

Ficheros de Datos de Negociación SMART

MEFFStation

06 de marzo de 2024

Cambios realizados en la última revisión

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 27 de junio de 2018):

- Adaptación a las nuevas tablas de codificación consolidadas.
- Nuevos ficheros de traspaso para Operativa de RFQs.
- Cambios relacionados con xRolling sobre acciones:
 - Nuevos campos (26-32) en fichero TCONTRACTS.
 - Nuevos ficheros de Datos Privados de Configuración con límites de operativa xRolling para el Demandante y para el Proveedor de liquidez.
 - Nuevos ficheros de traspaso para Operativa de RFQs sobre xRolling.

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 15 de junio de 2020):

- Fichero TLOGxRFQ1: Se añade el campo Número de operación xRolling. Se eliminan los campos número de orden en Bolsa, Stock Operating MIC y Stock Segment MIC
- Fichero TLOGxRFQ2: Se añaden los campos Número de operación en SIBE y número de operación xRolling
- Ficheros TLIMBKR y TLIMPB: Cambios en las indicaciones del Timing. Se elimina el campo Side, quedando el efectivo máximo de compra y de venta en el mismo registro

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 19 de abril de 2021):

- Adaptación a las nuevas tablas de codificación consolidadas.
- Nuevo fichero de ajustes por eventos corporativos sobre xRolling.
- Ficheros TLOGRFQ1 y TLOGRFQ2: Se elimina el campo RejRsn.
- Ficheros TGENTRADES y TTRADES: el campo Post-TransparencyFlags es utilizado para pre-transparencia y post-transparencia.
- Fichero TADJUSTMENTS: Se añade el campo Fecha Exdate.

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 10 de enero de 2022):

- Nueva vigencia de orden FIX para órdenes GTD (tabla 5)

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 20 de junio de 2022):

- Ficheros TORDERS y TLOGORDERS: Se añade el campo ExpireDate
- Fichero TLOGORDERS: El indicador OpenCloseIndicator indica que la operación abre/cierra el volumen vivo

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 21 de julio de 2022):

- Ficheros TORDERS, TLOGORDERS, TTRADES y TACCOUNTS: Se añade el campo RetailCIFlag

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 10 de marzo de 2023):

- Fichero TTRADES: Cambio en la descripción del campo RetailCIFlag

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 14 de marzo de 2023):

- Adaptación del documento a la nueva plantilla corporativa

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 12 de mayo de 2023):

- Eliminar la referencia a quotes en la introducción de la sección 5

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 26 de junio de 2023):

- Ampliar la descripción de los campos TradeExecID y TrdMatchID en los ficheros TGENTRADES, TLOGORDERS, TTRADES, TLOGxRFQ1 y TLOGxRFQ2

A continuación se detallan las principales modificaciones realizadas respecto de la versión del 6 de julio de 2023):

- Modificar descripción del campo PreviousTradeExecID del fichero TTRADES: no contiene el número de registro de negociación de la operación realizada en Bolsa en las operaciones xRolling.

Contenido

Cambios realizados en la última revisión	2
1 Introducción	5
1.1 Alcance.....	5
1.2 Estructura del documento.....	5
1.3 Convenciones utilizadas en este documento	5
1.3.1 Definición de ficheros.....	5
1.3.2 Sintaxis en los ficheros. Tipos de datos.....	6
1.3.3 Separadores de campos y de registros	7
1.4 Futuras versiones de este documento	7
1.4.1 Nuevos campos	7
1.4.2 Campos eliminados	7
1.4.3 Nuevos ficheros	7
2 Datos Generales	8
2.1 Entornos de negociación.....	8
2.2 Estado	9
2.3 Festivos	10
2.4 Entidades participantes	11
2.5 Subgrupos de contratos	12
2.6 Tipos de contratos.....	13
2.7 Contratos.....	15
2.8 Contratos estado "baja"	18
2.9 Códigos internos de contratos.....	19
2.10 Tipos de operación	20
3 Información Pública Diaria	21
3.1 Información diaria de contratos	21
3.2 Operaciones generales	23
4 Datos Privados de Configuración	25
4.1 Cuentas de posición.....	25
4.2 Límites operativa xRolling para Demandante.....	26
4.3 Límites operativa xRolling para Proveedor de Liquidez	27
4.4 Ajustes por eventos corporativos sobre xRolling.....	28
5 Operativa	29
5.1 Órdenes.....	29
5.2 Log de Órdenes.....	31
5.3 Aplicaciones	33
5.4 Operaciones	36
5.5 Log de RFQs como demandante (modalidad RFQ).....	39
5.6 Log de RFQs como destinatario (modalidad RFQ)	41
5.7 Log de RFQs como demandante de xRolling.....	43
5.8 Log de RFQs como proveedor de liquidez en xRolling	45
6 Apéndice.....	47
6.1 Tabla 1 – Tipos de orden.....	47
6.2 Tabla 2 – Estados de una orden	47
6.3 Tabla 3 – Tipos de Entidad Participante.....	47
6.4 Tabla 4 – Tipos de Orden FIX	48
6.5 Tabla 5 – Vigencia de Orden FIX	48
6.6 Tabla 6 – Tipos de Acción sobre una Orden	48

1 Introducción

1.1 Alcance

Este documento tiene como objetivo la descripción técnica de los ficheros de datos que pueden ser generados desde un terminal de MEFF con funciones de negociación.

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

1.2 Estructura del documento

En el primer capítulo se incluye información genérica sobre este documento.

En los capítulos restantes se definen los ficheros agrupándolos funcionalmente.

Datos generales: características del entorno, grupo de contratos y los contratos.

Información pública diaria: datos públicos resultantes de la operativa de la sesión.

Datos privados de configuración: características de las cuentas

Operativa: datos de las órdenes, aplicaciones introducidas y operaciones realizadas

1.3 Convenciones utilizadas en este documento

1.3.1 Definición de ficheros

Para cada fichero contenido en este documento se presentan dos tablas como las descritas a continuación.

La primera tabla presenta la información genérica del fichero con el siguiente formato:

	(1)
Grupo	(2)
Descripción	(3)
Destinatarios	(4)
Privacidad	(5)
Timing	(6)

(1) - Nombre del fichero tal y como es generado. Todos los ficheros tienen como extensión el código de entorno correspondiente (genéricamente, "mk").

(2) - Grupo al que pertenece el fichero

(3) - Descripción del fichero

(4) - Destinatarios del fichero

(5) - Informa de si el fichero contiene datos públicos o privados

(6) - Informa del momento en que el fichero está disponible, cuándo varía y la forma de actualización de los registros

La segunda tabla 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 * 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

1.3.2 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 **quinque 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).

Ver “Tabla 12 – Currency Codes” en documento “Codification tables”.

- **LocalDate:** Fecha local en formato AAAAMMDD.

Valores válidos: AAAA = 0000-9999, MM = 01-12, DD = 01-31.

- **LocalTime:** Hora local en formato HH:MM:SS

Valores válidos: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59

- **LongLocalTime:** Hora local en formato HH:MM:SS.XXXXXX

Valores válidos: HH = 00-23, MM = 00-59, SS = 00-59, XXXXXX = 000000-999999

1.3.3 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.

1.4 Futuras versiones de este documento

1.4.1 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.

1.4.2 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.

1.4.3 Nuevos ficheros

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

2 Datos Generales

En este grupo se localizan los ficheros de carácter público que definen las características del entorno y los contratos.

2.1 Entornos de negociación

TMARKET.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información genérica del entorno de negociación
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)	Ver Tabla 1 en documento "BME Codification tables"	Código de grupo de contratos
3		ContractGroupDescription	String(75)		Texto descriptivo del grupo de contratos
4		ClearingContractGroup	String(2)		Código del grupo de contratos asociado en el entorno de liquidación

2.2 Estado

TSTATUS.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Estado del conjunto de los ficheros
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, varía una vez finalizada la sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3		FileStatus	char	1: Sesión 2: Fin sesión	Estado de los ficheros

2.3 Festivos

THOLIDAYS.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Calendario de festivos en los que la plataforma de negociación está cerrada
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	HolidayDate	LocalDate		Fecha del festivo

2.4 Entidades participantes

TENTITIES.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información pública de las entidades que intervienen en el grupo de contratos
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	EntityCode	String(4)		Código de la Entidad Participante en el grupo de contrato
4		EntityType	char	Ver Apéndice - Tabla 3	Tipo de la Entidad Participante
5		EntityDescription	String(75)		Nombre de la Entidad Participante
6		EntityECBCode	String(6)		Código de la Entidad Participante en el Banco Central Europeo
7		LEI	String(20)		LEI de la entidad

2.5 Subgrupos de contratos

TCONTRGRP.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Subgrupos de contratos Su contenido es equivalente al de las tablas 5 y 7 del documento "Codification Tables"
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	ContractSubgroupCode	String(2)		Código de subgrupo de contratos
4		ContractSubgroupDescription	String(20)		Descripción del subgrupo de contratos
5		ContractSubgroupUnderlying	String(22)	Ver Tabla 7 en documento "BME Codification tables"	Código de contrato de contado del subgrupo

2.6 Tipos de contratos

TCONTRTYP.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Tipos de contratos
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	ContractSubgroupCode	String(2)	Ver Tabla 5 en documento "BME Codification tables" o contenido de fichero TCONTRGRP.mk	Subgrupo de contrato
4	*	ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato
5		ContractTypeDescription	String(20)		Descripción del tipo de contrato
6		PriceMultiplier	float		Multiplicador que debe aplicarse al precio del contrato
7		Nominal	Amt		Nominal de los contratos de este tipo
8		Currency	Currency	ver Tabla 12 en documento "BME Codification tables"	Divisa en la que se expresa el efectivo de los contratos de este tipo
9		CalcMethod	char	"1"=Black-76 "2"=Binomial	Método de cálculo de precios y volatilidades para los contratos de este tipo
10		CFICode	String(6)	ver Tabla 10 en documento "BME Codification tables"	Codificación de instrumentos financieros según el estándar ISO 10962.
11		ContractFamily	String(5)	ver Tabla 8 en documento "BME Codification tables"	
12		AII/VenueProductCode	String(12)		Identificador AII / Identificador de producto en el mercado

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
13		SecurityType	String(1)	Ver Tabla 6 en documento "BME Codification tables"	Tipo de producto
14		SecuritySubtype	String(6)	Ver Tabla 9 en documento "BME Codification tables"	Tipo de estrategia
15		FlexibleIndicator	String(1)	"Y" - No estándar "N" - Estándar	Para indicar si es estándar o no
16		ExerciseStyle	String(1)	"A"- Americano "E" - Europeo	Tipo de Ejercicio
17		SettMethod	String(1)	"P" - física "C" - cash	Método de liquidación
18		PutorCall	String(1)	"P" - Put "C" - Call	Tipo de opción
19		Periodicity	Strin(1)	"Y" - Anual "S" - Semestral "Q" - Trimestral "M" - Mensual "m" - Balance del mes "K" - Semanal (L-D) "k" - Balance de la semana "B" - Semanal (L-V) "E" - Semanal (S-D) "D" - Diario	
20		AdjustmentsRule	String(1)	"E" - Sólo extraordinarios "T" - Todos	Tipo de ajuste
21		UnitOfMeasure	string(20)		Unidad de medida del multiplicador
22		BaseCurrency	string(3)	ver Tabla 12 en documento "BME Codification tables"	Divisa en la que se expresa el nominal de los contratos de este tipo

2.7 Contratos

TCONTRACTS.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información general de los contratos disponibles en la sesión
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		ContractSubgroupCode	String(2)	Ver Tabla 5 en documento "BME Codification tables" o contenido de fichero TCONTRGRP.Mk	Subgrupo de contrato
5		ContractTypeCode	String(4)		Tipo de contrato
6		StrikePrice	Price		Precio de ejercicio
7		MaturityDate	LocalDate		Fecha de vencimiento
8		TradingStartDate	LocalDate		Fecha de inicio de negociación
9		TradingEndDate	LocalDate		Fecha de fin de negociación
10		TSBuyingContractCode	String(22)		Código del contrato comprador Time Spread (para la orden de compra)
11		TSSellingContractCode	String(22)		Código del contrato vendedor Time Spread (para la orden de compra)
12		TSZeroBase	Price		Base cero para cotización de Time Spread
13		MaturityMonthYear	String(8)	Formatos: YYYYMM YYYYMMDD YYYYMMwW (YYYY=año, MM=mes, DD=día, w="w", W=semana	Identificador del vencimiento.
14		ISINCode	String(12)		Código ISIN del contrato a efectos informativos. Puede no estar presente.
15		StartMaturityMonthYear	LocalDate		Fecha de inicio de entrega (contratos de energía)
16		EndMaturityMonthYear	LocalDate		Fecha de fin de entrega (contratos de energía)
17		AssetClass	Char(4)	COMM:	

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
				commodities CRDT: Credit CURR: currency EQUI: equities INTR: Interest rate EMAL: Emission allowances	
18		Base product	Char(4)	Ver Reglamento Delegado UE 2017/585	Sólo para AssetClass=COMM
19		Sub-product	Char(4)	Ver Reglamento Delegado UE 2017/585	
20		Further subproduct	Char(4)	Ver Reglamento Delegado UE 2017/585	
21		SSTI-pre	Amt		
22		LIS-pre	Amt		
23		SSTI-post	Amt		
24		LIS-post	Amt		
25		VersionNumber	Char		Versión del contrato (0 si no ha sufrido ajustes)
26		ClosingPositionType	String(1)	M: En mercado C: Por comprador V: Por vendedor A: Por ambos	Indica si la posición se podrá cerrar por parte de las contrapartidas en una fecha anterior a la fecha de vencimiento.
27		BuyReferenceRate	String(1)	S: €STR F: FISAnalytics M: Coste de préstamo MEFF 0: Cero '': No aplica	Tipo de referencia financiación en compras En FLEX sólo se informará uno de los dos lados (compras o ventas), el correspondiente a la contrapartida financiada.
28		BuyReferenceRateMarkup	Float	De -100.0000 a 100.0000	Markup sobre tipo de referencia en compras En porcentaje con signo y 4 decimales
29		SellReferenceRate	String(1)	S: €STR F: FISAnalytics M: Coste de préstamo MEFF 0: Cero '': No aplica	Tipo de referencia financiación en ventas En FLEX sólo se informará uno de los dos lados (compras o ventas), el correspondiente a la contrapartida financiada.
30		SellReferenceRateMarkup	Float	De -100.0000 a 100.0000	Markup sobre tipo de referencia en ventas En porcentaje con signo y 4 decimales
31		DividendPercentageApplied	Float	0.00-100.00	Porcentaje flujo de liquidación de dividendos

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
					En porcentaje sin signo y 2 decimales. Se usa para incluir un símil al efecto fiscal, o una parte éste.
32		DividendDateOffset	Int	0-999	Diferencial de fecha de pago/ cobro del flujo de dividendo ordinario 0 indica fecha exdate 999 indica fecha efectiva de pago

2.8 Contratos estado “baja”

TCONTRDEL.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información de contratos dados de baja
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		ISINCode	String(12)		Código ISIN del contrato a efectos informativos. Puede no estar presente.

2.9 Códigos internos de contratos

TCONTRCODES.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Códigos internos de los contratos
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	ContractCode	String(22)		Código de contrato largo
4		ContractInternalCode	String(8)		Código interno de contrato.

2.10 Tipos de operación

TTRADEYTP.mk	
Grupo	Datos Generales
Descripción	Información sobre los tipos de operación tratados en el grupo de contratos
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Estático, no varía durante toda la sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	TradeType	char		Tipo de operación
4		TradeTypeDescription	String(20)		Descripción del tipo de operación

3 Información Pública Diaria

En este grupo se localizan los ficheros de carácter público que contienen los datos diarios resultantes de la operativa de la sesión.

3.1 Información diaria de contratos

TCONTRSTAT.mk	
Grupo	Información Pública Diaria
Descripción	Datos diarios de los contratos en relación a la sesión de negociación
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Estático, sólo está disponible al cierre de sesión.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		HighPrice	Price		Precio alto de la sesión
5		LowPrice	Price		Precio bajo de la sesión
6		FirstPrice	Price		Primer precio de la sesión
7		LastPrice	Price		Último precio de la sesión
8		ClosingPrice	Price		Precio de cierre en la sesión
9		ClosingVolatility	float		Volatilidad de cierre al cierre de la sesión. Este campo no está informado para opciones largas.
10		ClosingDelta	float		Delta de cierre al cierre de la sesión. Este campo no está informado para opciones largas.
11		PreviousDayClosingPrice	Price		Precio de cierre en la sesión anterior. Puede no estar informado, en caso de que sea el primer día de negociación del contrato.
12		PreviousDayClosingVolatility	float		Volatilidad de cierre al cierre de la sesión anterior. Este campo no está informado para opciones largas. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de negociación del contrato.
13		PreviousDayClosingDelta	float		Delta de cierre al cierre de la sesión anterior. Este campo no está informado para opciones largas. Puede no estar informado en caso de que sea el primer día de negociación del contrato.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
14		TotalTrdVolume	Qty		Volumen total negociado
15		NumberOfTrades	int		Número de operaciones negociadas
16		SessionHighBid	Price		Precio de la orden de compra más alta
17		SessionLowOffer	Price		Precio de la orden de venta más baja
18		ForwardPrice	Price		Precio de referencia (forward) para D+1 (solo se informa para contratos de divisa)
19		PreviousDayForwardPrice	Price		Precio de referencia (forward) al cierre de la sesión anterior (solo se informa para contratos con diferimiento)

3.2 Operaciones generales

TGENTRADES.mk	
Grupo	Información Pública Diaria
Descripción	Información pública de todas las operaciones realizadas en la sesión
Destinatarios	Todos los operadores del grupo de contratos
Privacidad	Contiene datos públicos
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	TradeExecID	String(12)		Número de registro de negociación (TVTIC)
4		ContractCode	String(22)		Código de contrato
5		ExecTime	LongLocalTime		Hora de ejecución
6		TradePrice	Price		Precio
7		Quantity	Qty		Volumen
8		TradeType	char		Tipo de operación
9		MarketID	String(4)		Operating MIC
10		MarketSegmentID	String(4)		Segment MIC
11		Market Mechanism	Char	0: Continuous Auction 3: Quote Driven Market. 4: Dark Order Book. 1: Off Book (including Voice or Messaging Trading). 5: Periodic Auction 6: Request for Quotes.	Mecanismo de negociación
12		ISINCode	String(12)		Código ISIN del contrato a efectos informativos. Puede no estar presente.
13		PublishTime	LocalTime		Hora de publicación
14		Post-TransparencyFlags	String(59)	BENC NPFT LRGS ILQD SIZE TPAC	Flags de pretransparencia y posttransparencia, separados por comas.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
				XFPH CANC AMND LMTF FULF DATF FULA VOLO FULV FWAF FULJ IDAF VOLW COAF	
15		PreviousTradeExecID	String(12)		En caso de retrocesión, corrección y en las operaciones de las patas de una estrategia. Para las operaciones correspondientes a patas de una estrategia este campo contiene el Número de Registro de Negociación de la operación en la estrategia.
16		ExecDate	LocalDate		Fecha de ejecución
17		PublishDate	LocalDate		Fecha de publicación

4 Datos Privados de Configuración

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado que detallan las características de la configuración de cuentas de posición.

4.1 Cuentas de posición

TACCOUNTS.mk	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Información de las cuentas de posición disponibles
Destinatarios	Los operadores que tengan acceso a la cuenta de posición
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	TradingMember	String(4)		Miembro Negociador
4	*	Account	String(5)		Cuenta de posición
5		ClearingMember	String(4)		Miembro Compensador
6		FILLER	Char		Antigua clase de la cuenta
7		AccountType	Char	"O"=Ordinaria "D"=Diaria	Tipo de cuenta de posición
8		Active	Char	"S"=Sí "N"=No	Indica si la cuenta de posición está vigente o no
9		AuthEntity	Char		Entidad autorizada a la que pertenece la cuenta de posición
10		PropClient	Char	"P"=Propia "C"=Cliente	
11		RetailCIFlag	Char	S=Sí No informado	Indica si la cuenta es de retail

4.2 Límites operativa xRolling para Demandante

TLIMBKR.mk	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Información de los límites de operativa en xRolling por Proveedor de liquidez, valor y signo
Destinatarios	Los operadores con permiso de operar en xRolling
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	TradingMember	String(4)		Miembro Demandante de xRolling
4	*	LiquidityProvider	String(4)		Código de proveedor de liquidez
5	*	ContractCode	String(22)		Código de contrato xRolling
6		MaxAmountBuy	Amt		Efectivo máximo abierto de compras
7		MaxAmountSell	Amt		Efectivo máximo abierto de ventas
8		ActionDate	LocalDate		Fecha de la última actualización
9		ActionTime	LocalTime		Hora de la última actualización

4.3 Límites operativa xRolling para Proveedor de Liquidez

TLIMPB.mk	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Información de los límites de operativa en xRolling como Proveedor de Liquidez por Demandante de xRolling, valor y signo
Destinatarios	Los operadores con permiso de operar en xRolling
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	TradingMember	String(4)		Miembro que ofrece servicio de proveedor de liquidez
4	*	LiquidityProvider	String(4)		Código de proveedor de liquidez
5	*	CounterpartyMember	String(4)		Miembro demandante de xRolling al que aplican los filtros
6	*	ContractCode	String(22)		Código de contrato xRolling
7		MaxAmountBuy	Amt		Efectivo máximo abierto de compras
8		MaxAmountSell	Amt		Efectivo máximo abierto de ventas
9		ActionDate	LocalDate		Fecha de la última actualización
10		ActionTime	LocalTime		Hora de la última actualización

4.4 Ajustes por eventos corporativos sobre xRolling

TADJUSTMENTS.mk	
Grupo	Datos Privados de Configuración
Descripción	Ratios de ajuste de precio y posición por eventos corporativos sobre xRolling
Destinatarios	Los operadores con permiso de operar en xRolling
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible desde el inicio de sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	ContractCode	String(22)		Código de contrato
4		ExdateDate	LocalDate		Fecha Exdate
5		PriceAdjustmentRatio	Float		Ratio Ajuste precio
6		PositionAdjustmentRatio	Float		Ratio Ajuste posición

5 Operativa

En este grupo se localizan los ficheros de carácter privado que detallan las órdenes y aplicaciones introducidas, así como las operaciones realizadas.

5.1 Órdenes

TORDERS.mk	
Grupo	Operativa
Descripción	Órdenes enviadas por el operador y tratadas por la plataforma. No incluye quotes
Destinatarios	El operador que ha introducido los datos
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse, modificarse o eliminarse registros en cualquier momento.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	OrderWSNumber	int		Número de orden asignado por el terminal
4		OrderNumber	String(12)		Número de orden asignado por el sistema central
5		CIOrderID	String(30)		Identificador de orden FIX
6		ContractCode	String(22)		Código de contrato
7		OrderConfirmTime	LongLocal Time		Hora de aceptación de la orden
8		TradingMember	String(4)		Miembro Negociador
9		TraderID	String(3)		Operador
10		Account	String(5)		Cuenta de posición
11		OrderReference	String(18)		Referencia
12		Price	Price		Precio
13		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
14		InitialQty	Qty		Volumen total
15		OrderType	String(3)	ver Apéndice - Tabla 1	Tipo de la orden
16		PendingQty	Qty		Volumen pendiente
17		OrderDelTime	LongLocal Time		Hora anulación / ejecución total
18		OrderStatus	String(2)	ver Apéndice - Tabla 2	Estado de la orden
19		TriggerPrice	Price		Precio de disparo
20		CancelReason	String(3)	ver Tabla 20 en documento "BME Codification	Motivo de anulación de la orden

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
				tables"	
21		FIXOrderType	char	Ver Apéndice – Tabla 4	Tipo de orden FIX
22		FIXTimeInForce	char	ver Apéndice – Tabla 5	Vigencia de orden FIX
23		DEA	Char	S=SI N=NO blanco	Indicador de cliente con Acceso Directo a Mercado
24		LiquidityProvisionActivity	Char	S=SI N=NO blanco	Indicador de provisión de liquidez
25		TradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched principal A=Any Other Trading Capacity blanco	Capacidad de negociación
26		Self-execution prevention	int		
27		ClientID	int		
28		DecisionID	Int		
29		ExecutionID	int		
30		ExpireDate	LocalDate		Fecha de Vigencia
31		RetailCIFlag	Char	S=Sí blanco	Indica si la orden es de retail

5.2 Log de Órdenes

TLOGORDERS.mk	
Grupo	Operativa
Descripción	Seguimiento de la entrada, modificación, ejecución o cancelación de las órdenes de un operador. No incluye quotes
Destinatarios	El operador que ha introducido los datos
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	Id	int		Identificador del registro
4		ActionType	String(2)	Ver Apéndice - Tabla 6	Tipo de acción realizada sobre la orden
5		ActionTime	LongLocal Time		Hora de la acción
6		TradingMember	String(4)		Miembro Negociador
7		TraderID	String(3)		Operador
8		OrderWSNumber	int		Número de orden asignado por el terminal
9		OrderNumber	String(12)		Número de orden asignado por el sistema central
10		ContractCode	String(22)		Código de contrato
11		OrderConfirmDate	LocalDate		Fecha de aceptación por el host
12		OrderConfirmTime	LongLocal Time		Hora de aceptación por el host
13		Account	String(5)		Cuenta de posición
14		OrderReference	String(18)		Referencia de la orden
15		Price	Price		Precio
16		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
17		InitialQty	Qty		Volumen total
18		OrderType	String(3)	Ver Apéndice - Tabla 1	Tipo de la orden
19		PersistenceType	char	"P"=persistent e "C"=cancelar	Persistencia de la orden en caso de desconexión.
20		PendingQty	Qty		Volumen pendiente
21		OrderDelDate	LocalDate		Fecha anulación / ejecución total
22		OrderDelTime	LongLocal Time		Hora anulación / ejecución total
23		OrderStatus	String(2)	ver Apéndice Tabla 2	Estado de la orden
24		TriggerPrice	Price		Precio de disparo
25		CancelReason	String(3)	ver Tabla 20 en documento	Motivo de anulación de la orden

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
				"BMEGate Codification Tables"	
26		TradeExecId	String(12)		Número de registro de negociación (TVTIC)
27		FIXOrderType	char	Ver Apéndice Tabla 4	Tipo de orden FIX
28		FIXTimeInForce	char	Ver Apéndice Tabla 5	Vigencia de orden FIX
29		CIOrderID	String(10)		Identificador de orden FIX
30		InitiatorMember	String(4)		Miembro que introdujo la operativa
31		InitiatorTrader	String(3)		Operador que introdujo la operativa
32		GiveOutMnemonic	String(10)		Si está cumplimentado, este campo es el mnemotécnico al que se ha asociado un Miembro Destino y una referencia de Give-up
33		GiveUpReference	String(18)		Si está cumplimentado, este campo corresponde a la Referencia Give-up
34		GiveInMember	String(4)		Si está cumplimentado, este campo corresponde al Miembro Destino del Give-Up solicitado
35		GiveOutInternalRef	String(18)		Si está cumplimentado, este campo corresponde a la referencia interna asignada por el Miembro Origen en las peticiones de Give-up
36		OpenCloseIndicator	char	"O"=Abre "C"=Cierra	Indica si la operación resultante abre o cierra el volumen vivo
37		DEA	Char	S=SI N=NO blanco	Indicador de cliente con Acceso Directo a Mercado
38		LiquidityProvisionActivity	Char	S=SI N=NO blanco	Indicador de provisión de liquidez
39		TradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched principal A=Any Other Trading Capacity blanco	Capacidad de negociación
40		Self-execution prevention	int		
41		ClienteID	int		
42		DecisionID	Int		
43		ExecutionID	int		
44		PriorityChange	Char	S=SI N=NO	Indicador de cambio de prioridad
45		ExpireDate	LocalDate		Fecha de Vigencia
46		RetailCIFlag	Char	S=Sí	Indica si la orden es de retail

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
				blanco	

5.3 Aplicaciones

TPARRTRADES.mk	
Grupo	Operativa
Descripción	Estados de las aplicaciones en que el Miembro participa como intermediario
Destinatarios	El operador que ha introducido los datos
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	TransactID	Int		Número de aplicación
4		Broker	String(4)		Código del Miembro Intermediario de la aplicación
5		TraderID	String(3)		Código del operador intermediario
6		BlockReference	String(15)		Referencia de bloque
7		TradeType	char		Tipo de aplicación
8		ContractCode	String(22)		Código de contrato
9		Price	Price		Precio
10		Quantity	Qty		Volumen
11		GrossTradeAmt	Amt		Prima/Efectivo de la operación
12		FlagBroadcast	char		Indicador de si la operación se publica
13		TransactStatus	char	ver Tabla 22 en documento "BMEGate Codification Tables"	
14		RejectReason	int	ver Tabla 21 en documento "BMEGate Codification Tables"	
15		TransactDate	LocalDate		Fecha de Introducción
16		TransactTime	LocalTime		Hora última actualización
17		ValidBuyingMember	char(4)		Código del miembro que valida la compra En caso de operaciones de contado, este campo es distinto de Miembro comprador
18		ValidBuyingTraderID	char(3)		Código del operador que valida la compra
19		BuyingMember	String(4)		Código del Miembro que participa en

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
					la aplicación como comprador. Es el miembro al que pertenece la cuenta
20		BuyingAccount	String(5)		Código de cuenta de posición de la parte compradora
21		BuyingClientCode	String(16)		Código de cliente de la parte compradora. Aplica únicamente en las operaciones de contado
22		BuyingCapacityInd	char	P = Propia A = Ajena	Indicador de capacidad de la parte compradora. Aplica únicamente en las operaciones de contado
23		BuyingReference	String(15)		Referencia de la parte compradora
24		BuyingContactName	String(80)		Nombre de contacto parte compradora
25		BuyingContactPhone	String(20)		Teléfono de contacto parte compradora
26		ValidSellingMember	char(4)		Código del miembro que valida la venta. En caso de operaciones de contado, este campo es distinto de Miembro vendedor
27		ValidSellingTraderID	char(3)		Código del operador que valida la venta
28		SellingMember	String(4)		Código del Miembro que participa en la aplicación como vendedor. Es el miembro al que pertenece la cuenta
29		SellingAccount	String(5)		Código de cuenta de posición de la parte vendedora
30		SellingClientCode	String(16)		Código de cliente de la parte vendedora. Aplica únicamente en las operaciones de contado
31		SellingCapacityInd	char	P = Propia A = Ajena	Indicador de capacidad de la parte vendedora. Aplica únicamente en las operaciones de contado
32		SellingReference	String(15)		Referencia de la parte vendedora
33		SellingContactName	String(80)		Nombre de contacto parte vendedora
34		SellingContactPhone	String(20)		Teléfono de contacto parte vendedora
35		BuyingTradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched principal A=Any Other Trading Capacity blanco	Capacidad de negociación
36		BuyingClientID	int		
37		BuyingDecisionID	Int		
38		BuyingExecutionID	int		
39		SellingTradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched	Capacidad de negociación

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
				principal A=Any Other Trading Capacity blanco	
40		SellingClientID	int		
41		SellingDecisionID	Int		
42		SellingExecutionID	int		

5.4 Operaciones

TTRADES.mk	
Grupo	Operativa
Descripción	Operaciones cruzadas
Destinatarios	Los operadores que tengan acceso a la cuenta
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	TradeExecID	String(12)		Número de registro de negociación (TVTIC)
4	*	Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo
5		TradingMember	String(4)		Miembro Negociador
6		TraderID	String(3)		Operador
7		Account	String(5)		Cuenta de posición
8		ContractCode	String(22)		Código de contrato
9		TradeType	char		Tipo de operación
10		Price	Price		Precio
11		Quantity	Qty		Volumen
12		TradeReference	String(18)		Referencia de la operación Puede ser la referencia asignada a la orden que originó la operación o la asignada por el intermediario de la operación.
13		OrderNumber	String(12)		Número de orden asignado por el sistema central (si la operación procede de una orden o quote).
14		ClOrderID	String(30)		Identificador de orden FIX (si la operación procede de una orden)
15		CrossReqNumber	int		Número de aplicación (si la operación procede de una aplicación)
16		CrossOrderID	String(30)		Identificador de aplicación FIX (si la operación procede de una aplicación)
17		Broker	String(4)		Miembro Intermediario
18		TraderID	String(3)		Operador intermediario
19		ExecTime	LongLocal Time		Hora de ejecución de la operación
20		GrossTradeAmt	Amt		Nominal/Efectivo de la transacción
21		TransactID	int		Número de aplicación o RFQ

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
22		MarketID	String(4)		Operating MIC
23		MarketSegmentID	String(4)		Segment MIC
24		Market Mechanism	Char	0: Continuous Auction 3: Quote Driven Market. 4: Dark Order Book. 1: Off Book (including Voice or Messaging Trading). 5: Periodic Auction 6: Request for Quotes.	Mecanismo de negociación
25		TradingSessionID	Int		Modalidad de contratación
26		ISINCode	String(12)		Código ISIN del contrato a efectos informativos. Puede no estar presente.
27		PublishTime	LocalTime		Hora de publicación
28		Post-TransparencyFlags	String(59)	BENC NPFT LRGS ILQD SIZE TPAC XFPH CANC AMND LMTF DATF VOLO FWAF IDAF VOLW	Flags de pretransparencia y posttransparencia, separados por comas.
29		PreviousTradeExecID	String(12)		En caso de retrocesión, corrección y en las operaciones de las patas de una estrategia. Para las operaciones correspondientes a patas de una estrategia este campo contiene el Número de Registro de Negociación de la operación en la estrategia.
30		DEA	Char	S=SI N=NO blanco	Indicador de cliente con Acceso Directo a Mercado

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
31		LiquidityProvisionActivity	Char	S=SI N=NO blanco	Indicador de provisión de liquidez
32		TradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched principal A=Any Other Trading Capacity blanco	Capacidad de negociación
33		Self-execution prevention	int		
34		ClientID	int		
35		DecisionID	Int		
36		ExecutionID	int		
37		PriorityChange	Char	S=Sí N=No	Indicador de cambio de prioridad
38		RiskReducingIndicator	Char	S=Sí N=No blanco	Para operaciones que reducen riesgo sobre derivados de mercancías
39		Passive/Aggressive	Char	P=Pasivo A=Agresivo ''=N/A	
40		PublishDate	LocalDate		Fecha de publicación
41		RetailCIFlag	Char	S=Sí blanco	Indica si la operación es de retail

5.5 Log de RFQs como demandante (modalidad RFQ)

TLOGRFQ1.mk	
Grupo	Operativa
Descripción	Seguimiento de la entrada, ejecución o cancelación de los RFQs entrados por un miembro.
Destinatarios	Operador con permisos para gestionar RFQs de este tipo
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	xRFQID	Int		Identificador del RFQ
4	*	ConversationID	Int		Identificador de conversación dentro del RFQ
5	*	HistoryNumber	int		Número de historia
6		TradingMember	String(4)		Miembro Negociador
7		TraderID	String(3)		Operador
8		CounterpartyMember	String(4)		Miembro contrapartida
9		CounterpartyTrader	String(3)		Operador contrapartida
10		ValidMember	String(4)		Miembro validador de la pata de contado
11		RequestID	String(10)		Número de petición del operador
12		MatchType	Char	ver Tabla 24 en documento "BMEGate Codification Tables"	Estado de esta conversación RFQ
13		ContractCode	String(22)		Código de contrato
14		Price	Price		Precio del iniciador
15		InitialQty	Qty		Volumen total del iniciador
16		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo del iniciador
17		FirmIndicativeIndicator	Char	S: Firme N: Indicativo	
18		Account	String(5)		Cuenta de posición
19		ClienteID	int		Identificador de cliente
20		DecisionID	Int		Identificador de decisor
21		ExecutionID	int		Identificador de ejecutor
22		TradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched principal A=Any Other Trading Capacity blanco	Capacidad de negociación
23		CashClienteID	int		Para pata de contado

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
24		CashDecisionID	Int		Para pata de contado
25		CashExecutionID	int		Para pata de contado
26		CashTradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched principal A=Any Other Trading Capacity blanco	Para pata de contado
27		BuyPriceOffered	Price		Precio ofrecido por destinatario del RFQ
28		BuyVolumeOffered	Qty		Volumen ofrecido por destinatario RFQ
29		SellPriceOffered	Price		Precio ofrecido por destinatario del RFQ
30		SellVolumeOffered	Qty		Volumen ofrecido por destinatario RFQ
31		TransactTime	LocalTime		Hora última actualización
32		Reference	String(15)		Referencia

5.6 Log de RFQs como destinatario (modalidad RFQ)

TLOGRFQ2.mk	
Grupo	Operativa
Descripción	Seguimiento de la entrada, ejecución o cancelación de los RFQs recibidos por un miembro.
Destinatarios	Operador con permisos para gestionar RFQs de este tipo
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	xRFQID	Int		Identificador del RFQ
4	*	ConversationID	Int		Identificador de conversación dentro del RFQ
5	*	HistoryNumber	int		Número de historia
6		TradingMember	String(4)		Miembro Negociador
7		TraderID	String(3)		Operador
8		CounterpartyMember	String(4)		Miembro contrapartida
9		CounterpartyTrader	String(3)		Operador contrapartida
10		ValidMember	String(4)		Miembro validador de la pata de contado
11		RequestID	String(10)		Número de petición del operador
12		MatchType	Char	ver Tabla 24 en documento "BMEGate Codification Tables"	Estado de esta conversación RFQ
13		ContractCode	String(22)		Código de contrato
14		Price	Price		Precio del iniciador
15		InitialQty	Qty		Volumen total del iniciador
16		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo del iniciador
17		FirmIndicativeIndicator	Char	S: Firme N: Indicativo	
18		Account	String(5)		Cuenta de posición
19		ClienteID	int		Identificador de cliente
20		DecisionID	Int		Identificador de decisor
21		ExecutionID	int		Identificador de ejecutor
22		TradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched principal A=Any Other Trading Capacity blanco	Capacidad de negociación
23		CashClienteID	int		Para pata de contado

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
24		CashDecisionID	Int		Para pata de contado
25		CashExecutionID	int		Para pata de contado
26		CashTradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched principal A=Any Other Trading Capacity blanco	Para pata de contado
27		BuyPriceOffered	Price		Precio ofrecido por destinatario del RFQ
28		BuyVolumeOffered	Qty		Volumen ofrecido por destinatario RFQ
29		SellPriceOffered	Price		Precio ofrecido por destinatario del RFQ
30		SellVolumeOffered	Qty		Volumen ofrecido por destinatario RFQ
31		TransactTime	LocalTime		Hora última actualización
32		Reference	String(15)		Referencia

5.7 Log de RFQs como demandante de xRolling

TLOGxRFQ1.mk	
Grupo	Operativa
Descripción	Seguimiento de la entrada, ejecución o cancelación de los RFQs sobre xRolling entrados por un miembro.
Destinatarios	Operador con permisos para gestionar RFQs de este tipo
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	xRFQID	Int		Identificador del RFQ
4	*	ConversationID	Int		Identificador de conversación dentro del RFQ
5	*	HistoryNumber	int		Número de historia
6		TradingMember	String(4)		Miembro Negociador
7		TraderID	String(3)		Operador
8		xRollingRequester	String(4)		Miembro que realizó la solicitud inicial
9		LiquidityProvider	String(4)		Código de proveedor de liquidez
10		RequestID	String(10)		Número de petición del operador
11		MatchType	Char	ver Tabla 24 en documento "BMEGate Codification Tables"	Estado de esta conversación RFQ
12		ContractCode	String(22)		Código de contrato
13		Price	Price		Precio del iniciador
14		InitialQty	Qty		Volumen del iniciador
15		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo del iniciador
16		PositionEffect	Char	O Open C Close	
17		Account	String(5)		Cuenta de posición
18		ClienteID	int		Identificador de cliente
19		DecisionID	Int		Identificador de decisor
20		ExecutionID	int		Identificador de ejecutor
21		TradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched principal A=Any Other Trading Capacity blanco	Capacidad de negociación
22		TransactTime	LocalTime		Hora última actualización
23		Reference	String(15)		Referencia

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
24		CumQty	Qty		Volumen total ya ejecutado
25		RejRsn	int	ver Tabla 23 en documento "BMEGate Codification Tables"	Motivo de rechazo del RFQ
26		TrdMatchID	String(12)		Número de operación xRolling (TVTIC)

5.8 Log de RFQs como proveedor de liquidez en xRolling

TLOGxRFQ2.mk	
Grupo	Operativa
Descripción	Seguimiento de la entrada, ejecución o cancelación de los RFQs sobre xRolling recibidos por un miembro.
Destinatarios	Operador con permisos para gestionar RFQs de este tipo
Privacidad	Contiene datos privados
Timing	Disponible durante sesión. Dinámico, pueden añadirse nuevos registros en cualquier momento. No se modifican o eliminan registros.

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
1	*	SessionDate	LocalDate		Fecha de sesión
2	*	ContractGroup	String(2)		Código de grupo de contratos
3	*	xRFQID	Int		Identificador del RFQ
4	*	ConversationID	Int		Identificador de conversación dentro del RFQ
5	*	HistoryNumber	int		Número de historia
6		TradingMember	String(4)		Miembro Negociador
7		TraderID	String(3)		Operador
8		xRollingRequester	String(4)		Miembro que realizó la solicitud inicial
9		LiquidityProvider	String(4)		Código de proveedor de liquidez
10		RequestID	String(10)		Número de petición del operador
11		MatchType	Char	ver Tabla 24 en documento "BMEGate Codification Tables"	Estado de esta conversación RFQ
12		ContractCode	String(22)		Código de contrato
13		Price	Price		Precio del iniciador
14		InitialQty	Qty		Volumen total
15		Side	char	"1"=Compra "2"=Venta	Signo del iniciador
16		Account	String(5)		Cuenta de posición
17		ClienteID	int		Identificador de cliente
18		DecisionID	Int		Identificador de decisor
19		ExecutionID	int		Identificador de ejecutor
20		TradingCapacity	Char	D=Dealing on own account M=Matched principal A=Any Other Trading Capacity blanco	Capacidad de negociación
21		TransactTime	LocalTime		Hora última actualización
22		Reference	String(15)		Referencia
23		CumQty	Qty		Volumen total ya ejecutado
24		RejRsn	int	ver Tabla 23 en documento "BMEGate Codification Tables"	Motivo de rechazo del RFQ

#	*	Campo	Tipo	Valores válidos	Descripción
25		StockOperatingMIC	String(4)		MIC del mercado de bolsa donde se ha entrado la orden
26		StockSegmentMIC	String(4)		MIC del mercado de bolsa donde se ha entrado la orden
27		StockOrderNumber	String(12)		Número de orden en Bolsa
28		ExecRefID	String(12)		Número de operación en SIBE
29		TrdMatchID	String(12)		Número de operación xRolling (TVTIC)

6 Apéndice

6.1 Tabla 1 – Tipos de orden

Código	Descripción
AT	Ataque
L	Limitada
LI	Limitada Inmediata
M	Mercado
MM	Market Maker
Q	Quote
SlA	Stop Limitada al alza
SlB	Stop Limitada a la baja
Sub	A precio de subasta
TN	Todo o nada

6.2 Tabla 2 – Estados de una orden

Código	Descripción
AA	Anulada automáticamente (Limitadas Inmediatas, Todo o Nada, Ataque)
AD	Anulada por desconexión
AE	Anulada y ejecutada parcialmente
AO	Anulada por el Operador
E	Ejecutada totalmente
P	Pendiente
PE	Pendiente parcial (se ha ejecutado parte del volumen)
PN	Pendiente de confirmación
PS	Orden Stop pendiente de disparar
R	Rechazada

6.3 Tabla 3 – Tipos de Entidad Participante

Código	Concepto
L	Miembro Compensador
G	Miembro Compensador General
P	Miembro no Compensador Cuenta Propia
N	Miembro no Compensador
D	Cliente Compensador Directo
T	Cliente Compensador Directo Patrocinado
O	Miembro no Compensador Ordinario

6.4 Tabla 4 – Tipos de Orden FIX

Código	Descripción
1	Market
2	Limit
3	Stop
4	Stop Limit

6.5 Tabla 5 – Vigencia de Orden FIX

Código	Descripción
0	Day (default value)
2	At the Opening (OPG)
3	Immediate or Cancel (IOC)
4	Fill or Kill (FOK)
6	Good Till Date (GTD)

6.6 Tabla 6 – Tipos de Acción sobre una Orden

Código	Descripción
AN	Petición de cancelación de la orden
CA	Confirmación de cancelación de la orden
CO	Confirmación de nueva orden
DS	Disparo de orden stop
MO	Petición de modificación de la orden
OE	Orden ejecutada
OM	Confirmación de modificación de la orden
OR	Petición de nueva orden
RA	Rechazo de la petición de una anulación
RM	Rechazo de la petición de una modificación
RJ	Rechazo de la petición de nueva orden

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.

2024 Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. Todos los derechos reservados.