

BME APA Services

Especificaciones Técnicas

Producto 9000

Contenido

1 OBJETIVO	4
1.1 Horario del Servicio	4
1.2 Atención al cliente	4
2 FORMATO Y ENTREGA DE LOS DATOS	4
2.1 Formatos de los ficheros	4
2.2 Formato de los datos	5
3 MENSAJE APA	6
3.1 Trade Report Message (Full Details)	6
3.2 Trade Report Message (Limited Details)	8
3.3 Trade Report Message (Trade Aggregations)	10
3.4 SYSTEMATIC INTERNALISERS QUOTES	11

CONTROL DE EDICIONES

Edición	Fecha	Autor
1.00	18/04/2011	BME Market Data

CONTROL DE DIFUSIÓN

Este Documento no se distribuye en soporte de papel.

CONTROL DE MODIFICACIONES POR CAMBIO DE EDICIÓN

- 1.00 18.03.2011 – Documento de nueva creación.
- 1.01 02.08.2024 – Actualización plantilla

1 Objetivo

Ficheros diarios al cierre (20:30) con los mensajes de negociaciones y posiciones asociados al APA de BME.

1.1 Horario del Servicio

Los ficheros estarán disponibles de forma habitual a partir de las 20:30 CET todos los días hábiles del calendario Bursátil oficial.

1.2 Atención al cliente

Dirección	Email	Teléfono
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 la información de actividad de intermediarios de los diferentes mercados de BME en ficheros con formato txt, json ("," como separador de campos y "." 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. Messages are enclosed in curly brackets ({ }). The file contains multiple messages in a sequential way (one after another). Each message may represent a Trade Report or Quote message.

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. Los formatos de los datos son:

- DATE TIME: Timestamps expressed in nanoseconds since 1.1.1970.
- CHAR: One alphanumeric character.
- STRING(N): Up to n alphanumeric characters.
- DECIMAL: Decimal number expressed in exponent and mantissa format.
- INTEGER: Integer number.
- BOOLEAN: True or false indicator.

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 HHMMSSXX siendo HH la hora, MM el minuto, SS el segundo y XX centésimas de segundo. Fechas y horas tienen referencia de cálculo CET (Central European Time).

2.2.3 Entrega de los datos

La información es accesible vía Internet mediante el protocolo sftp (secure file transfer protocol).

2.2.4 Nombre de los ficheros

Los nombres de los ficheros:

- BMEA_YYYYMMDD.json (fichero diario)
- BMEA_YYYYMM.json (fichero mensual)

Los mensajes incluidos en estos ficheros:

1. Trade Report Message Full Details Negociaciones
2. Trade Report Message Limited Details Negociaciones
3. Trade Report Message Trade Aggregations Negociaciones
4. Systematic Internalisers Quotes Posiciones

3 MENSAJE APA

Tipos de mensajes incluidos en los fichros diarios y mensuales:

- Trade Report Message (Full Details)
- Trade Report Message (Limited Details)
- Trade Report Message (Trade Aggregations)
- Systematic Internalisers (Quotes)

3.1 Trade Report Message (Full Details)

TIPO ACTIVO	CÓDIGO DEL CAMPO	REQUERIDO	FORMATO	DESCRIPCION
TODOS	last_trade_time	M	DATE TIME	Date and Time when the trade was executed.
TODOS	instrument_id_code	M	CHAR	Instrument identification code type (I=ISIN, O=OTHR).
TODOS	instrument_id	M	STRING(40)	ISIN (or other identifier) of the instrument.
TODOS	last_trade	O	DECIMAL	Price of the instrument within a reported trade. Up to 20 numerical digits with a decimal separator.
TODOS	pending_price_indicator	O	CHAR	Indicator showing that a price is pending.

TIPO ACTIVO	CÓDIGO DEL CAMPO	REQUERIDO	FORMATO	DESCRIPCION
TODOS	execution_venue_id	O	STRING(4)	Identification of the MIC for which the trade was reported (XOFF or SINT)
TODOS	quotation_type	M	INTEGER	Price Notation
TODOS	currency	O	STRING(3)	Identifies currency used for price (ISO 4217).
TODOS	last_qty	O	DECIMAL	Number of units of the financial instrument of the trade report. Up to 20 numerical digits with a decimal separator. No negative values.
TODOS	qty_unit	O	STRING(25)	Notation of the quantity in measurement unit
TODOS	quantity_in_measurement_unit	O	DECIMAL	Quantity in measurement units
TODOS	nominal_amount	O	DECIMAL	Notional amount
TODOS	settlement_currency	O	STRING(3)	Notional currency
TODOS	distribution_date_time	M	DATE TIME	Publication date and time.
TODOS	trans_id_code	O	STRING (52)	Unique ID (TIC) assigned by the MIFID II engine when a trade entry is reported.
TODOS	venue_id	O	STRING	Venue of publication
TODOS	clearing_flag	O	CHAR	Transaction to be cleared
TODOS	mifir_identifier	M	STRING(10)	ESMA reference: RTS 1 Annex III, RTS 2, Annex IV <ul style="list-style-type: none"> • Values Equity like: SHRS, ETFS, CRFT, DPRS, OTHR • Values Non-Equity: BOND, ETCS, ETNS, DERV, SDRV, EMAL, SFPS
TODOS	asset_class	O	STRING(4)	ESMA reference: RTS 2 Annex III Table 2.1 to 13.3
TODOS	cfi_code	O	STRING(6)	Unused.
TODOS	emal_type	O	STRING(7)	Type of Emission Allowance
TODOS	contract_size	O	DECIMAL	Unused.
TODOS	Actx	O	BOOLEAN	Agency Cross trade (ACTX)
TODOS	benc	O	BOOLEAN	Benchmark trade report (BENC)
TODOS	tpac	O	BOOLEAN	Package transaction flag
TODOS	sdiv	O	BOOLEAN	Special Dividend (SDIV)
TODOS	rpri	O	BOOLEAN	Transactions which received price improvement Input
TODOS	dupl	O	BOOLEAN	Duplicative trade reports
TODOS	xfph	O	BOOLEAN	Exchange for physicals transaction flag
TODOS	tncp	O	BOOLEAN	Transactions not contributing to the price discovery process
TODOS	entr	O	BOOLEAN	New trade report submitted
TODOS	canc	O	BOOLEAN	Existing trade report cancelled

TIPO ACTIVO	CÓDIGO DEL CAMPO	REQUERIDO	FORMATO	DESCRIPCION
TODOS	amnd	O	BOOLEAN	Existing trade report amended
TODOS	lrgs	O	BOOLEAN	Trade is large in scale compared with normal market size
TODOS	size	O	BOOLEAN	Trade is large compared to standard market size
TODOS	llqd	O	BOOLEAN	Illiquidity Flag, true if market is not liquid
TODOS	pcom	O	BOOLEAN	Unused
TODOS	conf	O	BOOLEAN	Unused
TODOS	post_trade_deferral	O	CHAR	Trade flag indicating different possible post trade deferral scenarios. '1'=LMTF '2'=DATF '3'=VOLO '4'=FWAF '5'=IDAF '6'=VOLW '7'=FULF '8'=FULA '9'=FULV 'V'=FULJ 'W'=COAF
TODOS	trade_flags	O	STRING	String containing the post trade transparency flags according to MiFID II directive. Different flags separated by a comma.

M = Mandatory

O = Optional

3.2 Trade Report Message (Limited Details)

TIPO ACTIVO	CÓDIGO DEL CAMPO	REQUERIDO	FORMATO	DESCRIPCION
TODOS	last_trade_time	M	DATE TIME	Date and Time when the trade was executed.
TODOS	instrument_id_code	M	CHAR	Instrument identification code type (I=ISIN, O=OTHR).
TODOS	instrument_id	M	STRING(40)	ISIN (or other identifier) of the instrument.
TODOS	last_trade	O	DECIMAL	Price of the instrument within a reported trade. Up to 20 numerical digits with a decimal separator.
TODOS	pending_price_indicator	O	CHAR	Indicator showing that a price is pending
TODOS	execution_venue_id	O	STRING(4)	Identification of the MIC for which the trade was reported (XOFF or SINT)
TODOS	quotation_type	M	INTEGER	Price notation
TODOS	Currency	O	STRING(3)	Identifies currency used for price (ISO 4217).
TODOS	settlement_currency	O	STRING(3)	Notional currency
TODOS	distribution_date_time	M	DATE TIME	Publication date and time.
TODOS	trans_id_code	O	STRING (52)	Unique ID (TIC) assigned by the MIFID II engine when a trade entry is reported.

TIPO ACTIVO	CÓDIGO DEL CAMPO	REQUERIDO	FORMATO	DESCRIPCION
TODOS	venue_id	O	STRING	Venue of publication
TODOS	clearing_flag	O	CHAR	Transaction to be cleared
TODOS	mifir_identifier	M	STRING(10)	ESMA reference: RTS 1 Annex III, RTS 2, Annex IV <ul style="list-style-type: none"> • Values Equity like: SHRS, ETFS, CRFT, DPRS, OTHR • Values Non-Equity: BOND, ETCS, ETNS, DERV, SDRV, EMAL, SFPS
TODOS	asset_class	O	STRING(4)	ESMA reference: RTS 2 Annex III Table 2.1 to 13.3
TODOS	emal_type	O	STRING(7)	Type of Emission Allowance
TODOS	cfi_code	O	STRING(6)	Unused.
TODOS	Actx	O	BOOLEAN	Agency Cross trade (ACTX)
TODOS	Benc	O	BOOLEAN	Benchmark trade report (BENC)
TODOS	Tpac	O	BOOLEAN	Package transaction flag
TODOS	Sdiv	O	BOOLEAN	Special Dividend (SDIV)
TODOS	Rpri	O	BOOLEAN	Transactions which received price improvement Input
TODOS	dupl	O	BOOLEAN	Duplicative trade reports
TODOS	Xfph	O	BOOLEAN	Exchange for physicals transaction flag
TODOS	Tncp	O	BOOLEAN	Transactions not contributing to the price discovery process
TODOS	Entr	O	BOOLEAN	New trade report submitted
TODOS	Canc	O	BOOLEAN	Existing trade report cancelled
TODOS	amnd	O	BOOLEAN	Existing trade report amended
TODOS	Lrgs	O	BOOLEAN	Trade is large in scale compared with normal market size
TODOS	Size	O	BOOLEAN	Trade is large compared to standard market size
TODOS	llqd	O	BOOLEAN	Illiquidity Flag, true if market is not liquid
TODOS	conf	O	BOOLEAN	Unused
TODOS	post_trade_deferral	O	CHAR	Trade flag indicating different possible post trade deferral scenarios. '1'=LMTF '2'=DATF '3'=VOLO '4'=FWAF '5'=IDAF '6'=VOLW '7'=FULF '8'=FULA '9'=FULV 'V'=FULJ 'W' =COAF
TODOS	trade_flags	O	STRING	String containing the post trade transparency flags according to MiFID II directive. Different flags separated by a comma.

M = Mandatory

O = Optional

3.3 Trade Report Message (Trade Aggregations)

TIPO ACTIVO	CÓDIGO DEL CAMPO	REQUERIDO	FORMATO	DESCRIPCION
TODOS	instrument_id_code	M	CHAR	Instrument identification code type (I=ISIN, O=OTHR).
TODOS	instrument_id	M	STRING(40)	ISIN (or other identifier) of the instrument.
TODOS	execution_venue_id	O	STRING(4)	Identification of the MIC for which the trade was reported (XOFF or SINT)
TODOS	quotation_type	M	INTEGER	Price notation
TODOS	Currency	O	STRING(3)	Identifies currency used for price (ISO 4217).
TODOS	qty_unit	O	STRING(25)	Quantity notation in measurement unit
TODOS	settlement_currency	O	STRING(3)	Notional currency
TODOS	distribution_date_time	M	DATE TIME	Publication date and time.
TODOS	venue_id	O	STRING	Venue of publication
TODOS	clearing_flag	O	CHAR	Transaction to be cleared
TODOS	mifir_identifier	M	STRING(10)	ESMA reference: RTS 1 Annex III, RTS 2, Annex IV <ul style="list-style-type: none"> • Values Equity like: SHRS, ETFS, CRFT, DPRS, OTHR • Values Non-Equity: BOND, ETCS, ETNS, DERV, SDRV, EMAL, SFPS
TODOS	asset_class	O	STRING(4)	ESMA reference: RTS 2 Annex III Table 2.1 to 13.3
TODOS	emal_type	O	STRING(7)	Type of Emission Allowance
TODOS	cfi_code	O	STRING(6)	Unused.
TODOS	total_trade_count	O	INTEGER	For aggregated trades: Total number of trades
TODOS	aggr_group_id	O	STRING(n * 52)	Repeating group of TICs referring to Aggregation (n=TOTAL_TRADE_COUNT)
TODOS	sliding_vwap	O	DECIMAL	For aggregated trades: Volume weighted average price
TODOS	total_volume	O	DECIMAL	For aggregated trades: Total traded volume
TODOS	post_trade_deferral	O	CHAR	Trade flag indicating different possible post trade deferral scenarios. '1'=LMTF '2'=DATF '3'=VOLO '4'=FWAF '5'=IDAF '6'=VOLW '7'=FULF '8'=FULA '9'=FULV 'V'=FULJ 'W' =COAF
TODOS	trade_flags	O	STRING	String containing the post trade transparency flags according to MiFID II directive. Different flags separated by a comma.

M = Mandatory

O = Optional

3.4 SYSTEMATIC INTERNALISERS QUOTES

TIPO ACTIVO	CÓDIGO DEL CAMPO	REQUERIDO	FORMATO	DESCRIPCION
TODOS	validity_date_time	O	DATE TIME	Quote validity date and time
TODOS	quotation_time	M	DATE TIME	Quote creation date and time
TODOS	instrument_id_code	M	CHAR	Instrument identification code type (I=ISIN, O=OTHR)
TODOS	instrument_id	M	STRING	ISIN (or other identifier) of the instrument.
TODOS	executing_lei	M	String (20)	LEI of the Executing Firm (SI)
TODOS	execution_unit	O	String (20)	Name of the Executing Unit (SI)
TODOS	acceptable_counterparty	O	String (10)	Not used
TODOS	client_reference	O	String (52)	Quote identifier assigned by the client
TODOS	best_bid	O	DECIMAL	Buy price of the quote
TODOS	best_ask	O	DECIMAL	Sell price of the quote
TODOS	execution_venue_id	O	STRING	Identification of the MIC / SI of the quote "SINT"
TODOS	quotation_type	M	INTEGER	Price notation
TODOS	currency	M	STRING(3)	Identifies currency used for price (ISO 4217).
TODOS	best_bid_qty	O	DECIMAL	Quantity on Buy Side of a quote.
TODOS	best_ask_qty	O	DECIMAL	Quantity on Sell Side of a quote.
TODOS	qty_unit	O	STRING	Notation of the quantity in measurement unit
TODOS	contract_size	O	DECIMAL	Unused.
TODOS	quantity_in_measurement_unit	O	DECIMAL	Not used
TODOS	client_full_name	O	STRING	Not used
TODOS	client_services	O	STRING	Not used
TODOS	routing_info	O	STRING	Not used
TODOS	nominal_amount	O	DECIMAL	Not used
TODOS	settlement_currency	O	STRING(3)	Notional currency
TODOS	quote_id	M	String (52)	Quote Identifier
TODOS	venue_id	O	String (11)	Venue of publication

TIPO ACTIVO	CÓDIGO DEL CAMPO	REQUERIDO	FORMATO	DESCRIPCION
TODOS	mifir_identifier	M	STRING	ESMA reference: RTS 1 Annex III, RTS 2, Annex IV <ul style="list-style-type: none"> • Values Equity like: SHRS, ETFS, CRFT, DPRS, OTHR • Values Non-Equity: BOND, ETCS, ETNS, DERV, SDRV, EMAL, SFPS
TODOS	asset_class	O	STRING	ESMA reference: RTS 2 Annex III Table 2.1 to 13.3
TODOS	emal_type	O	STRING	Type of Emission Allowance
TODOS	cfi_code	O	STRING(6)	Unused.
TODOS	liquidity_class	O	CHAR	ESMA reference: RTS 2 Annex III Table 2.1 to 13.3 0 - Liquid 1 - Illiquid
TODOS	distribution_date_time	M	DATE TIME	Publication date and time
TODOS	qty_in_measurement_unit_bid	O	DECIMAL	Bid quantity in measurement unit.
TODOS	qty_in_measurement_unit_ask	O	DECIMAL	Ask quantity in measurement unit.
TODOS	nominal_amount_bid	O	DECIMAL	Bid nominal amount
TODOS	nominal_amount_ask	O	DECIMAL	Ask nominal amount
TODOS	entr	O	BOOLEAN	New quote submitted
TODOS	canc	O	BOOLEAN	Existing quote cancelled
TODOS	amnd	O	BOOLEAN	Existing quote amended

M = Mandatory

O = Optional

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.

2023 Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. Todos los derechos reservados.

BME

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