAmount	Amt		Importe del movimiento de efectivo resultante (cargo si es < 0, abono si es > 0)
8		ValueDate	LocalDate		Fecha valor del movimiento de efectivo
9	→	Type	char	1= Exento de impuestos 2= Sujeto a Impuestos	MEFF: Este campo no aplica. Valor siempre 1. CRCC: Indica si el importe corresponde a conceptos de liquidación que están exentos de impuestos o sujetos a impuestos