



Especificaciones Técnicas Ficheros
**Cierre Precios, Volúmenes,
Mejor Posición**

Índice

1 DESCRIPCIÓN DEL PRODUCTO	4
1.1 HORARIO DEL SERVICIO	4
1.2 ATENCIÓN AL CLIENTE	4
2 FORMATO Y ENTREGA DE LOS DATOS.....	5
2.1 FORMATOS DE LOS FICHEROS.....	5
2.2 FORMATO DE LOS DATOS	5
2.2.1 Formatos numéricos	5
2.2.2 Convenios de fecha y hora	5
2.2.3 Cabeceras de los ficheros TXT	5
2.2.4 Entrega de los datos	6
2.2.5 Nombre de los ficheros.....	6
3 RENTA VARIABLE.....	8
3.1 PRECIOS_VOLÚMENES_MEJOR POSICION_RV.....	8
3.2 PRECIOS_VOLÚMENES_MEJOR_POSICION SICAVS	9
4 ETFS.....	12
5 WARRANTS	14
6 OPCIONES Y FUTUROS	16
6.1 PVBBO_M3_AAAAMMDD.TXT / PVBBO_M7_AAAAMMDD.TXT	16
6.2 FICHEROS MFII_PVBBO_M*.TXT	18

7 RENTA FIJA.....	20
7.1 SENAF PRECIOS Y VOLÚMENES.....	20
7.2 PRECIOS, VOLÚMENES Y MEJOR POSICION DE MERF, MARF Y SEND	21
7.3 ANEXO. TIPOS DE ACTIVOS.....	23
8 FONDOS NO COTIZADOS.....	25

1 Descripción del producto

El producto de precios y volúmenes al cierre está compuesto por las siguientes estructuras de ficheros:

- RENTA VARIABLE
- ETFs
- WARRANTS
- OPCIONES Y FUTUROS
- RENTA FIJA
- FONDOS NO COTIZADOS

En cada fichero habrá un registro por instrumento y día con los datos más relevantes.

1.1 HORARIO DEL SERVICIO

Los ficheros estarán disponibles de forma habitual a partir de las 20:00 CET, como compromiso nunca más tarde de las 23:59 CET todos los días hábiles del calendario bursátil oficial.

1.2 ATENCIÓN AL CLIENTE

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

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.

2 Formato y entrega de los datos

2.1 FORMATOS DE LOS FICHEROS

BME MARKET DATA proporciona, para este producto en ficheros con formato TXT (“;” como separador de campos y “.” o “,” Como separador decimal). Este formato es compatible tanto con base de datos como con hojas de cálculo. Cada campo del fichero está separado del siguiente por “;” y cada línea finaliza con un carácter específico de fin de línea.

2.2 FORMATO DE LOS DATOS

2.2.1 Formatos numéricos

No existe separador de miles, dependiendo de cada fichero se utilizará él “.” o la “,” como separador decimal.

2.2.2 Convenios de fecha y hora

Salvo que se diga lo contrario los campos fecha están en formato AAAAMMDD siendo AAAA el año, MM el mes y DD el día. Los campos hora estén en formato HHMMSS o HHMMSSXXX siendo HH la hora, MM el minuto, SS el segundo y XXX milésimas de 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 o similares) contiene las cabeceras del mismo, el resto de líneas contienen los datos.

PRODUCTO	FICHERO TXT
RENTA VARIABLE	Coincide con código de campo

MERCADO CONTINUO	Coincide con código de campo
IBEX35®	Coincide con código de campo
LATIBEX	Coincide con código de campo
MAB	Coincide con código de campo
ETFs	Coincide con código de campo
WARRANTS	Coincide con código de campo
MEFF OPCIONES Y FUTUROS RENTA VARIABLE	Coincide con código de campo
MEFF OPCIONES Y FUTUROS ENERGIA	Coincide con código de campo
SENAF	Sin cabeceras
MERF	Coincide con código de campo
SEND	Coincide con código de campo
MARF	Coincide con código de campo
FONDOS NO COTIZADOS	Coincide con código de campo

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

Nombre de los ficheros por producto y tipo:

PRODUCTO

DIARIOS

RENTA VARIABLE	RV_PV_MP_AAAAMMDD.TXT SICAV_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
MERCADO CONTINUO	MC_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
IBEX35®	IBX_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
LATIBEX	LTX_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
MAB/SICAVS	MA_PV_MP_AAAAMMDD.TXT MAB_PV_MP_AAAAMMDD.TXT SICAV_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
ETFS	ETF_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
WARRANTS	WAR_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
OPCIONES Y FUTUROS MEFF RENTA VARIABLE	PVBBO_M3_AAAAMMDD.TXT MFII_PVBBO_M3_AAAAMMDD.TXT
OPCIONES Y FUTUROS MEFF ENERGIA	PVBBO_M7_AAAAMMDD.TXT MFII_PVBBO_M7_AAAAMMDD.TXT
SENAF	pr_senaf_precios_neg_AAAAMMDDHHMMSS_mdataAAAAMMDD.zip
AF, RF, SD	RFBME_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
MERF	MERF_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
MARF	MARF_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
SEND	SEND_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
FONDOS NO COTIZADOS	FNC_VLI_AAAAMMDD.TXT

3 Renta Variable

PRECIOS_VOLUMENES_RV	(SIB) Ficheros para Mercado Continuo (incluyendo corro electrónico, IBEX35®, LATIBEX, MAB. LTX_PV_MP_AAAAMMDD.txt, MA_PV_MP_AAAAMMDD.txt, MC_PV_MP_AAAAMMDD.txt, RV_PV_MP_AAAAMMDD.txt
PRECIOS_VOLUMENES_SICAVS	(SIB) Fichero con información de precios, volúmenes y valor liquidativo de todas las Sicavs disponibles en BME. SICAV_PV_MP_AAAAMMDD.TXT & MAB_PV_MP_AAAAMMDD.TXT

3.1 PRECIOS_VOLÚMENES_MEJOR POSICION_RV

Ficheros con datos de precios, volúmenes y mejor posición al cierre para Mercado Continuo (valores del), corro electrónico, IBEX35® (valores del), LATIBEX (valores del), MAB (IBX_PV_MP_AAAAMMDD.txt, LTX_PV_MP_AAAAMMDD.txt, MA_PV_MP_AAAAMMDD.txt, MC_PV_MP_AAAAMMDD.txt, RV_PV_MP_AAAAMMDD.txt) siguiendo este patrón de campos:

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
RV	MERCADO	X(5)	MERCADO PRINCIPAL DEL VALOR	EQ = Renta Variable TF = ETF CW = Warrants MA = MAB LT = Latibex
RV	CODISIN	X(12)	CODIGO ISIN DEL VALOR	Los 2 primeros caracteres son el código del país. Los 9 siguientes contienen el código nacional de identificación del valor para cada país. Ultimo carácter es el dígito de control.
RV	FECHA	X(8)	FECHA DE LA SESIÓN	AAAAMMDD
RV	VALOR	X(5)	CÓDIGO DEL VALOR	
RV	NOMCOMPLETO	X(80)	NOMBRE COMPLETO DEL VALOR	
RV	NOMRED	X(12)	NOMBRE REDUCIDO DEL VALOR	
RV	PRECIOREF	9(12)V9(6)	PRECIO DE REFERENCIA	

RV	PRECIOCIANT	9(12)V9(6)	PRECIO DE CIERRE DE LA SESIÓN ANTERIOR
RV	PRECIOCI	9(12)V9(6)	PRECIO DE CIERRE
RV	PRECIOMAX	9(12)V9(6)	PRECIO MÁXIMO
RV	PRECIOMIN	9(12)V9(6)	PRECIO MÍNIMO
RV	PRECIOMED	9(12)V9(6)	PRECIO MEDIO
RV	PRECIOAPER	9(12)V9(6)	PRECIO A LA APERTURA
RV	OPERACIONES	9(18)	NÚMERO DE OPERACIONES REALIZADAS EN EL DÍA
RV	EFFECTIVO	9(17)V9(6)	EFFECTIVO MOVIDO EN EL DÍA
RV	TITULOS	9(18)	VOLUMEN MOVIDO EN EL DÍA
RV	N_O_PRE_COMP	9(5)	NUMERO DE ORDENES AL MEJOR PRECIO DE COMPRA
RV	VOLUMEN_COMP	9(11)	VOLUMEN DE LA MEJOR COMPRA
RV	PRECIO_COMP	9(12)V9(6)	PRECIO DE LA MEJOR COMPRA
RV	VOLUMEN_VENT	9(12)V9(6)	PRECIO DE LA MEJOR VENTA
RV	PRECIO_VENT	9(11)	VOLUMEN DE LA MEJOR VENTA
RV	N_O_PRE_VENT	9(5)	NUMERO DE ORDENES AL MEJOR PRECIO DE VENTA

3.2 PRECIOS_VOLÚMENES_MEJOR_POSICION SICAVS

Ficheros (SICAV_PV_MP_YYYYMMDD.TXT & MAB_PV_MP_YYYYMMDD.TXT) con datos de Precios, Volúmenes y Mejor Posición al Cierre para todas las Sicavs (dando el valor de cierre) siguiendo este patrón de campos:

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
-------------	------------	-------	-------------	----------------------------

SICAV, MA	MERCADO	X(5)	MERCADO PRINCIPAL DEL VALOR	EQ = Renta Variable TF = ETF CW = Warrants MA = MAB LT = Latibex
SICAV, MA	CODISIN	X(12)	CODIGO ISIN DEL VALOR	Los 2 primeros caracteres son el código del país. Los 9 siguientes contienen el código nacional de identificación del valor para cada país. Ultimo carácter es el dígito de control
SICAV, MA	FECHA	X(8)	FECHA DE LA SESIÓN EN FORMATO	AAAAMMDD
SICAV, MA	VALOR	X(5)	CÓDIGO DEL VALOR	
SICAV, MA	NOMCOMPLETO	X(80)	NOMBRE COMPLETO DEL VALOR	
SICAV, MA	NOMRED	X(12)	NOMBRE REDUCIDO DEL VALOR	
SICAV, MA	PRECIOREF	9(12)V9(6)	PRECIO DE REFERENCIA	
SICAV, MA	PRECIOCIEANT	9(12)V9(6)	PRECIO DE CIERRE DE LA SESIÓN ANTERIOR	
SICAV, MA	PRECIOCIE	9(12)V9(6)	PRECIO DE CIERRE	
SICAV, MA	PRECIOMAX	9(12)V9(6)	PRECIO MÁXIMO	
SICAV, MA	PRECIOMIN	9(12)V9(6)	PRECIO MÍNIMO	
SICAV, MA	PRECIOMED	9(12)V9(6)	PRECIO MEDIO	
SICAV, MA	PRECIOAPER	9(12)V9(6)	PRECIO A LA APERTURA	
SICAV, MA	OPERACIONES	9(18)	NÚMERO DE OPERACIONES REALIZADAS EN EL DÍA	
SICAV, MA	EFFECTIVO	9(17)V9(6)	EFFECTIVO MOVIDO EN EL DÍA	
SICAV, MA	TITULOS	9(18)	VOLUMEN MOVIDO EN EL DÍA	
SICAV, MA	GESTORA	X(20)	NOMBRE DE LA GESTORA DE LA SICAV	
SICAV, MA	PRODUCTO	X(2)	TIPO DE PRODUCTO	"I" SICAV
SICAV, MA	FECHA V-L	X(8)	FECHA DEL VALOR LIQUIDATIVO	AAAAMMDD
SICAV, MA	VALOR_LIQUIDATIVO	9(12)V9(6)	VALOR LIQUIDATIVO, CON DECIMALES	

SICAV, MA	PATRIMONIO	9(17)V9(6)	PATRIMONIO, CON DECIMALES	
SICAV, MA	NUM_PARTICIPES	9(9)	NUMERO DE PARTÍCIPES	
SICAV, MA	VOLUMEN_COMP	9(11)	VOLUMEN DE LA MEJOR COMPRA	SICAV
SICAV, MA	PRECIO_COMP	9(12)V9(6)	PRECIO DE LA MEJOR COMPRA	SICAV
SICAV, MA	VOLUMEN_VENT	9(11)	VOLUMEN DE LA MEJOR VENTA	SICAV
SICAV, MA	PRECIO_VENT	9(12)V9(6)	PRECIO DE LA MEJOR VENTA	SICAV

4 ETFS

Ficheros ETF_PV_MP_YYYYMMDD.txt con datos de Precios, Volúmenes y Mejor Posición al Cierre para todos los ETFs siguiendo este patrón de campos siguiente.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
ETF	MERCADO	X(5)	MERCADO PRINCIPAL DEL VALOR	EQ = Renta Variable TF = ETF CW = Warrants MA = MAB LT = Latibex
ETF	CODISIN	X(12)	CODIGO ISIN DEL VALOR	Los 2 primeros caracteres son el código del país. Los 9 siguientes contienen el código nacional de identificación del valor para cada país. Ultimo carácter es el dígito de control
ETF	FECHA	X(8)	FECHA DE LA SESIÓN	AAAAMMDD
ETF	VALOR	X(5)	CÓDIGO DEL VALOR	
ETF	NOMCOMPLETO	X(80)	NOMBRE COMPLETO DEL VALOR	
ETF	NOMRED	X(12)	NOMBRE REDUCIDO DEL VALOR	
ETF	PRECIOREF	9(12)V9(6)	PRECIO DE REFERENCIA	
ETF	PRECIOCIANT	9(12)V9(6)	PRECIO DE CIERRE DE LA SESIÓN ANTERIOR	
ETF	PRECIOCI	9(12)V9(6)	PRECIO DE CIERRE	
ETF	PRECIOMAX	9(12)V9(6)	PRECIO MÁXIMO	
ETF	PRECIOMIN	9(12)V9(6)	PRECIO MÍNIMO	
ETF	PRECIOMED	9(12)V9(6)	PRECIO MEDIO	
ETF	PRECIOAPER	9(12)V9(6)	PRECIO A LA APERTURA	
ETF	OPERACIONES	9(18)	NÚMERO DE OPERACIONES REALIZADAS EN EL DÍA	
ETF	EFFECTIVO	9(17)V9(6)	EFFECTIVO MOVIDO EN EL DÍA	

ETF	TITULOS	9(18)	VOLUMEN MOVIDO EN EL DÍA
ETF	N_O_PRE_COMP	9(5)	NUMERO DE ORDENES DE COMPRA AL MEJOR PRECIO DE COMPRA
ETF	VOLUMEN_COMP	9(11)	VOLUMEN DE LA MEJOR COMPRA
ETF	PRECIO_COMP	9(12)V9(6)	PRECIO DE LA MEJOR COMPRA
ETF	VOLUMEN_VENT	9(12)V9(6)	PRECIO DE LA MEJOR VENTA
ETF	PRECIO_VENT	9(11)	VOLUMEN DE LA MEJOR VENTA
ETF	N_O_PRE_VENT	9(5)	NUMERO DE ORDENES DE VENTA AL MEJOR PRECIO DE VENTA
ETF	PVALLIQ	9(12)V9(6)	VALOR LIQUIDATIVO
ETF	FECVALLIQ	X(8)	FECHA VALOR LIQUIDATIVO

5 Warrants

Ficheros con datos de Precios, Volúmenes y Mejor Posición al Cierre para todos los Warrants siguiendo este patrón de campos siguiente.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
CW	MERCADO	X(5)	MERCADO PRINCIPAL DEL VALOR	"CW" - Warrants
CW	CODISIN	X(12)	CODIGO ISIN DEL VALOR	Los 2 primeros caracteres son el código del país. Los 9 siguientes contienen el código nacional de identificación del valor para cada país. Ultimo carácter es el dígito de control
CW	FECHA	X(8)	FECHA DE LA SESIÓN EN FORMATO AAAAMMDD	AAAAMMDD
CW	WVALOR	X(5)	CÓDIGO DEL VALOR	
CW	NOMBRE80	X(80)	NOMBRE COMPLETO DEL VALOR	
CW	NOMRED	X(12)	NOMBRE REDUCIDO DEL VALOR	
CW	PRECIOREF	9(12)V9(6)	PRECIO DE REFERENCIA	
CW	PRECIOANT	9(12)V9(6)	PRECIO DE CIERRE DE LA SESIÓN ANTERIOR	
CW	PRECIOCI	9(12)V9(6)	PRECIO DE CIERRE	
CW	PRECIOMAX	9(12)V9(6)	PRECIO MÁXIMO	
CW	PRECIOMIN	9(12)V9(6)	PRECIO MÍNIMO	
CW	PRECIOMED	9(12)V9(6)	PRECIO MEDIO	
CW	PRECIOAPE	9(12)V9(6)	PRECIO A LA APERTURA	
CW	OPERACIONES	9(18)	NÚMERO DE OPERACIONES REALIZADAS EN EL DÍA	
CW	EFFECTIVO	9(17)V9(6)	EFFECTIVO MOVIDO EN EL DÍA	
CW	TITULOS	9(18)	VOLUMEN MOVIDO EN EL DÍA	
CW	N_O_PRE_COMP	9(5)	NÚMERO DE ÓRDENES AL MEJOR PRECIO DE LA COMPRA	

CW	VOLUMEN_COMP	9(11)	VOLUMEN DE LA MEJOR COMPRA
CW	PRECIO_COMP	9(12)V9(6)	PRECIO DE LA MEJOR COMPRA
CW	VOLUMEN_VENT	9(12)V9(6)	PRECIO DE LA MEJOR VENTA
CW	PRECIO_VENT	9(11)	VOLUMEN DE LA MEJOR VENTA
CW	N_O_PRE_VENT	9(5)	NÚMERO DE ÓRDENES AL MEJOR PRECIO DE LA VENTA

6 Opciones y Futuros

Listado de ficheros:

CODIGO MIC	SEGMENTO	PRODUCTO	TIPO FICHERO	FICHERO
XMRV	FINANCIERO – M3	2200, 2240	PRECIOS DE CIERRE PARA EL MERCADO M3	PVBBO_M3_AAAAMMDD.TXT MFII_PVBBO_M3_AAAAMMDD.TXT
XMPW	ENERGIA – M7	2200, 2240	PRECIOS DE CIERRE PARA EL MERCADO M7	PVBBO_M7_AAAAMMDD.TXT MFII_PVBBO_M7_AAAAMMDD.TXT

6.1 [PVBBO_M3_AAAAMMDD.TXT / PVBBO_M7_AAAAMMDD.TXT](#)

Información general de los cierre de opciones y futuros de la sesión. Datos diarios de los contratos en relación a la sesión de negociación.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
M3, M7	Fecha. SessionDate	X(8)	Fecha de sesión	AAAAMMDD
M3, M7	Valor	X(22)	Código de contrato	
M3, M7	DELTA ANTERIOR	9(15)V9(6)	Delta de cierre al cierre de la sesión anterior.	Este campo no está informado para opciones largas.
M3, M7	PRECIO CIERRE ANTERIOR	9(15)V9(6)	Precio de cierre de la sesión anterior	
M3, M7	DELTA	9(15)V9(6)	Delta de cierre al cierre de la sesión.	Este campo no está informado para opciones largas.
M3, M7	PRECIO CIERRE	9(15)V9(6)	Precio de cierre de la sesión	
M3, M7	PRECIO MAXIMO	9(15)V9(6)	Precio máximo de la sesión	
M3, M7	PRECIO MINIMO	9(15)V9(6)	Precio mínimo de la sesión	
M3, M7	PRECIO MEDIO	9(15)V9(6)	Precio medio al cierre de la sesión	
M3, M7	PRECIO APERTURA	9(15)V9(6)	Primer precio de la sesión	

M3, M7	VOLATILIDAD	9(15)V9(6)	Volatilidad de cierre al cierre de la sesión.	Este campo no está informado para opciones largas.
M3, M7	VOLATILIDAD ANTERIOR	9(15)V9(6)	Volatilidad de cierre al cierre de la sesión anterior.	Este campo no está informado para opciones largas.
M3, M7	VOLUMEN ACUMULADO	9(15)	Volumen Acumulado	
M3, M7	EFFECTIVO ACUMULADO	9(17)V9(2)	Efectivo Acumulado	
M3, M7	VOLUMEN COMPRA	9(15)	Volumen de contratos a la compra	
M3, M7	PRECIO COMPRA	9(15)V9(6)	Precio de compra	
M3, M7	PRECIO VENTA	9(15)V9(6)	Precio de venta	
M3, M7	VOLUMEN VENTA	9(15)	Volumen de contratos a la venta	
M3, M7	ORIGEN	X(2)	Código de grupo de contratos, segmento origen de negociación	M3 MEFF – Financiero M7 MEFF - Power

FECHA;VALOR;DELTA ANTERIOR;PRECIO CIERRE ANTERIOR;DELTA;PRECIO CIERRE;PRECIO MAXIMO;PRECIO MINIMO;PRECIO MEDIO;PRECIO APERTURA;VOLATILIDAD;VOLATILIDAD ANTERIOR;VOLUMEN ACUMULADO;EFFECTIVO ACUMULADO;VOLUMEN COMPRA;PRECIO COMPRA;PRECIO VENTA;VOLUMEN VENTA;ORIGEN

20170120;CA3TAM 800F17
;1.0000;2.5800;1.0000;2.5700;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;34.5900;33.8600;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3

20170120;CA3TAM 800G17
;1.0000;2.5800;1.0000;2.5700;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;27.5300;27.6800;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3

20170120;CA3TAM 800H17
;0.9900;2.5800;1.0000;2.5700;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;27.9600;28.2300;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3

20170120;CA3TAM 800H18
;0.9000;2.7000;0.9000;2.6800;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;28.7900;29.1800;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3

20170120;CA3TAM 800H19
;0.8700;2.7600;0.8700;2.7500;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;30.1500;30.3600;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3

20170120;CA3TAM 800M17
;0.9600;2.6200;0.9600;2.6000;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;26.8100;27.1600;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3

20170120;CA3TAM 800M18
;0.8800;2.7300;0.8800;2.7100;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;28.9900;29.3100;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3

20170120;CA3TAM ;0.8700;2.7500;0.8700;2.7400;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;30.3900;30.5700;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3	800M19
20170120;CA3TAM ;0.9400;2.6400;0.9400;2.6200;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;27.2500;27.7800;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3	800U17
20170120;CA3TAM ;0.8800;2.7400;0.8800;2.7200;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;29.5300;29.7900;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3	800U18
20170120;CA3TAM ;0.9100;2.6800;0.9200;2.6600;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;28.7700;29.2700;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3	800Z17
20170120;CA3TAM ;0.8800;2.7400;0.8800;2.7300;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;29.9000;30.1200;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3	800Z18
20170120;CA3TAM ;1.0000;2.3300;1.0000;2.3200;0.0000;0.0000;0.0000;0.0000;34.1600;33.4300;0;0.00;0;0.0000;0.0000;0;M3	825F17

6.2 FICHEROS MFII_PVBBO_M*.TXT

Información general de los cierre de opciones y futuros de la sesión. Datos diarios de los contratos en relación a la sesión de negociación.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
M3, M7	Fecha. Session Date	X(8)	Fecha de sesión	AAAAMMDD
M3, M7	Valor	X(22)	Código de contrato	
M3, M7	DELTA ANTERIOR	9(15)V9(6)	Delta de cierre al cierre de la sesión anterior.	Este campo no está informado para opciones largas.
M3, M7	PRECIO CIERRE ANTERIOR	9(15)V9(6)	Precio de cierre de la sesión anterior	
M3, M7	DELTA	9(15)V9(6)	Delta de cierre al cierre de la sesión.	Este campo no está informado para opciones largas.
M3, M7	PRECIO CIERRE	9(15)V9(6)	Precio de cierre de la sesión	
M3, M7	PRECIO MAXIMO	9(15)V9(6)	Precio máximo de la sesión	
M3, M7	PRECIO MINIMO	9(15)V9(6)	Precio mínimo de la sesión	

M3, M7	PRECIO MEDIO	9(15)V9(6)	Precio medio al cierre de la sesión	
M3, M7	PRECIO APERTURA	9(15)V9(6)	Primer precio de la sesión	
M3, M7	VOLATILIDAD	9(15)V9(6)	Volatilidad de cierre al cierre de la sesión.	Este campo no está informado para opciones largas.
M3, M7	VOLATILIDAD ANTERIOR	9(15)V9(6)	Volatilidad de cierre al cierre de la sesión anterior.	Este campo no está informado para opciones largas.
M3, M7	VOLUMEN ACUMULADO	9(15)	Volumen Acumulado	
M3, M7	EFFECTIVO ACUMULADO	9(17)V9(2)	Efectivo Acumulado	
M3, M7	VOLUMEN COMPRA	9(15)	Volumen de contratos a la compra	
M3, M7	PRECIO COMPRA	9(15)V9(6)	Precio de compra	
M3, M7	PRECIO VENTA	9(15)V9(6)	Precio de venta	
M3, M7	VOLUMEN VENTA	9(15)	Volumen de contratos a la venta	
M3, M7	ORIGEN	X(2)	Código de grupo de contratos, segmento origen de negociación	M3 MEFF – Financiero M7 MEFF - Power
M3, M7	CodIsin	X(12)	Codigo ISIN	
M3, M7	HoraMKTD	X(6)	Hora MKTD	HHMMSS
M3, M7	EstimadoPrecioMedioBuy	9(21)V9(11)	Precio medio estimado de compra	
M3, M7	EstimadoPrecioMedioSell	9(21)V9(11)	Precio medio estimado de venta	
M3, M7	VolRFQ_Buy	9(21)V9(11)	Volumen RFQ Compra	
M3, M7	VolRFQ_Sell	9(21)V9(11)	Volumen RFW Venta	
M3, M7	MkdID	X(4)	Market ID	
M3, M7	MkdSegID	X(4)	Market Segment ID	

7 Renta Fija

Precios de Cierre y mejor posición (donde disponible) de todas las emisiones de AIAF, SENAF, MERF, MARF, SEND.

PRODUCTO	DIARIOS
RENTA FIJA SENAF	pr_senaf_precios_neg_AAAAMMDDHHMMSS_mdataAAAAMMDD.zip
MERF + MARF + SEND	RFBME_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
RENTA FIJA MERF	RF_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
RENTA FIJA MARF	AF_PV_MP_AAAAMMDD.TXT
RENTA FIJA SEND	SD_PV_MP_AAAAMMDD.TXT

7.1 SENAF PRECIOS Y VOLÚMENES

Fichero pr_senaf_precios_neg_AAAAMMDDHHMMSS_mdataAAAAMMDD.zip de precios y volúmenes de Cierre de todas las emisiones que solo cotizan en SENAF. Los campos incluidos en el fichero son los siguientes:

TIPO ACTIVO	CÓD. DEL CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
SENAF	FECHA_SESION	X(25)	FECHA DE LA SESIÓN	AAAA-MM-DDTHH:MM:SS+02:00
SENAF	CODIGO_MERCADO_SENAF	X(12)	CODIGO DE MERCADO SENAF	Vencimiento Simultáneas Letras Bonos
SENAF	CODIGO_ISIN	X(12)	CÓDIGO ISIN	Los 2 primeros caracteres son el código del país. Los 9 siguientes contienen el código nacional de identificación del valor para cada país. Último carácter es el dígito de control
SENAF	NOMBRE_ACTIVADO	X(60)	NOMBRE EMISIÓN	

SENAF	MAX_PRE	9(4)V9(3)	PRECIO MÁXIMO DE LA SESIÓN	
SENAF	MAX_TIR	S9(4)V9(3)	TIR MÁXIMA DE LA SESIÓN	Se incluye signo.
SENAF	MED_PRE	9(4)V9(3)	PRECIO MEDIO DE LA SESIÓN	
SENAF	MED_TIR	S9(4)V9(3)	TIR MEDIA DE LA SESIÓN	Se incluye signo.
SENAF	MIN_PRE	9(4)V9(3)	PRECIO MÍNIMO DE LA SESION	
SENAF	MIN_TIR	S9(4)V9(3)	TIR MÍNIMA DE LA SESION	Se incluye signo.

7.2 PRECIOS, VOLÚMENES Y MEJOR POSICION DE MERF, MARF Y SEND

Ficheros con datos de precios, volúmenes y mejor posición al cierre para todos los valores de MERF, MARF, SEND:

- RFBME_PV_MP_AAAAMMDD.TXT (todos los segmentos)
- RF_PV_MP_AAAAMMDD.TXT (segmento MERF)
- AF_PV_MP_AAAAMMDD.TXT (segmento MARF)
- SD_PV_MP_AAAAMMDD.TXT (segmento SEND)

Siguiendo este patrón de campos:

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
MERF, MARF, SEND	FECHA	X(8)	FECHA DE LA SESIÓN EN FORMATO	AAAAMMDD
MERF, MARF, SEND	COD-ISIN	X(12)	CODIGO ISIN DEL VALOR	Los 2 primeros caracteres son el código del país. Los 9 siguientes contienen el código nacional de identificación del valor para cada país. Ultimo carácter es el dígito de control
MERF, MARF, SEND	VALOR	X(6)	INDENTIFICADOR SIB DEL VALOR	
MERF, MARF, SEND	NOMBRE	X(80)	NOMBRE DE LA EMISION	TIPO EMISION

				CÓDIGO DE LA EMISORA TIPO DE INTERES DE LA EMISIÓN FECHA DE VENCIMIENTO
MERF, MARF, SEND	IND_PrecioTipo	X(1)	Tipo de cotizacion	1: Cotiza por Precio 9: Cotiza por TIR
MERF, MARF, SEND	Referencia	S9(21)V9(11)	Referencia de la sesión (precio o tir)	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	CierreAnt	S9(21)V9(11)	Cierre Anterior (precio o tir)	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	CIERRE	S9(21)V9(11)	Cierre (precio o tir)	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	Maximo	S9(21)V9(11)	(precio o tir) MÁXIMO DE LA SESIÓN	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	Minimo	S9(21)V9(11)	(precio o tir) MÍNIMO DE LA SESIÓN	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	MEDIO	S9(21)V9(11)	Valor MEDIO (precio o tir)	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	Apertura	S9(21)V9(11)	Apertura (precio o tir)	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	MaxAnual	S9(21)V9(11)	(precio o tir) MÁXIMO ANUAL	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	FechaMaxAnual	X(8)	FECHA DEL (precio o tir) MÁXIMO ANUAL	AAAAMMDD
MERF, MARF, SEND	MinAnual	S9(21)V9(11)	(precio o tir) MINIMO ANUAL	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	FechaMinAnual	X(8)	FECHA DEL (precio o tir) MINIMO ANUAL	AAAAMMDD
MERF, MARF, SEND	VOLUMEN_ACUM	9(19)V9(6)	VOLUMEN ACUMULADO	
MERF, MARF, SEND	EFFECTIVO_ACUM	9(19)V9(6)	EFFECTIVO ACUMULADO	
MERF, MARF, SEND	Volumen_comp	9(19)V9(6)	Volumen a la compra (cierre)	
MERF, MARF, SEND	Precio_comp	S9(21)V9(11)	(Precio o tir) a la compra (cierre)	
MERF, MARF, SEND	Precio_vent	S9(21)V9(11)	(Precio o tir) a la venta (cierre)	
MERF, MARF, SEND	Volumen_vent	9(19)V9(6)	Volumen a la venta (cierre) (cierre)	
MERF, MARF, SEND	Precio	S9(21)V9(11)	PRECIO	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	Yield	S9(21)V9(11)	YIELD / Rendimiento	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	MaxPermitido	S9(21)V9(11)	(precio o tir) MÁXIMOPERMITIDO EN LA SESIÓN	Se incluye signo.

MERF, MARF, SEND	MinPermitido	S9(21)V9(11)	(precio o tir) MINIMO PERMITIDO EN LA SESIÓN	Se incluye signo.
MERF, MARF, SEND	ORIGEN	X(2)	ORIGIN	RF = MERF SD = Send AF = MARF
MERF, MARF, SEND	VolAcumMulti	9(19)V9(6)	Volumen acumulado en las operaciones multilaterales	

7.3 ANEXO. TIPOS DE ACTIVOS

Segmento	Grupo de valores	Descripción
RF	CR	MERF: Renta Fija Privada
	DA	MERF: Deuda Autonómica y otros Emisores Públicos
	DC	Deuda Bolsa de Barcelona
	DV	Deuda Bolsa de Valencia
	DB	Deuda Bolsa de Bilbao
SD	CP	AIAF: Renta Fija Privada
	DE	AIAF: Deuda del Estado, Tesoro Público
AF	MA	Renta Fija Privada MARF

Código	Descripción
A	Iberclear – CADE

CompID	SubID	Descripción
MERF	RF	Mercado Electrónico de Renta Fija: Renta Fija Bursátil
SEND	SD	Sistema Electrónico de Negociación de Deuda (SEND)
MARF	AF	Mercado Alternativo de Renta Fija

Tipo de producto	Descripción
BO	Bonos y Obligaciones
BC	Bonos y Obligaciones Convertibles
PS	Principales segregados
CA	Cupones segregados
LT	Letras del Tesoro
PG	Pagarés
CD	Cédulas
TZ	Titulizaciones
PP	Participaciones Preferentes

Tipo de producto	Descripción
BO	Bonos y Obligaciones
BC	Bonos y Obligaciones Convertibles
PS	Principales segregados
CA	Cupones segregados
LT	Letras del Tesoro
PG	Pagarés
CD	Cédulas
TZ	Titulizaciones
PP	Participaciones Preferentes

8 Fondos no cotizados

Ficheros con datos de valores liquidativos para los fondos no cotizados siguiendo este patrón de campos.

TIPO ACTIVO	CÓD. CAMPO	LONG.	DESCRIPCIÓN	FORMATO / VALORES POSIBLES
FNC	FECHA	X(8)	FECHA DE SESIÓN	AAAAMMDD
FNC	COD_ISIN	X(12)	CÓDIGO ISIN DEL FONDO	Los 2 primeros caracteres son el código del país. Los 9 siguientes contienen el código nacional de identificación del valor para cada país. Ultimo carácter es el dígito de control
FNC	HORA	X(6)	HORA DE LA INFORMACION	HHMMSS
FNC	VALOR_LIQUIDATIVO	9(12)V9(6)	VALOR LIQUIDATIVO, CON DECIMALES	
FNC	FECHA_VALOR_LIQ	X(8)	FECHA DEL VALOR LIQUIDATIVO	AAAAMMDD
FNC	NOMBRE_VALOR	X(80)	NOMBRE COMPLETO DEL VALOR	
FNC	GRUPO_VAL	X(2)	GRUPO VALOR	NC = No Cotizado
FNC	TIPO_PROD	X(1)	TIPO PRODUCTO	F = Fondo
FNC	PARTICIPES	9(9)	NUMERO DE PARTÍCIPES	
FNC	IMP_CIRCULACION	9(17)V9(6)	IMPORTE EN CIRCULACION, CON DECIMALES	
FNC	GESTORA	X(20)	NOMBRE DE LA GESTORA DE LA SICAV	
FNC	ORIGEN	X(2)	ORIGEN	"EQ " - Mercado Continuo / Corro Electrónico "MA" - MAB "LT"- Mercado de Latibex "TF" - Fondos de Inversión Cotizados (ETF) "CW" - Warrants y Estructurados