

Futuro 10Y T-Note

ACTIVO SUBYACENTE	Bono nocional sobre deuda pública del Tesoro de los EE.UU. (U.S. Treasury Notes o T-Notes) con una vida pendiente de entre 6,5 años y 10 años, con un cupón del 6% y vencimiento de 10 años.
MERCADO	CME-CBOT
NOMINAL DEL CONTRATO	100.000 USD
FORMA DE COTIZACION	En porcentaje del valor nominal y con decimales. Tenemos que tener en cuenta que en el mercado CBOT la cotización es en fracciones, en concreto, en la mitad de 1/32 de punto, aunque a través de BBVA Trader se muestra en sus decimales correspondientes, haciendo la conversión de fracciones a decimales. Los precios se muestran redondeados a 2 decimales, aunque a efectos de envío de órdenes al mercado y cálculos de resultados se tienen en cuenta todos los decimales resultantes de la conversión.
FLUCTUACION MINIMA Y VALOR DEL TICK	0.015625% del valor nominal, lo que equivale a 15,625 USD.
VENCIMIENTOS	5 vencimientos abiertos a negociación correspondientes a los cinco meses correlativos más cercanos del ciclo trimestral: marzo, junio, septiembre y diciembre. En BBVA Trader sólo se podrán negociar los cuatro vencimientos más próximos.
FECHA DE VENCIMIENTO Y ÚLTIMO DÍA DE ENTREGA	Último día hábil del mes de vencimiento.
ULTIMO DIA DE NEGOCIACION	Séptimo día hábil anterior al último día hábil del mes de vencimiento. En el último día de negociación, ésta termina a las 12:01 horas (CT: Central Time, U.S.). Éste es el funcionamiento en el mercado CBOT A través de BBVA Trader la negociación finaliza un día antes ya que no se permite la liquidación a vencimiento en este futuro.
PRECIO DE LIQUIDACION DIARIA	Calculado por el mercado. En el caso del vencimiento más líquido se calcula en base al precio medio ponderado por volumen (Volume Weighted Average Price (VWAP)) de las operaciones ejecutadas en Globex entre las 13:59:30 y las 14:00:00 horas (CT). El resto de vencimientos son liquidados en base a las operaciones o cotizaciones de los spreads (roll-overs) correspondientes.
LIQUIDACION DIARIA DE PERDIDAS Y GANANCIAS	La liquidación diaria de pérdidas y ganancias es en efectivo, antes del inicio de la sesión del día hábil siguiente a la fecha de transacción, por diferencias entre el precio de la operación (compra o venta) y el precio de liquidación diaria. A modo de ejemplo, una compra de 3 Futuros de 10-Y T-Note a 124,050 con un Precio de Liquidación a final de sesión de 124,210 tendrá la siguiente liquidación: $(124,210 - 124,050) \times 3 \times 100.000 \text{ USD de nominal} \times 0,01 = + 480 \text{ USD}$.
LIQUIDACION DE COMISIONES	Primer Día Hábil posterior a la fecha de la transacción.
LIQUIDACION A VENCIMIENTO	Por entrega física. BBVA Trader no realiza liquidación por entrega, por lo tanto, si el cliente no cierra la posición, BBVA Trader cerrará la posición en mercado el día anterior al último día de negociación del contrato.
GARANTIAS	Dato variable disponible en la sección "Mercados" en la ficha de este producto.
HORARIO DE MERCADO	El horario de negociación en CME-CBOT es prácticamente de 24h. En BBVA Trader el horario de negociación será de 08:00 a.m. a 10:15 p.m.

Fuente: Mercado CME-CBOT (<http://www.cmegroup.com>)

Mod. Ficha Futuro 10Y Note _v.10/2017

Creando Oportunidades