

Futuro Euro FX (EUR/USD)

ACTIVO SUBYACENTE	Cambio EUR / USD
MERCADO	CME
NOMINAL DEL CONTRATO	125.000 EUR
FORMA DE COTIZACION	USD por EUR, con decimales.
FLUCTUACION MINIMA Y VALOR DEL TICK	\$.00005 por euro son 6,25 USD
VENCIMIENTOS	20 vencimientos abiertos a negociación del ciclo trimestral Marzo-Junio-Septiembre-Diciembre. En BBVA Trader sólo se podrán negociar los dos vencimientos más próximos.
FECHA DE VENCIMIENTO Y ÚLTIMO DÍA DE ENTREGA	Tercer miércoles del mes de vencimiento.
ULTIMO DIA DE NEGOCIACION	En el mercado de CME, el último día de negociación será el segundo día hábil anterior al tercer miércoles del mes de vencimiento. Ese día la negociación termina a las 9:16 h (CT:Central Time, U.S.). 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. que 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 Euro FX a 1,0683 con un Precio de Liquidación a final de sesión de 1,073 tendrá la siguiente liquidación: $(1,073 - 1,0683) \times 3 \times 125.000 \text{ EUR} = + 1726,5 \text{ USD}$.
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 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 (<http://www.cmegroup.com>)

Mod. Ficha Futuro FX (EURUSD) _v.10/2017