

BME Indices Reports Technical Specifications

3600 Product – Fixed Income Indices

Contents

1	OBJECTIVE	3
1.1	FILE AVAILABILITY	3
1.2	CUSTOMER SUPPORT	3
2	FORMAT AND DATA DELIVERY	3
2.1	File Format.....	3
2.2	Data format	4
3	RODE INDICES.....	5
3.1	PUBLIC DEBT INDICES FILE	5
3.2	TRADES FOR CALCULATION OF PUBLIC DEBT INDICES FILE	6
3.3	RODE INDICES TICKER SYMBOLS	7

1 OBJECTIVE

Daily information on fixed income indices (RODE Family of Indices: Public Debt trades Returns) as well as information on trades used for the calculation. The information included in the product is as follows:

- Prices and Yields / IRR of the Public Debt trades IRR Indices.
- Operations necessary for the calculation of the Public Debt trades IRR Indices.

1.1 FILE AVAILABILITY

The files will normally be available between 19:00 and 19:30 CET, and (excluding exceptional circumstances) will always be available before 23:59 CET every trading of the TARGET calendar.

1.2 CUSTOMER SUPPORT

Address	Email	Telephone
Palacio de la Bolsa, Plaza de la Lealtad 1, 28014 - Madrid	marketdata@grupobme.es	+ 34 91 709 58 10

Users have at their disposal a client support service Monday to Friday from 09:00 to 18:30 CET. BME Market Data will keep the Client updated on any modification on the files, as well as on any technical improvements.

2 FORMAT AND DATA DELIVERY

2.1 File Format

BME Market Data provides, for this product, different txt files.

2.2 Data format

2.2.1 Numeric Format

Thousand separations are included. Depending on each file the “.” or “,” will be used as decimal separator.

2.2.2 Date and Time Conventions

Unless stated otherwise, the date fields are in the format YYYYMMDD being YYYY the year, MM the month and DD the day. Time fields are stated following the format HH:MM:SS being HH the hour, MM the minute, SS the second. Dates and times refer to CET (Central European Time).

2.2.3 TXT Headers

The first line of the ASCII files (TXT extensions) contains the headers of the own file, and the other lines contain the data.

2.2.4 Data delivery

The information is available via Internet through a SFTP (SSH File Transfer Protocol).

2.2.5 Files Names

The Files list:

PRODUCT	TYPE	FILE NAME
3600 RODE Indices	Prices and Yields / IRR of the Public Debt trades IRR Indices.	\RODE_Indices_YYYYMMDD.txt
3600 Rode Indices	Necessary Trades for the calculation of the Public Debt trades IRR Indices.	\RODE_Operaciones_Indices_YYYYMMDD.txt

3 RODE INDICES

File list:

PRODUCT	TYPE	FILE NAME
3600 RODE Indices	Prices and Yields / IRR of the Public Debt trades IRR Indices.	RODE_Indices_YYYYMMDD.txt
	Necessary Trades for the calculation of the Public Debt trades IRR Indices.	RODE_Operaciones_Indices_YYYYMMDD.txt
3600 Rode Indices		

3.1 PUBLIC DEBT INDICES FILE

PRODUCT	TYPE	FILE NAME
3600 RODE Indices	Prices and Yields / IRR of the Public Debt trades IRR Indices.	RODE_Indices_YYYYMMDD.txt

The file has the following structure, being the first line the header of the file:

FIELD CODE	LENGTH	DESCRIPTION	VALUES
FECHA	X(08)	INFORMATION DATE	AAAAMMDD
ISIN	X(12)	INDEX ISIN CODE	
NOMBRE	X(40)	INDEX NAME	
IND_TIPOREG	X(1)	REGISTRY TYPE	1 = Public Debt Indices
TICKER	X(5)	TICKER SYMBOL	
TIR	9(18)V9(9)	IRR	
PRECIO	9(18)V9(9)	PRICE	
PERIODO	X(1)	PERIODICITY	M = MONTHLY S = SEMESTER
TIR ANTERIOR	9(18)V9(9)	PREVIOUS IRR	
PRECIO ANTERIOR	9(18)V9(9)	PREVIOUS PRICE	
FECHA ANTERIOR	X(08)	PREVIOUS DATE	AAAAMMDD

DIF TIR	9(18)V9(9)	IRR VARIATION
DIF TIR (%)	9(18)V9(9)	IRR PERCENTAGE VARIATION
DIF PRECIO	9(18)V9(9)	PRICE VARIATION
DIF PRECIO (%)	9(18)V9(9)	PRICE PERCENTAGE VARIATION
IMPORTE NOMINAL	9(18)V9(9)	NOMINAL AMOUNT

Prices, IRR, variations have 3 decimals.

3.2 TRADES FOR CALCULATION OF PUBLIC DEBT INDICES FILE

PRODUCT	TYPE	FILE NAME
3600 Rode Indices	Necessary Trades for the calculation of the Public Debt trades IRR Indices.	RODE_Operaciones_Indices_YYYYMMDD.txt

The file has the following structure, being the first line the header of the file:

FIELD CODE	LENGTH	DESCRIPTION	VALUES
FECHA	X(08)	INFORMATION DATE	YYYYMMDD
ISIN	X(12)	INDEX ISIN CODE	
NOMBRE	X(40)	INDEX NAME	
IND_TIPOREG	X(1)	REGISTRY TYPE	2 = Necessary trades for the calculation of rode indices
TICKER	X(5)	TICKER SYMBOL	
ISIN_EMISION	X(12)	ISSUE ISIN	
FECHA_NEG	X(08)	TRADE DATE	YYYYMMDD
IMPORTE_NOMINAL	9(18)V9(9)	TRADE NOMINAL AMOUNT	
PRECIO	9(18)V9(9)	TRADE PRICE	
TIR	9(18)V9(9)	TRADE TIR	
PLAZO	9(10)	RESIDUAL TERM OF THE ISSUE	

3.3 RODE INDICES TICKER SYMBOLS

3.3.1 RODE DAILY FILES

Daily indices are calculated for each trading session at the end of the day at 19:00.

ISIN	SHORT NAME	TICKER	INDEX NAME
ES0S00001396	Tes_Men_6_M	TM06M	RODE Index <6M (M)
ES0S00001404	Tes_Men_12_M	TM12M	RODE Index 6-12 M (M)
ES0S00001412	Tes_Men_2_A	TM02A	RODE Index 1-2 Y (M)
ES0S00001420	Tes_Men_4_A	TM04A	RODE Index 2-4 Y (M)
ES0S00001438	Tes_Men_6_A	TM06A	RODE Index 2-6 Y (M)
ES0S00001446	Tes_Men_8_A	TM08A	RODE Index 4-8 Y (M)
ES0S00001453	Tes_Men_12_A	TM12A	RODE Index 8-12 Y (M)
ES0S00001461	Tes_Men_20_A	TM20A	RODE Index 12-20 Y (M)
ES0S00001479	Tes_Men_20+A	TM21A	RODE Index >20 Y (M)

3.3.2 RODE MONTHLY FILES

The monthly indices are calculated the M+1 Day at the end of the day at 19:00.

ISIN	SHORT NAME	TICKER	INDEX NAME
ES0S00001487	Tes_Sem_6_M	TS06M	RODE Index <6M (S)
ES0S00001495	Tes_Sem_12_M	TS12M	RODE Index 6-12 M (S)
ES0S00001503	Tes_Sem_2_A	TS02A	RODE Index 1-2 Y (S)
ES0S00001511	Tes_Sem_4_A	TS04A	RODE Index 2-4 Y (S)
ES0S00001529	Tes_Sem_6_A	TS06A	RODE Index 2-6 Y (S)

ES0S00001537	Tes_Sem_8_A	TS08A	RODE Index 4-8 Y (S)
ES0S00001545	Tes_Sem_12_A	TS12A	RODE Index 8-12 Y (S)
ES0S00001552	Tes_Sem_20_A	TS20A	RODE Index 12-20 Y (S)
ES0S00001560	Tes_Sem_20+A	TS21A	RODE Index >20 Y (S)

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 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.

2025 Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. Todos los derechos reservados.