

COMUNICADO DF 22/18

Fecha: 16 de octubre de 2018

Asunto: Nuevo servicio de cálculo de garantías de una cartera mediante mensajería FIX.

BME CLEARING ofrece un nuevo servicio de cálculo de garantías de una cartera mediante mensajería FIX.

Este servicio permitirá a la entidad enviar de forma automática posición de una o varias carteras recibiendo como respuesta el importe de la garantía calculada por la cámara para cada cartera.

La aplicación cliente utiliza el mensaje "Margin Requirement Inquiry" para introducir una cartera con la posición en cada contrato, y el sistema genera un mensaje "Margin Requirement Report" con el resultado de la garantía estimada de la cartera en ese momento de la sesión.

Para realizar el cálculo de la garantía en Derivados Financieros durante la sesión, la aplicación empezará la sesión utilizando la matriz de precios teóricos calculada al inicio de la sesión e irá actualizando periódicamente la matriz durante la sesión. Al finalizar la sesión la matriz de precios teóricos utilizada será la del cierre del día.

Para realizar el cálculo de la garantía en los productos xRolling FX (<http://www.meff.es/esp/Futuros-FX-Rolling-Spot-xRolling>), la aplicación utilizará los precios de la sesión junto con los escenarios del modelo según correspondan. Durante la sesión, la aplicación utilizará los escenarios correspondientes a D-1 y a cierre de sesión, el aplicativo utilizará los escenarios actualizados a los movimientos acontecidos en la sesión.

El sistema está ya disponible en el entorno de Formación de Derivados Financieros y estará disponible en Producción el próximo 22 de febrero de 2019. En xRolling FX estará disponible en el entorno de Formación el 30 de noviembre.

La documentación técnica está disponible en el siguiente link: <http://www.bmeclearing.es/esp/Tecnologia/Documentacion-Versiones.aspx>, véase el apartado 14 del documento MEFFGate Liquidación Especificación de la Interfax FIX C1.8 – 10/10/2018.

Para cualquier consulta, por favor dirigirse a techservices@grupobme.es.