

**Guía de los informes
publicados por BME**
*Guide on the Reports
Published by BME*

BME Renta Fija

Guía de los informes publicados por BME en relación con la calidad de ejecución de las operaciones acorde al Reglamento Delegado (UE) 2017/575 de la Comisión, de 8 de junio de 2016, por el que se completa la Directiva 2014/65/UE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 15 de mayo de 2014, relativa a los mercados de instrumentos financieros.

Los ficheros: BME_RF_TableX.csv incluyen los instrumentos de los segmentos SEND, MERF, MARF, SBAL, SBIL, XDRF y XNAF. Para una correcta visualización de los datos siga las indicaciones de la Guía de descarga de datos localizada al final del documento.

Guide on the reports published by BME regarding the quality of execution of transactions according to the Commission Delegated Regulation (EU) 2017/575, on June 8th 2016, supplementing Directive 2014/65/EU of the European Parliament and of the Council on markets in financial instruments.

The files: BME_RF_TableX.csv includes the instruments in the SEND, MERF, MARF, SBAL, SBIL, XDRF and XNAF segments. For a correct visualization of the data follow the instructions indicated in the Guía de descarga de datos at the end of the document.

Cuadro 1. Información identificativa que debe publicarse conforme al artículo 3, apartado 1: tipo de centro de ejecución / Table 1. Identification information to be published as referred to in Article 3(1) – type of execution venue	
Nombre del fichero / Name of the file	BME_RF_Table1.csv
C1	Fecha del día de negociación / Date of the trading day
C2	Centro - MIC / Venue - MIC
C3	Segmento de mercado - MIC / Market segment - MIC
C4	Segmento de mercado - LEI / Market segment - LEI
C5	Segmento de mercado - Nombre / Market segment - Name
C6	País de la autoridad competente / Country of competent authority
C7	Interrupciones - Naturaleza / Outages - Nature
C8	Interrupciones - Número / Outages - Number
C9	Interrupciones - Duración media (minutos) / Outages - Average duration (minutes)
C10	Subasta programada - Naturaleza / Scheduled auction - Nature
C11	Subasta programada - Número / Scheduled auction - Number

C12	Subasta programada - Duración media (minutos) / <i>Scheduled auction - Average duration (minutes)</i>
C13	Operaciones fallidas - Número / <i>Failed transactions - Number</i>
C14	Operaciones fallidas - Valor (como % del valor total de operaciones ejecutadas ese día) / <i>Failed transactions - Number (as % of total value of transactions executed on that day)</i>

Cuadro 2. Información identificativa que debe publicarse conforme al artículo 3, apartado 2: tipo de instrumento financiero / Table 2. - <i>identification information to be published as referred to in Article 3(2) - type of financial instrument</i>	
Nombre del fichero / Name of the file	BME_RF_Table2.csv
C1	Centro - MIC / <i>Venue - MIC</i>
C2	Segmento de mercado - MIC / <i>Market segment - MIC</i>
C3	Instrumento financiero - Identificador ISO 6166 / <i>Financial Instrument - Identifier ISO 6166</i>
C4	Fecha del día de negociación / <i>Date of the trading day</i>
C5	Instrumento financiero - Emisor / <i>Financial Instrument - Issuer</i>
C6	Instrumento financiero - Descripción / <i>Financial Instrument - Description</i>
C7	Clasificación del instrumento (Código CFI) / <i>Instrument classification (CFI Code)</i>
C8	Moneda / <i>Currency</i>
C9	Multiplificador / <i>Multiplier</i>
C10	Tipo de cotización (precio /rentabilidad) / <i>Cotization type (Price/Yield)</i>
C11	No aplica / <i>NA</i>
C12	No aplica / <i>NA</i>

Cuadro 3. Información sobre los precios que debe publicarse conforme al artículo 4, letra a)
Table 3. - price information to be published as referred to in Article 4 point (a)

Nombre del fichero / Name of the file	BME_RF_Table3.csv
C1	Fecha del día de negociación / <i>Date of the trading day</i>
C2	Centro - MIC / <i>Venue - MIC</i>
C3	Segmento de mercado - MIC / <i>Market segment - MIC</i>
C4	Instrumento financiero - Identificador ISO 6166 / <i>Financial Instrument - Identifier ISO 6166</i>
C5	Hora UTC / <i>UTC Time</i>
C6	Rango de tamaño / <i>Size range</i>
C7	Promedio simple del precio de ejecución (excluyendo comisiones e intereses devengados) de todas las operaciones ejecutadas en los primeros dos minutos posteriores a la "Hora" / <i>Simple average executed price (excluding commissions and accrued interest) of all trades executed within first two minutes after "Time"</i>
C8	Valor total ejecutado de todas las operaciones ejecutadas en los primeros dos minutos posteriores a la "Hora" (efectivo) / <i>Total value executed of all trades executed within first two minutes after "Time" (turnover)</i>
C9	Precio de la primera operación efectuada después de la "Hora" (si no hay operaciones en los primeros dos minutos posteriores a la "Hora") / <i>Price of the first transaction after "Time" (if no transactions within first two minutes after "Time")</i>
C10	Momento de ejecución de la primera operación efectuada después de la "Hora" (si no hay operaciones en los primeros dos minutos posteriores a la "Hora") / <i>Time of execution of the first transaction after "Time" (if no transactions within first two minutes after "Time")</i>
C11	Tamaño de la primera operación efectuada después de la "Hora" (si no hay operaciones en los primeros dos minutos posteriores a la "Hora") / <i>Size of the first transaction after "Time" (if no transactions within first two minutes after "Time")</i>

C12	<p>Sistema de negociación de la primera operación efectuada después de la "Hora" (si no hay operaciones en los primeros dos minutos posteriores a la "Hora") / <i>Trading system of the first transaction after "Time" (if no transactions within first two minutes after "Time")</i></p> <p>"0": Mercado por órdenes / <i>Continuous Auction</i> "1": Fuera del libro de órdenes / <i>Off-Book</i> "3": Mercado por precios / <i>Quote Driven Market</i> "4": Mercado Dark / <i>Dark Order Book</i> "5": Subastas Periódicas / <i>Periodic Auction</i> "6": Solicitud de cotización / <i>Request for Quote</i></p>
C13	<p>Modo de negociación de la primera operación efectuada después de la "Hora" (si no hay operaciones en los primeros dos minutos posteriores a la "Hora") / <i>Trading mode of the first transaction after "Time" (if no transactions within first two minutes after "Time")</i></p> <p>"1": Operación procedente del mercado abierto / <i>Execution resulting from open market</i></p>
C14	<p>Plataforma de negociación de la primera operación efectuada después de la "Hora" (si no hay operaciones en los primeros dos minutos posteriores a la "Hora") / <i>Plataforma de negociación of the first transaction after "Time" (if no transactions within first two minutes after "Time")</i> "Electronic": Plataforma Electrónica / <i>Electronic trading</i></p>
C15	<p>Mejor precio comprador o precio de referencia en el momento de la primera operación efectuada después de la "Hora" (si no hay operaciones en los primeros dos minutos posteriores a la "Hora") / <i>Best bid or reference price at time of the first transaction after "Time" (if no transactions within first two minutes after "Time")</i></p>
C16	<p>Mejor precio vendedor o precio de referencia en el momento de la primera operación efectuada después de la "Hora" (si no hay operaciones en los primeros dos minutos posteriores a la "Hora") / <i>Best offer or reference price at time of the first transaction after "Time" (if no transactions within first two minutes after "Time")</i></p>

Cuadro 4. Información sobre los precios que debe publicarse conforme al artículo 4, letra b)
Table 4. - price information to be published as referred to in Article 4 point (b)

Nombre del fichero / Name of the file	BME_RF_Table4.csv
C1	Centro - MIC / <i>Venue - MIC</i>
C2	Segmento de mercado - MIC / <i>Market segment - MIC</i>
C3	Fecha del día de negociación / <i>Date of the trading day</i>
C4	Instrumento financiero - Identificador ISO 6166 / <i>Financial Instrument - Identifier ISO 6166</i>
C5	Media simple precio transacción, si ha habido más de una transacción / <i>Simple average transaction Price if more than one transaction</i>
C6	Media simple precio transacción, si ha habido más de una transacción / <i>Volume-weighted transaction Price if more than one transaction</i>
C7	Precio más alto ejecutado, si ha habido más de dos transacciones / <i>Highest executed Price if more than two transactions</i>
C8	Precio más bajo ejecutado, si ha habido más de dos transacciones / <i>Lowest executed Price if more than two transactions</i>
C9	Operaciones / <i>Trades</i>

Cuadro 6. Información sobre la probabilidad de ejecución que debe publicarse conforme al artículo 6
Table 6. - likelihood of execution information to be published as referred to in Article 6

Nombre del fichero / Name of the file	BME_RF_Table6.csv
C1	Fecha del día de negociación / <i>Date of the trading day</i>
C2	Centro - MIC / <i>Venue - MIC</i>
C3	Segmento de mercado - MIC / <i>Market segment - MIC</i>
C4	Instrumento financiero - Identificador ISO 6166 / <i>Financial Instrument - Identifier ISO 6166</i>
C5	Número de órdenes / <i>Number of orders</i>

C6	Número de solicitudes de cotizaciones recibidas / <i>Number of request for quotes received</i>
C7	Número de operaciones ejecutadas / <i>Number of transactions executed</i>
C8	Valor total de las operaciones ejecutadas (nominal) / <i>Total value of transactions executed (nominal)</i>
C9	Número de órdenes canceladas o retiradas / <i>Number of orders cancelled or withdrawn</i>
C10	Número de órdenes modificadas / <i>Number of orders modified</i>
C11	Número de solicitudes de cotizaciones canceladas o retiradas / <i>Number of request for quotes cancelled or withdrawn</i>
C12	Número de solicitudes de cotizaciones modificadas / <i>Number of request for quotes modified</i>
C13	Mediana del tamaño (nominal) de las operaciones / <i>Median transaction size (nominal)</i>
C14	Mediana del tamaño (nominal) de todas las órdenes / <i>Median size of all orders (nominal)</i>
C15	Mediana del tamaño (nominal) de todas las solicitudes de cotización / <i>Median size of all requests for quote (nominal)</i>
C16	Mediana del tamaño (nominal) conjunto de todas las órdenes y solicitudes de cotización / <i>Median size of all orders and requests for quotes (nominal)</i>
C17	Número de creadores de mercado designados / <i>Number of designated market makers</i>

Cuadro 7. Información sobre la probabilidad de ejecución que debe publicarse conforme al artículo 7, apartado 1

Table 7. - *likelihood of execution information to be published as referred to in Article 7 (1)*

Nombre del fichero / Name of the file	BME_RF_Table7.csv
C1	Fecha del día de negociación / <i>Date of the trading day</i>
C2	Centro - MIC / <i>Venue - MIC</i>

C3	Segmento de mercado - MIC / <i>Market segment - MIC</i>
C4	Instrumento financiero - Identificador ISO 6166 / <i>Financial Instrument - Identifier ISO 6166</i>
C5	Hora UTC / <i>UTC Time</i>
C6	Mejor precio comprador / <i>Best bid price</i>
C7	Mejor precio vendedor / <i>Best offer price</i>
C8	Tamaño (nominal) de la oferta de compra / <i>Bid size (nominal)</i>
C9	Tamaño (nominal) de la oferta de venta / <i>Offer size (nominal)</i>
C10	Profundidad (nominal) del libro de órdenes en los 3 mejores precios de compra / <i>Book depth (nominal) within 3 best bid prices</i>
C11	Profundidad (nominal) del libro de órdenes en los 3 mejores precios de venta / <i>Book depth (nominal) within 3 best offer prices</i>

Cuadro 8. Información que debe publicarse conforme al artículo 7, apartados 2 y 3 /
Table 8. - information to be published as referred to in Article 7(2) and 7(3)

Nombre del fichero / <i>Name of the file</i>	BME_RF_Table8.csv
C1	Fecha del día de negociación / <i>Date of the trading day</i>
C2	Centro - MIC / <i>Venue - MIC</i>
C3	Segmento de mercado - MIC / <i>Market segment - MIC</i>
C4	Instrumento financiero - Identificador ISO 6166 / <i>Financial Instrument - Identifier ISO 6166</i>
C5	Diferencial efectivo medio / <i>Average effective spread</i>
C6	Volumen medio (nominal) al mejor precio comprador y vendedor / <i>Average volume at best bid and offer (nominal)</i>
C7	Diferencial medio al mejor precio comprador y vendedor / <i>Average spread at best bid and offer</i>
C8	Número de cancelaciones al mejor precio comprador y vendedor / <i>Number of cancellations at best bid and offer</i>
C9	Número de modificaciones al mejor precio comprador y vendedor / <i>Number of modifications at best bid and offer</i>

C10	Profundidad (nominal) media del libro de órdenes en 3 incrementos de precio / <i>Average book depth (nominal) at 3 price increments</i>
C11	Tiempo medio transcurrido (al microsegundo) entre la recepción por el centro de ejecución de una orden agresiva o aceptación de cotización y la ejecución total o parcial posterior / <i>Mean time elapsed (to the micro-second) between an aggressive order or quote acceptance being received by the execution venue and the subsequent total or partial execution</i>
C12	Mediana de tiempo transcurrido (al microsegundo) entre la recepción por el centro de ejecución de una orden agresiva o aceptación de cotización y la ejecución total o parcial posterior / <i>Median time elapsed (to the micro-second) between an aggressive order or quote acceptance being received by the execution venue and the subsequent total or partial execution</i>
C13	Velocidad media de ejecución de órdenes pasivas no modificadas al mejor precio comprador o vendedor (milisegundos) / <i>Average speed of execution for unmodified passive orders at best bid and offer (milliseconds)</i>
C14	Número de órdenes todo o nada fallidas / <i>Number of Fill or Kill orders that failed</i>
C15	Número de órdenes de ejecutar o anular de las que no se ejecutó ninguna parte / <i>Number of Immediate or Cancel orders that got zero fill</i>
C16	Número de operaciones ejecutadas en el centro de negociación consideradas de gran volumen de conformidad con los artículos 4 o 9 del Reglamento (UE) nº 600/2014 / <i>Number of transactions executed on the trading venue that are Large in Scale pursuant to Article 4 or 9 of Regulation (EU) No 600/2014</i>
C17	Valor (nominal) de las operaciones ejecutadas en el centro de negociación consideradas de gran volumen de conformidad con los artículos 4 o 9 del Reglamento (UE) nº 600/2014 / <i>Value of transactions (nominal) executed on the trading venue that are Large in Scale pursuant to Article 4 or 9 of Regulation (EU) No 600/2014</i>
C18	Número de operaciones ejecutadas en un centro de negociación de conformidad con los artículos 4 o 9 del MIFIR, excluidas las órdenes que no sean de gran volumen y se mantengan, hasta su divulgación, en un instrumento de gestión de órdenes del centro de negociación / <i>Number of transactions that were executed on the trading venue pursuant to Article 4 or 9 of MIFIR, except for orders that are held in an order management facility of the trading venue pending disclosure and not Large in Scale</i>

C19	Valor (nominal) de las operaciones ejecutadas en un centro de negociación de conformidad con los artículos 4 o 9 del MIFIR, excluidas las órdenes que no sean de gran volumen y se mantengan, hasta su divulgación, en un instrumento de gestión de órdenes del centro de negociación / Value of transactions (nominal) that were executed on the trading venue pursuant to Article 4 or 9 of MIFIR, except for orders that are held in an order management facility of the trading venue pending disclosure and not Large in Scale
C20	Número de interrupciones de la negociación / Number of trading interruptions
C21	Promedio de la duración de las interrupciones de la negociación (milisegundos) / Average duration of trading interruptions (milliseconds)
C22	Naturaleza de las suspensiones / Nature of suspensions "S" : Suspendida por la Autoridad Competente / Suspended by the Relevant Authority "I": Interrumpido por el centro de negociación / Interrupted by the Trading Venue
C23	Número de suspensiones / Number of suspensions
C24	Promedio de la duración de las suspensiones (milisegundos)/ Average duration of suspensions (milliseconds)

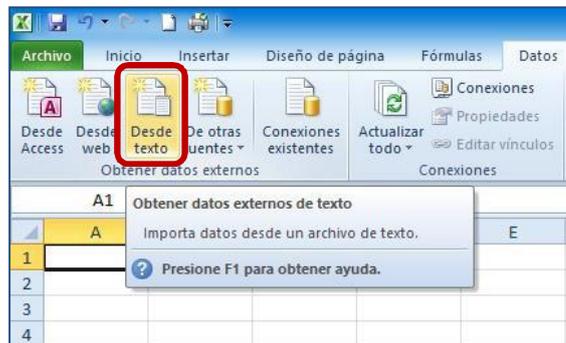
Cuadro 9. Información adicional para los centros de ejecución que utilicen un Sistema de solicitud de cotización (Artículo 8)	
Table 9. - Additional information for request for quote execution venues (Article 8)	
Nombre del fichero / <i>Name of the file</i>	BME_RF_Table9.csv
C1	Fecha del día de negociación / <i>Date of the trading day</i>
C2	Centro - MIC / <i>Venue - MIC</i>
C3	Segmento de mercado - MIC / <i>Market segment - MIC</i>
C4	Instrumento financiero - Identificador ISO 6166 / <i>Financial Instrument - Identifier ISO 6166</i>
C5	Tiempo medio transcurrido (al microsegundo) entre la aceptación y la ejecución de una orden / <i>Mean time elapsed (to the micro-second) between the acceptance of a quote and execution</i>

C6	Mediana de tiempo transcurrido (al microsegundo) entre la aceptación y la ejecución de una orden / <i>Median time elapsed (to the micro-second) between the acceptance of a quote and execution</i>
C7	Tiempo medio transcurrido (al microsegundo) entre la solicitud de cotización y la presentación de las cotizaciones / <i>Mean time elapsed (to the micro-second) between a request for a quote and provision of any corresponding quotes</i>
C8	Mediana de tiempo transcurrido (al microsegundo) entre la solicitud de cotización y la presentación de las cotizaciones / <i>Median time elapsed (to the micro-second) between a request for a quote and provision of any corresponding quotes</i>

Guía de descarga de datos

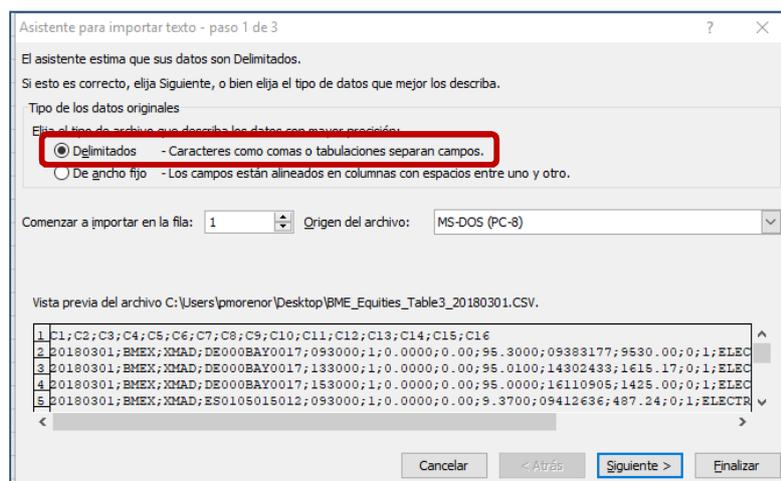
Se debe descargar la carpeta con los datos mensual del segmento de mercado que interese, descomprimiendo las carpetas diarias. Una vez tengamos los archivos CSV en nuestro equipo desde un Excel en blanco procederemos a importa la información:

1. Para ello en el Excel iremos a la pestaña "Datos" y seleccionamos el fichero que queremos importar:

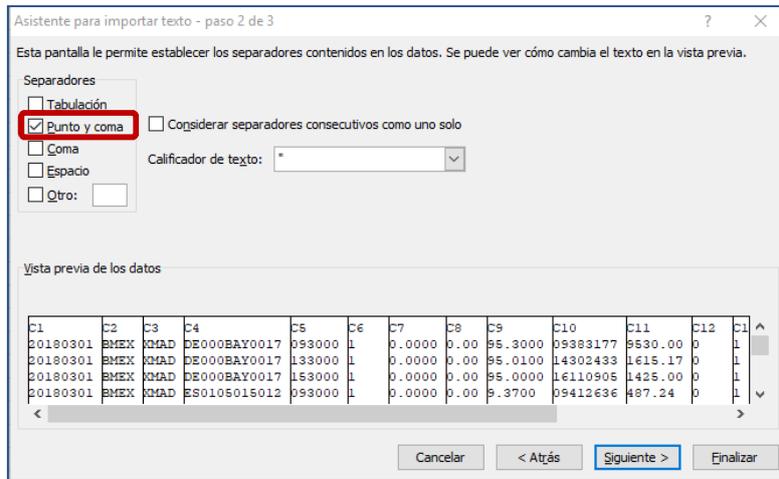


2. A continuación nos aparecerá un pantalla Asistente para importar texto:

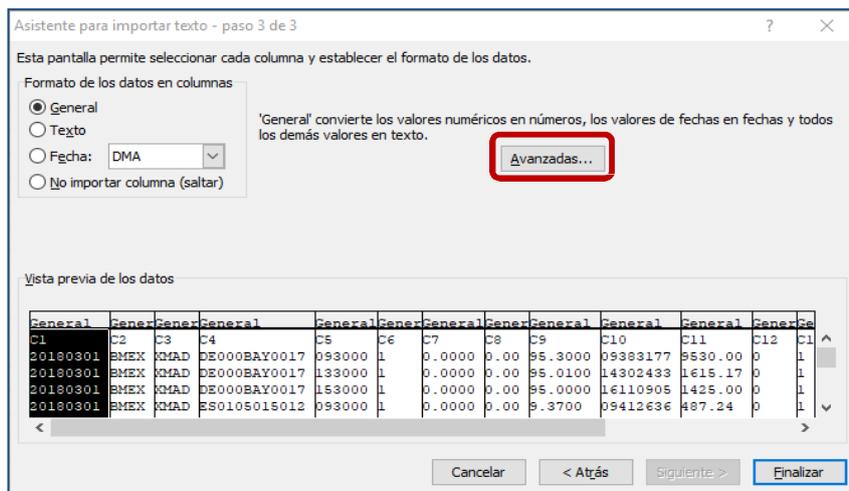
2.1. Asistente para importar texto – paso 1 de 3: indicaremos "Delimitados"



3.1. Asistente para importar texto – paso 2 de 3: Separadores "Punto y coma"

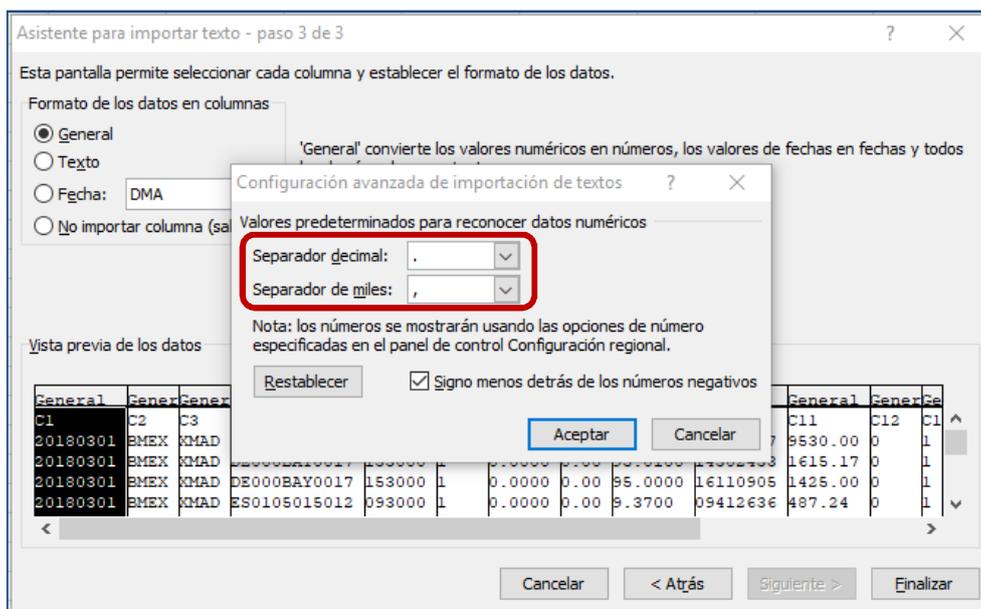


4.1. Asistente para importar texto – paso 3 de 3: Pinchamos en “Avanzadas...”

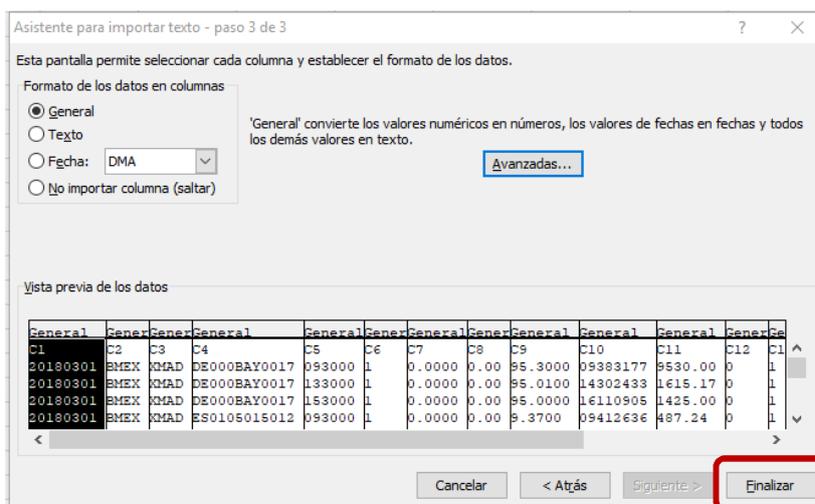


Indicaremos en los valores predeterminados para reconocer datos numéricos:

- Separador decimal: . (punto)
- Separado de miles: , (coma)



Una vez hecho esto, Aceptamos y Finalizamos:



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.

BME
Plaza de la Lealtad,1
Palacio de la Bolsa
28014 Madrid

www.bolsasymercados.es

