

Ficheros por servicio SFTP

Datos a efectos de transparencia

Febrero 2024

Cambios realizados en la última revisión

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas en la versión V1.2 respecto de la versión V1.1 de Enero de 2022:

- Fichero Postransparencia. Los campos 'Price' y 'PriceType' pueden no estar informados en caso de que el precio no sea aplicable

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas en la versión V1.3 respecto de la versión V1.2 de Diciembre de 2023:

- Fichero Pretransparencia. Se genera con un solo nivel de precios para RV y Derivados, permanece con 5 niveles de precios para RF

Contenido

Cambios realizados en la última revisión	2
1 Introducción	4
1.1 Alcance.....	4
1.2 Convenciones utilizadas en este documento	4
1.2.1 <i>Definición de ficheros</i>	4
1.2.2 <i>Sintaxis en los ficheros. Tipos de datos</i>	4
1.2.3 <i>Separadores de campos y de registros</i>	5
1.3 Futuras versiones de este documento	6
1.3.1 <i>Nuevos campos</i>	6
1.3.2 <i>Campos eliminados</i>	6
1.3.3 <i>Nuevos ficheros</i>	6
1.3.4 <i>Resaltando cambios</i>	6
2 Datos generales de los ficheros.....	7
2.1 Localización.....	7
2.2 Frecuencia.....	7
2.3 Nomenclatura.....	7
3 Definición de ficheros	8
3.1 Pretransparencia (Renta Fija)	8
3.2 Pretransparencia (Renta Variable y Derivados)	10
3.3 Postransparencia	11

1 Introducción

1.1 Alcance

Este documento tiene como objetivo la descripción técnica de los ficheros de datos con información a efectos de transparencia.

Esta información será suministrada en ficheros planos cuya definición se encuentra más adelante en este documento.

1.2 Convenciones utilizadas en este documento

1.2.1 Definición de ficheros

Para cada fichero contenido en este documento se presenta una tabla que describe el formato y contenido de los campos que componen cada uno de los registros del fichero.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)

(1) - Número de campo dentro del registro.

(2) - Contiene "S" cuando el campo forma parte de la clave del fichero

(3) - Nombre del campo

(4) - Tipo del campo según lo descrito en el siguiente apartado

(5) - Valores válidos o rango de valores

(6) - Descripción del campo

1.2.2 Sintaxis en los ficheros. 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 (ver definición de “String” arriba) que representa una divisa utilizando los valores definidos en la norma ISO 4217 Currency code (3 caracteres).
- **LocalDate y UTCDate:** Fecha local en formato AAAAMMDD.
Valores válidos: AAAA = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31.
- **LocalTime y UTCTime:** Hora local en formato HHMMSS
Valores válidos: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59
- **LongUTCTime:** Hora local en formato HHMMSSXXXXXX
Valores válidos: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59, XXXXXX = 000000-999999

1.2.3 Separadores de campos y de registros

Todos los campos están separados por el carácter punto y coma (“;”).

Todos los registros de cada uno de los ficheros están delimitados por los caracteres CR, LF.

1.3 Futuras versiones de este documento

1.3.1 Nuevos campos

Cualquier nuevo campo 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.

1.3.2 Campos eliminados

Cualquier campo que sea eliminado de un fichero será sustituido por un campo "FILLER" sin contenido, lo que facilitará la compatibilidad entre la versión anterior y la nueva en la que se elimine el campo. En cada caso, se especificará la vigencia de la compatibilidad entre versiones.

1.3.3 Nuevos ficheros

Debe tenerse en cuenta que este documento puede ser modificado en un futuro para incluir nuevos ficheros.

1.3.4 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 de los ficheros

2.1 Localización

Los ficheros están localizados en un servidor SFTP. Existe una carpeta específica para cada segmento de cada mercado. Para acceder a cada carpeta, el usuario debe darse de alta en el servicio.

2.2 Frecuencia

Los ficheros son ubicados en las carpetas a un ritmo de uno por minuto, con un retraso de 15 minutos.

Cada fichero contiene la información relativa a un minuto, en correspondencia con el nombre de del fichero descrito en la nomenclatura. El minuto va desde el segundo 00 hasta el segundo 59, ambos incluidos.

Los ficheros se generan aunque no contengan información.

2.3 Nomenclatura

El nombre externo del fichero se compone como sigue:

prefijo_sg_aaaammdd_hhmm.csv

donde:

- prefijo: Texto fijo que indica el tipo de información que contiene
 - PRE = pretransparencia (precios)
 - POST = postransparencia (negociaciones)
- sg: Es el código de segmento al que corresponde la información
 - Renta Variable: EQ, LT, MA, TF,CW,
 - Renta Fija; RF, SD, AF
 - Derivados: M3, M7, MD
 - Senaf: MV, ML
- aaaammdd: Fecha de la sesión
- hhmm: Hora y minuto en la que se genera el fichero (en UTC). Contiene información de 15 minutos antes.

3 Definición de ficheros

3.1 Pretransparencia (Renta Fija)

#	Clave	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1		MarketSegmentID	String		MIC del segmento
2		SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
3		EntryDate	UTCDate		Fecha del evento (en UTC)
4		EntryTime	UTCTime		Hora del evento (en UTC)
5		Symbol	String(22)		Código de valor
6		SecurityID	String(12)		Código ISIN, cuando se disponga de ISIN
7		IOIID	String(10)		Identificador del RFQ
8		BidPrice1	Price		Precio compra 1
9		BidSize1	Qty		Volumen compra 1
10		BidNumberofOrders1	Int		Número de órdenes compra 1
11		BidPrice2	Price		Precio compra 2
12		BidSize2	Qty		Volumen compra 2
13		BidNumberofOrders2	Int		Número de órdenes compra 2
14		BidPrice3	Price		Precio compra 3
15		BidSize3	Qty		Volumen compra 3
16		BidNumberofOrders3	Int		Número de órdenes compra 3
17		BidPrice4	Price		Precio compra 4
18		BidSize4	Qty		Volumen compra 4
19		BidNumberofOrders4	Int		Número de órdenes compra 4
20		BidPrice5	Price		Precio compra 5
21		BidSize5	Qty		Volumen compra 5
22		BidNumberofOrders5	Int		Número de órdenes compra 5
23		OfferPrice1	Price		Precio venta 1
24		OfferSize1	Qty		Volumen venta 1
25		OfferNumberofOrders1	Int		Número de órdenes venta 1
26		OfferPrice2	Price		Precio venta 2
27		OfferSize2	Qty		Volumen venta 2
28		OfferNumberofOrders2	Int		Número de órdenes venta 2
29		OfferPrice3	Price		Precio venta 3
30		OfferSize3	Qty		Volumen venta 3
31		OfferNumberofOrders3	Int		Número de órdenes venta 3
32		OfferPrice4	Price		Precio venta 4

#	Clave	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
33		OfferSize4	Qty		Volumen venta 4
34		OfferNumberOfOrders4	Int		Número de órdenes venta 4
35		OfferPrice5	Price		Precio venta 5
36		OfferSize5	Qty		Volumen venta 5
37		OfferNumberOfOrders5	Int		Número de órdenes venta 5

3.2 Pretransparencia (Renta Variable y Derivados)

#	Clave	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1		MarketSegmentID	String		MIC del segmento
2		SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
3		EntryDate	UTCDate		Fecha del evento (en UTC)
4		EntryTime	UTCTime		Hora del evento (en UTC)
5		Symbol	String(22)		Código de valor
6		SecurityID	String(12)		Código ISIN, cuando se disponga de ISIN
7		IOIID	String(10)		Identificador del RFQ
8		BidPrice1	Price		Precio compra 1
9		BidSize1	Qty		Volumen compra 1
10		BidNumberofOrders1	Int		Número de órdenes compra 1
11		OfferPrice1	Price		Precio venta 1
12		OfferSize1	Qty		Volumen venta 1
13		OfferNumberofOrders1	Int		Número de órdenes venta 1

3.3 Postransparencia

#	Clave	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	S	MarketSegmentID	String(4)		MIC del segmento
2	S	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
3		ExecutionTimestamp	LongUTCTime		Fecha y hora de negociación (en UTC)
4	S	SecurityIDSource	String(4)	"ISIN"= cuando se disponga de ISIN "OTHR"= otro identificador	Tipo de código de identificación del instrumento
5	S	SecurityID	String(22)		Código de identificación del instrumento. -Código ISIN, cuando se disponga de ISIN -Código de contrato, en otros casos (p.e. estrategias)
6		Price	Price		Precio. Puede no estar informado
7		PriceType	String(4)	"MONE"= Valor monetario "PERC"= Porcentaje "YIEL"= Rendimiento	Notación del precio: Indicación de si el precio se expresa en valor monetario, en porcentaje o en rendimiento. Puede no estar informado
8		PriceCurrency	Currency		Moneda del precio. Aplicable si el precio se expresa como valor monetario
9		UnitOfMeasure	String(3)		Notación de la cantidad de medida: Indicación de las unidades de medida en que se expresa la cantidad en unidad de medida
10		QuantityUnitOfMeasure	Int		La cantidad equivalente de materias primas o derechos de emisión negociados, expresada en unidad de medida
11		Quantity	Qty		El número de unidades del instrumento financiero, o el número de contratos de derivados en la operación
12		NotionalAmount	Amt		Importe notional o importe nominal

#	Clave	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
13		NotionalCurrency	Currency		Moneda en la que se denomina el notional
14		ExecutionVenue	String(4)		MIC del segmento en el que se realizó la operación.
15		PublicationTimestamp	UTCTime		Fecha y hora en que se publicó la operación (en UTC)
16	S	TrdMatchID	String(12)		Número de registro de negociación
17		TrdType	String(2)		Tipo de operación: Se utiliza conjuntamente con TrdSubType para determinar el tipo de operación
18		TrdSubType	String(4)		Subtipo de operación: Se utiliza conjuntamente con TrdType para determinar el tipo de operación
19		TransactionToBeCleared	Char	"N" = NO "Y" = SÍ	Operación objeto de compensación (sólo para derivados)
20		TransparencyFlags	String(20)		Flags de postransparencia

Este material ha sido preparado por Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. (BME) y/o sus filiales (en conjunto, "BME") para el uso exclusivo de las personas a las que a las que BME entrega este material. Este material o cualquiera de sus contenidos no debe interpretarse como un acuerdo vinculante, una recomendación, un consejo de inversión, solicitud, invitación u oferta de compra o venta de información financiera, productos, soluciones o servicios. Dicha información tampoco es un reflejo de posiciones (propias o de terceros) en firme de los intervinientes en el Mercado de Valores Español. BME no tiene ninguna obligación de actualizar, revisar o mantener al día el contenido de este material, y estará sujeto a cambios sin previo aviso en cualquier momento. Ninguna representación, garantía o compromiso -expreso o implícito- es compromiso -expreso o implícito- es o será dado por BME en cuanto a la exactitud, integridad, suficiencia, idoneidad o fiabilidad del contenido de este material.

Al reflejar opiniones teóricas, su contenido es meramente informativo y por tanto no debe ser utilizado para valoración de carteras o patrimonios, ni servir de base para recomendaciones de inversión. Ni las Entidades contribuidoras, ni Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S.A.(BME) ni de ninguna de sus filiales, serán responsables de ninguna pérdida financiera, ni decisión tomada sobre la base de la información contenida en este material. En general, Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. (BME) ni ninguna de sus filiales, ni las Entidades contribuidoras, sus administradores, representantes, asociados, sociedades controladas, directores, socios, empleados o asesores asumen responsabilidad alguna en relación con dicha información, ni de cualquier uso no autorizado del mismo.

Este material es propiedad de BME y no puede ser impreso, copiado, reproducido, publicado, transmitido, divulgado o distribuido de ninguna forma sin el consentimiento previo por escrito de BME.

2023 Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. Todos los derechos reservados.