



Indices Renta Fija

Indices Renta Fija 27/04/2021

Índice

1 DESCRIPCIÓN DE LOS PRODUCTOS

- 1.1 HORARIO DEL SERVICIO
- 1.2 ATENCIÓN AL CLIENTE

2 FORMATO Y ENTREGA DE LOS DATOS

- 2.1 Formatos de los ficheros
- 2.2 Formato de los datos

3 INDICES DE RENTA FIJA

- 3.1 FICHERO DE INDICES DE DEUDA PUBLICA
- 3.2 FICHERO DE OPERACIONES DE ÍNDICES DE DEUDA PUBLICA
- 3.3 CODIGOS DE ÍNDICES RODE (Rendimiento de Operaciones de Deuda del Estado)

1 DESCRIPCIÓN DE LOS PRODUCTOS

Información diaria de índices de renta fija (Familia de Índices RODE: Rendimientos Operaciones de Deuda del Estado) así como información de operaciones utilizada para el cálculo. La información incluida en el producto es la siguiente:

- Precios y Rendimientos de los Índices de Rendimiento de operaciones de Deuda del Estado.
- Operaciones necesarias para el cálculo de los Índices de Rendimiento de operaciones de Deuda del Estado.

1.1 HORARIO DEL SERVICIO

Los ficheros estarán disponibles de forma habitual entre las 19:00 y las 19:30 (dependiendo el tipo de producto o dependiendo de cuando sea entregado por el mercado...) CET, como compromiso nunca más tarde de las 23:59 CET todos los días hábiles del calendario TARGET.

1.2 ATENCIÓN AL CLIENTE

Los usuarios tienen a su disposición un servicio de soporte de 09:00 a 18:30 CET de lunes a viernes. BME Market Data mantendrá periódicamente informado al Cliente sobre cualquier modificación en los ficheros, así como cualquier mejora técnica que se produjera.

DIRECCIÓN	EMAIL	TELEFONO
Palacio de la Bolsa Plaza de la Lealtad 1 28014 - Madrid	marketdata@grupobme.es	+ 34 91 709 58 10

2 FORMATO Y ENTREGA DE LOS DATOS

2.1 Formatos de los ficheros

BME MARKET DATA proporciona, para este producto, diferentes ficheros de información txt.

2.2 Formato de los datos

2.2.1 Formatos numéricos

Existe separador de miles ".", dependiendo de cada data se utilizará él "." o la "," como separador decimal, típicamente ",".

2.2.2 Convenios de fecha y hora

Salvo que se diga lo contrario los campos fecha están en formato DD/MM/AAAA siendo DD el día, MM el mes y AAAA el año. Los campos hora estén en formato HH:MM:SS siendo HH la hora, MM el minuto y SS el segundo. Fechas y horas tienen referencia de cálculo CET (Central European Time).

2.2.3 Cabeceras de los ficheros TXT

La primera línea de los ficheros ASCII (extensiones TXT) contiene las cabeceras del mismo, el resto de líneas contienen los datos.

2.2.4 Entrega de los datos

La información es accesible vía Internet mediante el protocolo SFTP (SSH File Transfer Protocol).

2.2.5 Nombre de los ficheros

El listado de ficheros es el siguiente:

PRODUCTO	TIPO	DIARIO
3600 Indices Renta Fija	Familia de Índices RODE: Rendimientos Operaciones de Deuda del Estado	RODE_Indices_AAAAMMDD.txt
3600 Indices Renta Fija	Operaciones para calculo de la Familia de Índices RODE: Rendimientos Operaciones de Deuda del Estado	RODE_Operaciones_Indices_AAAAMMDD.txt

3 INDICES DE RENTA FIJA

Listado de ficheros:

PRODUCTO	TIPO	FICHERO DIARIO
3600 Indices Renta Fija	Familia de Índices RODE: Rendimientos Operaciones de Deuda del Estado	RODE_Indices_AAAAMMDD.txt
3600 Indices Renta Fija	Operaciones para calculo de la Familia de Índices RODE: Rendimientos Operaciones de Deuda del Estado	RODE_Operaciones_Indices_AAAAMMDD.txt

3.1 FICHERO DE INDICES DE DEUDA PUBLICA

PRODUCTO	TIPO	FICHERO DIARIO
3600 Indices Renta Fija	Familia de Índices RODE: Rendimientos Operaciones de Deuda del Estado	RODE_Indices_AAAAMMDD.txt

Tienen la siguiente estructura, siendo la primera línea cabeceras:

CÓDIGO DEL CAMPO	LONGITUD	DESCRIPCIÓN	VALORES
FECHA	X(08)	FECHA DE LA INFORMACIÓN	AAAAMMDD
ISIN	X(12)	CODIGO ISIN DEL INDICE	
NOMBRE	X(40)	NOMBRE DEL INDICE	
IND_TIPOREG	X(1)	TIPO DE REGISTRO	1 = Índices de Deuda Publica
TICKER	X(5)	CLAVE DEL INDICE	
TIR	9(18)V9(9)	TIR DEL INDICE CON SIGNO	
PRECIO	9(18)V9(9)	PRECIO DEL INDICE	
PERIODO	X(1)	PERIODICIDAD DEL INDICE	M = MENSUAL S = SEMESTRAL
TIR ANTERIOR	9(18)V9(9)	TIR ANTERIOR DEL INDICE CON SIGNO	
PRECIO ANTERIOR	9(18)V9(9)	PRECIO ANTERIOR DEL INDICE	
FECHA ANTERIOR	X(08)	FECHA ANTERIOR DE LA INFORMACIÓN	AAAAMMDD
DIF TIR	9(18)V9(9)	VARIACIÓN DE LA TIR	
DIF TIR (%)	9(18)V9(9)	VARIACIÓN PORCENTUAL DE LA TIR	
DIF PRECIO	9(18)V9(9)	VARIACIÓN DEL PRECIO	
DIF PRECIO (%)	9(18)V9(9)	VARIACIÓN PORCENTUAL DEL PRECIO	
IMPORTE NOMINAL	9(18)V9(9)	IMPORTE NOMINAL	

Precios, tires, variaciones se ofrecen con 3 decimales.

3.2 FICHERO DE OPERACIONES DE ÍNDICES DE DEUDA PUBLICA

PRODUCTO	TIPO	FICHERO DIARIO
3600 Indices Renta Fija	Operaciones para calculo de la Familia de Índices RODE: Rendimientos Operaciones de Deuda del Estado	RODE_Operaciones_Indices_AAAAMMDD.txt

Tienen la siguiente estructura, siendo la primera línea cabeceras:

CÓDIGO DEL CAMPO	LONGITUD	DESCRIPCIÓN	VALORES
FECHA	X(08)	FECHA DE LA INFORMACIÓN	AAAAMMDD
ISIN	X(12)	CODIGO ISIN DEL INDICE	
NOMBRE	X(40)	NOMBRE DEL INDICE	
IND_TIPOREG	X(1)	TIPO DE REGISTRO	2 = Operaciones que computan en el cálculo de Índices
TICKER	X(5)	CLAVE DEL INDICE	
ISIN_EMISION	X(12)	CODIGO ISIN DE LA EMISION	
FECHA_NEG	X(08)	FECHA DE LA OPERACIÓN	AAAAMMDD
IMPORTE_NOMINAL	9(18)V9(9)	IMPORTE NOMINAL DE LA OPERACIÓN	
PRECIO	9(18)V9(9)	PRECIO DE LA OPERACIÓN	
TIR	9(18)V9(9)	TIR DE LA OPERACIÓN INCLUYENDO SIGNO	
PLAZO	9(10)	PLAZO RESIDUAL DE LA EMISIÓN	

3.3 CODIGOS DE ÍNDICES RODE (Rendimiento de Operaciones de Deuda del Estado)

3.3.1 INDICES RODE DIARIOS

Los índices diarios se calculan en cada sesión bursátil a fin de día a las 19:00.

CÓDIGO ISIN	IDENTIFICADOR	NOMBRE CORTO SIBE	ÍNDICE	FAMILIA
ES0S00001396	TM06M	Tes_Men_6_M	Índice Deuda Publica hasta 6 Meses (M)	7
ES0S00001404	TM12M	Tes_Men_12_M	Índice Deuda Publica de 6 a 12 Meses (M)	7
ES0S00001412	TM02A	Tes_Men_2_A	Índice Deuda Publica de 1 a 2 años (M)	7
ES0S00001420	TM04A	Tes_Men_4_A	Índice Deuda Publica de 2 a 4 años (M)	7
ES0S00001438	TM06A	Tes_Men_6_A	Índice Deuda Publica de 2 a 6 años (M)	7
ES0S00001446	TM08A	Tes_Men_8_A	Índice Deuda Publica de 4 a 8 años (M)	7

ES0S00001453	TM12A	Tes_Men_12_A	Índice Deuda Publica de 8 a 12 años (M)	7
ES0S00001461	TM20A	Tes_Men_20_A	Índice Deuda Publica de 12 a 20 años (M)	7
ES0S00001479	TM21A	Tes_Men_20+A	Índice Deuda Publica más de 20 años (M)	7

3.3.2 INDICES RODE MENSUALES

Los índices mensuales se calculan en la primera sesión hábil de cada mes a fin de día a las 19:00.

CÓDIGO ISIN	IDENTIFICADOR	NOMBRE CORTO SIBE	ÍNDICE	FAMILIA
ES0S00001487	TS06M	Tes_Sem_6_M	Índice Deuda Publica hasta 6 Meses (S)	7
ES0S00001495	TS12M	Tes_Sem_12_M	Índice Deuda Publica de 6 a 12 Meses (S)	7
ES0S00001503	TS02A	Tes_Sem_2_A	Índice Deuda Publica de 1 a 2 años (S)	7
ES0S00001511	TS04A	Tes_Sem_4_A	Índice Deuda Publica de 2 a 4 años (S)	7
ES0S00001529	TS06A	Tes_Sem_6_A	Índice Deuda Publica de 2 a 6 años (S)	7
ES0S00001537	TS08A	Tes_Sem_8_A	Índice Deuda Publica de 4 a 8 años (S)	7
ES0S00001545	TS12A	Tes_Sem_12_A	Índice Deuda Publica de 8 a 12 años (S)	7
ES0S00001552	TS20A	Tes_Sem_20_A	Índice Deuda Publica de 12 a 20 años (S)	7
ES0S00001560	TS21A	Tes_Sem_20+A	Índice Deuda Publica más de 20 años (S)	7

Tramontana, 2 bis
28231 Las Rozas (Madrid)
www.bmemarketdata.es
www.bmerf.es

Plaza de la Lealtad,1
Palacio de la Bolsa
28014 Madrid
www.bolsasymercados.es

