



www.civil-mercantil.com

CIRCULAR 1/2015, de 23 de junio, de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, sobre datos e información estadística de las infraestructuras de mercado.

(BOE de 29 de junio de 2015)

EXPOSICIÓN DE MOTIVOS

El artículo 86.2 de la Ley 24/1988, de 28 de julio, del Mercado de Valores (en adelante LMV), faculta al Ministro de Economía y Competitividad y, con la habilitación expresa de éste, a la Comisión Nacional del Mercado de Valores (en adelante CNMV), a regular los registros, bases de datos internos o estadísticos y documentos que deben llevar las entidades comprendidas en su artículo 84.1.

En uso de la referida habilitación legal se dictó la Orden ECC/2515/2013, de 26 de diciembre, por la que se desarrolla el artículo 86.2 de la Ley 24/1988, de 28 de julio, del Mercado de Valores. En el artículo 1.1 de dicha Orden, el Ministro de Economía y Competitividad habilita expresamente a la CNMV para establecer, modificar y regular, en relación con las entidades citadas en el párrafo anterior, los registros, bases de datos internos o estadísticos y documentos que deben llevar. Asimismo, en el artículo 3.2 de la misma Orden se habilita a la CNMV para establecer, en relación con aquellas entidades, la forma y contenido mínimo a que deberá adaptarse dicha información, precisando las características, formatos, frecuencias, plazos y sistemas de transmisión o de remisión de datos a la CNMV y otros requisitos técnicos de los mismos.

En las letras a) y b) del artículo 84.1 de la LMV se relacionan las entidades que rigen, gestionan, administran o controlan infraestructuras de mercado, cuyos datos de actividad son objeto de esta Circular. Dichas entidades son, en concreto, las infraestructuras de mercado de negociación como las sociedades rectoras de los distintos mercados secundarios oficiales y de los distintos sistemas multilaterales de negociación existentes, y las de poscontratación como las sociedades que administran sistemas de contrapartida central y las que gestionan sistemas de compensación, liquidación y registro; siempre que esos mercados o esos sistemas o bien sus sociedades rectoras, administradoras o gestoras estén sujetas al cumplimiento de las previsiones contenidas en la LMV y su normativa de desarrollo, así como de las normas de Derecho de la Unión Europea que contengan preceptos específicamente referidos a ellas. Esta Circular, en segundo lugar, alcanza a la Sociedad de Bolsas y la sociedad o sociedades que controlen a las sociedades rectoras, administradoras o gestoras antes citadas. Queda excluido del alcance de esta Circular el Banco de España.

La presente Circular consta de cinco normas, una disposición derogatoria, una disposición final y un anexo que es parte integrante de la misma.

El anexo de la Circular tiene por finalidad establecer, compilar y detallar los conjuntos de datos considerados como información estadística que debe ser capturada, guardada y puesta a disposición de la CNMV por parte de las entidades comprendidas en su ámbito de aplicación, con el fin de ser utilizada en tareas recurrentes de supervisión atribuidas a la CNMV en relación con la estructura y operativa de esas entidades, así como con las actividades que sobre instrumentos financieros se realizan, en su caso, en las mismas. El citado anexo se estructura por bloques particularizados para cada una de aquellas entidades, en los que cada conjunto de datos se numera con un cardinal correlativo particular y se identifica con un nombre, junto a una descripción sumaria de su contenido o de su utilidad. Igualmente para cada conjunto de datos figura una indicación de su «tipo» según la clasificación a), b), c) o d) prevista en la Norma tercera, así como las especificidades sobre la «periodicidad», «modo» y «plazo» de entrega al que ha de ajustarse la puesta a disposición o los accesos de la CNMV a dichos conjuntos de datos.



www.civil-mercantil.com

En su virtud, el Consejo de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, previo el informe del Comité Consultivo, en su reunión del 23 de junio de 2015, ha dispuesto lo siguiente:

Norma primera. *Objeto y ámbito de aplicación.*

1. La presente Circular tiene por objeto establecer y regular los registros, bases de datos internos o estadísticos y documentos que reflejen y hayan de contener informaciones relativas a la estructura y la operativa y a actividades sobre instrumentos financieros realizadas, en su caso, en las entidades comprendidas en las letras a) y b) del artículo 84.1 de la LMV, y que han de ser capturadas y guardadas por esas entidades para ser puestas a disposición de la CNMV a efectos del ejercicio de sus funciones de supervisión, incluidas tareas de comprobación o conciliación de dicha información.

Los registros e informaciones de naturaleza contable o financiera de las sociedades rectoras, gestoras o administradoras de las referidas infraestructuras de mercados, aun cuando estén asociados o sean resultantes de la estructura, de la operativa o de las actividades que se realicen en estas sociedades, no son objeto de esta Circular.

2. Lo dispuesto en esta Circular será de aplicación a las siguientes entidades:

a) Las sociedades rectoras de los mercados secundarios oficiales, las entidades rectoras de los sistemas multilaterales de negociación, las entidades de contrapartida central y los depositarios centrales de valores. Queda excluido el Banco de España.

b) La Sociedad de Bolsas y las sociedades que tengan la titularidad de la totalidad de las acciones o de una participación que atribuya el control, directo o indirecto, de las entidades previstas en la letra anterior.

3. En adelante, salvo que una determinada infraestructura de mercado se identifique de forma concreta:

a) Se empleará el término «Infraestructura de negociación» en relación con cualquiera de los mercados secundarios oficiales y a cualquiera de los sistemas multilaterales de negociación comprendidos en la letra a) del apartado 2 anterior. Igualmente esos términos se aplicarán en referencia a la Sociedad de Bolsas citada en la letra b) de dicho apartado 2.

b) Se empleará el término genérico «Infraestructura de poscontratación» en relación con cualquier entidad de contrapartida central y a cualquier depositario central de valores comprendidos en la letra a) del apartado 2 anterior.

4. En adelante, salvo que se identifique cada entidad o sociedad de forma concreta, se empleará el término genérico de «Sociedad» y su plural «Sociedades» en relación con cualquiera de las sociedades o entidades comprendidas en el apartado 2 o con todas ellas.

Norma segunda. *Características de la información estadística regulada.*

1. Las informaciones estadísticas objeto de esta circular consistirán en datos dispuestos de manera adecuada para su tratamiento automatizado que serán reflejo de los eventos que conforman la «secuencia de los servicios» que prestan las distintas infraestructuras de mercado. Dichas informaciones podrán incluir datos agregados o compendiados, incluidos informes, instrucciones, avisos y mensajes de texto o mixtos, datos y textos, que quepa asociar o que sean dependientes de la citada secuencia de los servicios.



www.civil-mercantil.com

2. La «secuencia de los servicios» comprende los eventos, y los hitos de ocurrencia de éstos, desde el momento en que una orden es introducida en los sistemas de la correspondiente infraestructura por un intermediario miembro de la misma hasta el momento en que el resultado final, cualquiera que fuere, queda reflejado en las cuentas de la infraestructura de que se trate. A los efectos de lo establecido en este apartado, se entenderá por orden una instrucción cursada por un inversor para enajenar instrumentos financieros de su propiedad o para adquirir éstos.

3. Los datos a capturar y guardar serán los siguientes:

a) Todos los datos de carácter dinámico referidos al flujo de cada orden o instrucción a lo largo de la secuencia de los servicios en cada una de las infraestructuras de negociación y de poscontratación que intervienen en la misma.

Se entienden por datos dinámicos o de flujo los que no están predeterminados y que varían con cada orden al ser particulares de cada una (entre otros, el número o cantidad de instrumentos financieros de cada orden, el código de identificación de la orden, su importe, nominal o efectivo, la fecha y hora de su ejecución, el código de identificación de la ejecución, su precio o la instrucción que incluye su liquidación).

b) Todos los datos de carácter estático o de posición que los Mercados y las infraestructuras de poscontratación asocian a cada orden que procesan en su itinerario a lo largo de la secuencia de los servicios en la que intervienen.

Se entiende por datos estáticos o de posición aquellos prefijados con anterioridad a cursar una orden en cada Mercado y en cada infraestructura de poscontratación para su asociación a cada orden u operación que procesan. Es el caso, entre otros, de los códigos o las identidades de las mismas infraestructuras de mercado o los del instrumento financiero negociado o susceptible de compensación o de liquidación o de registro en ellas, o los de sus miembros y participantes.

4. Los datos de flujo y los datos de posición que conformen las informaciones estadísticas a las que alcanza esta Circular serán guardados en un soporte seguro, estable y duradero por la Sociedad a la que corresponda su captura durante al menos diez años.

Norma tercera. *Puesta a disposición de la CNMV de la información estadística y datos conexos.*

1. Las informaciones estadísticas que, en aplicación de lo previsto en las Normas primera y segunda, hayan de ser puestas a disposición de la CNMV serán objeto de estructuración en conjuntos. Dichos conjuntos de datos podrán tener como procedencia y serán clasificados, a efectos de esta Circular, en alguna de las siguientes cuatro categorías o tipos:

a) Datos procedentes de plataformas de difusión de información estadística de infraestructuras de negociación en tiempo real, como los contenidos en las denominadas «Data feed» de esas mismas infraestructuras de negociación.

b) Datos procedentes o extraíbles de terminales en línea de las infraestructuras de negociación.

c) Datos, organizados en ficheros informáticos, procedentes de sistemas de información exigibles para el control de las actividades que tienen lugar en las infraestructuras de poscontratación.



www.civil-mercantil.com

d) Datos, cualquiera que sea su origen, incluidos datos de las categorías anteriores, organizados, compendiados o en la forma solicitada por la CNMV en ficheros informáticos.

2. Los conjuntos de datos relacionados en el anexo se pondrán a disposición de la CNMV en la forma y con la periodicidad determinados en dicho anexo.

Los conjuntos o ficheros de datos para los que no se haya establecido una periodicidad se elaborarán y pondrán a disposición de la CNMV en la forma y plazo que, en cada caso, requiera la CNMV a las sociedades. En cualquier caso, el plazo de entrega que consta en el anexo de la presente Circular para cada conjunto de datos se entenderá como máximo.

3. Los campos informáticos que recojan los datos de flujo y los datos de posición que conforman cada uno de los conjuntos de datos categorizados como de tipo c) y d) relacionados en el anexo de esta Circular, y, en concreto, sus formatos, longitudes, posiciones y demás especificaciones técnicas serán reflejados en los denominados «ficheros de especificaciones técnicas».

Dichos «ficheros de especificaciones técnicas» serán accesibles únicamente para las Sociedades que hayan de ponerlos a disposición de la CNMV en la correspondiente área reservada de la Sede electrónica de dicho Organismo.

Las Sociedades pertenecientes a un mismo grupo deberán coordinarse para que los distintos datos estáticos o de posición que sean comunes a varios ficheros informáticos cuando identifiquen la misma información o concepto (mismo instrumento financiero, mismo emisor, misma entidad miembro o participante o misma cuenta de valores o de efectivo, etc.) tengan todos ellos un contenido igual común y un formato y longitud idéntica en el campo de datos correspondiente a esa información o concepto.

Norma cuarta. *Actualización de conjuntos de datos y modificación del contenido de ficheros informáticos.*

1. Los cambios que las Sociedades prevean introducir en los conjuntos de datos de tipo a) o b) del apartado 1 de la Norma tercera deberán ser puestos en conocimiento de la CNMV con anterioridad a su fecha de efectividad y con la antelación suficiente para permitir la evaluación de los efectos en los sistemas de procesamiento de información estadística y, en su caso, esquemas de supervisión de la operativa de esas Sociedades.

2. Las Sociedades podrán también realizar propuestas de modificación en los campos de datos o en los formatos de los ficheros informáticos de datos de tipo c) y d) del apartado 1 de la Norma tercera que se relacionan en el anexo de esta Circular. La CNMV podrá oponerse a esas modificaciones cuando las mismas perjudiquen los procesos de supervisión llevados a cabo a través de esos ficheros. En caso de aceptación, la CNMV determinará los plazos de implantación de los cambios pertinentes.

Norma quinta. *Otras disposiciones sobre los conjuntos de datos de información estadística.*

1. Cada Sociedad establecerá los mecanismos y sistemas de control necesarios que permitan garantizar la exactitud, calidad y suficiencia de la información estadística y el cumplimiento de los formatos y plazos de su puesta a disposición de la CNMV.



www.civil-mercantil.com

2. Cuando un mismo tipo de dato dinámico o de flujo o estadístico o de posición pueda figurar en varios conjuntos de datos referidos al mismo periodo y Sociedad, ésta se asegurará que no difieren, o bien, explicará la razón de la eventual diferencia y señalará la misma.

3. Las Sociedades no podrán modificar los ficheros informáticos, basados en datos del tipo c) y d) del apartado 1 de la Norma tercera, que hayan de ser accesibles o que hayan de ponerse a disposición de la CNMV, ni suprimir ni dejar de informar sobre alguno de los datos que hayan de contener.

Además, cuando alguno de dichos ficheros no estuviera disponible en plazo, o estándolo tuviera campos vacíos o datos erróneos o deficientes a efectos informáticos, la Sociedad responsable vendrá obligada a la subsanación inmediata de la incidencia y a repetir, correctamente, la puesta a disposición del fichero en cuestión.

4. Con carácter general, la CNMV podrá requerir a las Sociedades cuantas aclaraciones precise sobre el contenido de los conjuntos de datos enumerados en el anexo de la presente Circular y sobre los pormenores de su captura, almacenamiento o frecuencia de acceso y plazos de puesta a disposición.

5. Las informaciones estadísticas y datos conexos contenidos en los conjuntos de datos relacionados en el anexo de esta Circular que por cualquier motivo las Sociedades hagan públicos, no diferirán en su contenido de los que se hubieran puesto a disposición de la CNMV.

6. La información estadística y datos conexos a la que haya accedido la CNMV o que se haya puesto a su disposición a través de los conjuntos de datos a los que se refiere la Norma tercera, tendrán carácter reservado y únicamente serán utilizados en tareas de supervisión y de comprobación o conciliación de datos o, en su caso, con fines estadísticos, siéndoles de aplicación lo previsto en el artículo 90 de la LMV.

DISPOSICIÓN DEROGATORIA

Única.

Se derogan las siguientes disposiciones:

- La Norma 4.^a de la Circular 2/1992, de 15 de julio, de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, sobre normas contables, modelos reservados y públicos de los estados financieros, información estadística y cuentas anuales de carácter público de las sociedades rectoras de los mercados oficiales de futuros y opciones.

- La Norma 4.^a de la Circular 4/1992, de 21 de octubre, de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, sobre normas contables, modelos reservados y públicos de los estados financieros, modelos de estados complementarios y cuentas anuales de carácter público del Servicio de Compensación y Liquidación de Valores.

- La Circular 4/1990, de 13 de junio de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, sobre información estadística de las Sociedades Rectoras de las Bolsas de Valores.

- La Norma 4.^a de la Circular 3/1990, de 23 de mayo, de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, sobre normas contables, modelos reservados y públicos de los estados financieros, modelos de estados complementarios, cuentas anuales de carácter público y auditoría de la Sociedad de Bolsas.

- La disposición adicional de la Circular 1/2003, de 22 de enero, de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, por la que se desarrollan los requisitos especiales exigibles a

CEF.-

**Revista práctica del
Derecho CEFLegal.-**



www.civil-mercantil.com

los miembros industriales de los mercados secundarios oficiales de futuros y opciones sobre el aceite de oliva y se regula la información contable y estadística exigible a las sociedades rectoras de estos mercados.

DISPOSICIÓN FINAL

Única. *Entrada en vigor.*

Lo dispuesto en la presente Circular entrará en vigor el día siguiente al de su publicación en el «Boletín Oficial del Estado».

Madrid, 23 de junio de 2015. La Presidenta de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, María Elvira Rodríguez Herrero.

ANEXO

Las tablas que componen este anexo, con relación a las infraestructuras de mercado administradas o regidas o gestionadas por cada una de las Sociedades en el ámbito de esta Circular, detallan los conjuntos de datos que configuran la información estadística que ha de ponerse de manera recurrente a disposición de la CNMV, así como otra información en formato texto que, bajo ciertas circunstancias o a requerimiento, ha de ser remitida a la CNMV. La numeración empleada para estos conjuntos de datos está agrupada según la sociedad rectora o infraestructura gestionada, correlativa del 1 en adelante dentro de cada grupo y sin repetición del identificador ordinal de cada conjunto de datos en este anexo.

La columna “Tipo datos” se refiere a las categorías o tipos en los que los datos se clasifican conforme a la Norma 3ª.1 letras a), b) c) y d) de la presente Circular.

En la columna “Periodicidad” los acrónimos utilizados tienen el siguiente significado:

TR= tiempo Real; D= diaria; S= semanal; M= mensual; SM= semestral; AD= Ad-hoc, entendiéndose por tal, bien cuando acaece un hecho o circunstancia, bien a requerimiento previo de CNMV.

En la columna “Modo entrega” los acrónimos utilizados tienen el siguiente significado:

FTP: “File Transfer Protocol”; C.E.: correo electrónico

En la columna “Plazo entrega” los acrónimos utilizados tienen el siguiente significado:

TR= tiempo real; CS= al cierre de la sesión (en el límite antes de la apertura de la sesión siguiente); 1DHS= primer día hábil de la semana siguiente; 3DHM= tercer día hábil del mes siguiente; 4DHTR= cuarto día hábil del trimestre siguiente; 5DHSM= quinto día hábil del semestre siguiente; 10DHCR= diez días hábiles desde ocurrencia de la circunstancia o la recepción del requerimiento; 30DNSM= treinta días naturales siguientes al cierre del semestre natural.

I. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de Sociedad de Bolsas

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|------|---|---|------------|--------------|-----------------------|---------------|
| I-01 | Data feed de Mercados (Bolsas) | Datos con origen en la Plataforma de difusión de información en tiempo real del Grupo Bolsas y Mercados Españoles (BME Data Feed) que consolida en un formato único múltiples contenidos generados por los distintos Mercados Regulados y Sistemas Multilaterales de Negociación del Grupo BME. Deberá proporcionar los siguientes contenidos: Todos los registros de negociaciones incluyendo hora, volumen, precio, identificación de miembros compradores y vendedores, y órdenes de compra y venta; Registros de los índices IBEX difundidos; Información de todas las horquillas de compra-venta de todos los valores con información de volúmenes asociados a los precios de compra y venta (en subasta, volúmenes asociados al precio de equilibrio en la subasta); Información de los 5 mejores precios de compra y venta y volúmenes asociados; Datos de identificación de todos los valores (i.e., todos los campos relativos a identificación del ISIN) y situación de contratación. | a) | TR | A acordar con Mercado | TR |
| I-02 | Warrants: Cumplimiento de los especialistas | Resumen por emisor con el total de incumplimientos, el total de minutos incumplidos y el motivo de los incumplimientos, de acuerdo con las especificaciones de las Instrucciones Operativas 39/2003 y 77/2012 de Sociedad de Bolsas donde se fijan los parámetros de presencia de los especialistas en el segmento de warrants, certificados y otros productos. | d) | M | FTP | 3DHM |

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|------|---|--|------------|---------------------------|--------------|---------------|
| I-03 | Miembros de mercado | Fichero en el que aparece el listado de los miembros de las 4 bolsas, MERF, MAB y Latibex, y según su situación: alta, baja, modificación o sin cambios. | d) | D | FTP | CS |
| I-04 | Fichero avance de tasas de emisoras de acciones en las bolsas que negocian en SIBE obligadas a remitir a CNMV información | Fichero de avance que exprese la capitalización bursátil calculada con referencia a la última sesión del trimestre correspondiente para las distintas sociedades emisoras de acciones admitidas en las Bolsas que negocian en el SIBE. | d) | Primer y tercer trimestre | FTP | 30DNTR |
| I-05 | Tasas emisoras de acciones en las bolsas que negocian en SIBE obligadas a remitir a CNMV información | Fichero que exprese la capitalización bursátil calculada con referencia a la última sesión de cada semestre para las distintas sociedades emisoras de acciones admitidas en las Bolsas que negocian en el SIBE. | d) | SM | FTP | 30DNSM |

II. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de las Bolsas de Barcelona, Bilbao, Madrid y Valencia a remitir por cada una de ellas

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|-------|---|---|------------|---------------------------|--------------|---------------|
| II-01 | Fichero avance comprobación de la base de la tasa supervisión de la actividad de los miembros | Fichero avance para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro en cada bolsa acerca del número de operaciones de compra y venta y del importe efectivo o nominal total de las operaciones sujetas a tarificación por canon bursátil para los valores de renta variable y de renta fija, excluida la deuda pública, agrupadas esas operaciones sujetas a tarificación en base a su importe efectivo o nominal según los tramos especificados en el artículo 66, apartado 1 de la Ley 16/2014, de 30 de septiembre, por la que se regulan las tasas de la Comisión Nacional del Mercado de Valores. | d) | Primer y tercer trimestre | FTP | 30DNTR |
| II-02 | Comprobación de la base de la tasa supervisión de la actividad de los miembros | Fichero para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro en cada bolsa acerca del número de operaciones de compra y venta y del importe efectivo o nominal total de las operaciones sujetas a tarificación por canon bursátil para los valores de renta variable y de renta fija, excluida la deuda pública, agrupadas esas operaciones sujetas a tarificación en base a su importe efectivo o nominal según los tramos especificados en el artículo 66, apartado 1 de la Ley 16/2014, de 30 de septiembre, por la que se regulan las tasas de la Comisión Nacional del Mercado de Valores. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| II-03 | Tasa por supervisión de las sociedades rectoras | Fichero con el valor efectivo de los valores de renta variable y con el valor nominal de los valores de renta fija, excepto deuda pública, negociados en cada semestre. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| II-04 | Tasas emisoras de acciones admitidas en cada Bolsa no negociadas en SIBE obligadas a remitir a CNMV información | Fichero que exprese la capitalización bursátil calculada con referencia a la última sesión de cada semestre para las distintas sociedades emisoras de acciones admitidas en cada Bolsa que no negocian en el SIBE. | d) | SM | FTP | 30DNSM |

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|---------|---|--|------------|--------------|--------------|---|
| II-05 | Contratación definitiva: | De la contratación definitiva comunicada en el día a la Bolsa se suministrarán los siguientes datos: | | | | |
| II-05.1 | Total compras y ventas | Contrataciones realizadas en el día y contrataciones de fecha atrasada comunicadas en el día (detallando efectivo y número de valores o número de UMC's). En renta fija se incluirá la contratación relativa a los valores de Deuda Pública en Anotaciones. Todo ello para cada miembro y para cada ISIN con contratación. | d) | D | FTP | CS |
| II-05.2 | Total compras y ventas a crédito | Compras y ventas a crédito realizadas en el día y contrataciones a crédito de fecha atrasada comunicadas en el día (detallando efectivo y número de valores o número de UMC's). Todo ello para cada miembro y para cada ISIN con contratación. No puede haber movimientos de rectificación negativos. | d) | D | FTP | CS |
| II-05.3 | Total cancelaciones de compras y ventas a crédito | Cancelaciones de compras y ventas a crédito realizadas en el día y cancelaciones de fecha atrasada comunicadas en el día (detallando efectivo y número de valores o número de UMC's). Todo ello para cada miembro y para cada ISIN con contratación. No puede haber movimientos de rectificación negativos. | d) | D | FTP | CS |
| II-05.4 | Total compras y ventas operaciones especiales | Compras y ventas por cada tipo de operación especial en el día y contrataciones de fecha atrasada comunicadas en el día (detallando efectivo y número de valores o número de UMC's). Todo ello para cada miembro y para cada ISIN con contratación. | d) | D | FTP | CS |
| II-05.5 | Precios | Para cada ISIN, los precios de cierre, máximo, mínimo, medio ponderado y último (con-cupón para los valores de Renta Fija), expresados en euros con seis decimales, así como el cupón corrido (Renta Fija) y la posición (papel o dinero) del citado ISIN. Los precios de los valores que pertenecen al Sistema de Interconexión Bursátil o al Mercado Electrónico de Renta Fija se referirán al conjunto del Mercado. En Renta Fija se incluirán además los precios de los valores de Deuda Pública en Anotaciones. | d) | D | FTP | CS |
| II-05.6 | Operaciones con Crédito al Mercado | Contratación y saldo de operaciones vivas, detallando el número de operaciones, efectivo y número de valores o número de UMC's tanto de compras como de ventas efectuadas en el día. | d) | D | FTP | CS |
| II-05.7 | Préstamo de valores | Comunicaciones, cancelaciones, saldo de préstamos vivos y re-prestados expresados en número de valores o número de UMC's. | d) | D | FTP | CS |
| II-06 | Contratación provisional: Precios | De la contratación provisional efectuada en el día, se suministrarán los siguientes datos: Para cada ISIN con contratación no perteneciente al mercado continuo, los precios de cierre, máximo, mínimo, medio ponderado y último (con-cupón para los valores de Renta Fija), expresados en euros con seis decimales, así como el cupón corrido (Renta Fija) y la posición (papel o dinero) del citado ISIN. | d) | D | FTP | cada día tras las 16:00 (tras 2ª subasta) |
| II-07 | Modificaciones sobre datos de valores | Fichero con las modificaciones de los datos sobre los valores. | d) | D | FTP | CS |

III. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de los sistemas multilaterales de negociación MAB y Latibex

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|--------|--|---|------------|--------------|----------------------------|---------------|
| III-01 | Data Feed de Mercados (MAB SMN y Latibex SMN) | Datos con origen en la Plataforma de difusión de información en tiempo real del Grupo Bolsas y Mercados Españoles (BME Data Feed) que consolida en un formato único múltiples contenidos generados por los distintos Mercados Regulados y Sistemas Multilaterales de Negociación del Grupo BME. Deberá proporcionar los siguientes contenidos referidos al MAB y al Latibex: Todos los registros de negociaciones incluyendo hora, volumen, precio, identificación de miembros compradores y vendedores, y órdenes de compra y venta; Información de todas las horquillas de compra-venta de todos los valores con información de volúmenes asociados a los precios de compra y venta (en subasta, volúmenes asociados al precio de equilibrio en la subasta); Información de los 5 mejores precios de compra y venta y volúmenes asociados; Datos de identificación de todos los valores (i.e., todos los campos relativos a identificación del ISIN) y situación de contratación. | a) | TR | A acordar con los Mercados | TR |
| III-02 | Comprobación de la base de la tasa supervisión de la actividad de los miembros | Fichero para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro de estos sistemas multilaterales de negociación o mercados alternativos acerca del número de operaciones de compra y venta y del importe efectivo o nominal total de las operaciones sujetas a tarificación por canon bursátil para los valores de renta variable y de renta fija, excluida la deuda pública, agrupadas esas operaciones sujetas a tarificación en base a su importe efectivo o nominal según los tramos especificados en el artículo 66, apartado 1 de la Ley 16/2014, de 30 de septiembre, por la que se regulan las tasas de la CNMV. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| III-03 | Tasa por supervisión de las sociedades rectoras | Fichero con el valor efectivo de los valores de renta variable y con el valor nominal de los valores de renta fija, excepto deuda pública, negociados en cada semestre. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| III-04 | Contratación definitiva (con detalles equivalentes a ficheros II-05.1 a II-05.7) | La contratación definitiva comunicada en el día para el SMN correspondiente. Se suministrarán los mismos datos y detalles que en los ficheros II-04.1 a II-04.7 que sean aplicables en referencia a los SMN MAB y Latibex. | d) | D | FTP | CS |

IV. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de Sociedad de Sistemas

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|-------|--|--|------------|---------------------------|--------------|---------------|
| IV-01 | Datos estadísticos de ventas y ventas vencidas | Fichero con los importes liquidados, número de operaciones e importes de penalización para cada entidad, fecha de liquidación y clase de valor. | d) | M | FTP | 3DHM |
| IV-02 | Saldos de justificaciones liquidadas en el día. | Fichero con los valores e importes, según fecha de proceso, tipo de selección, código entidad, clase de valor, fecha de contratación y fecha de liquidación. | d) | D | FTP | CS |
| IV-03 | Fichero avance comprobación de la base de la tasa por supervisión de la actividad de las entidades participantes | Fichero de avance para comprobar la corrección de la información recabada de cada participante en la Sociedad de Sistemas sobre el valor efectivo del saldo de renta variable y con el valor nominal del saldo de renta fija mantenidos por cada uno de ellos, por cuenta propia y de terceros, a último día de cada uno de los meses del trimestre correspondiente. | d) | Primer y tercer trimestre | FTP | 30DNTR |

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|-------|--|---|------------|--------------|--------------|--|
| IV-04 | Comprobación de la base de la tasa por supervisión de la actividad de las entidades participantes | Fichero para comprobar la corrección de la información recabada de cada participante en la Sociedad de Sistemas sobre el valor efectivo del saldo de renta variable y con el valor nominal del saldo de renta fija mantenidos por cada uno de ellos, por cuenta propia y de terceros, a último día de cada uno de los meses del semestre. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| IV-05 | Tasa por supervisión de las entidades autorizadas a gestionar sistemas de registro o liquidación de valores. | Fichero con indicación de si la entidad realiza a la fecha de devengo servicios de registro o liquidación de valores de renta variable, y de si realiza a la fecha de devengo servicios de registro o liquidación de valores de renta fija. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| IV-06 | Comunicación de posición de saldos | Fichero en el que se comunica la posición de saldos que tienen registradas en Iberclear las entidades participantes. | d) | D | FTP | CS |
| IV-07 | Saldos de contratación | Fichero con información sobre número de operaciones, valores e importe, desglosada por ESI y tipo de contratación. La información se refiere a una sola fecha de contratación, es en firme y se enviará en D+2 una vez finalizado el proceso de asignación de operaciones a sus correspondientes entidades liquidadoras. | d) | D | FTP | CS |
| IV-08 | Cambios de titularidad | Fichero con los cambios de titularidad por las entidades participantes. | d) | D | FTP | CS |
| IV-09 | Valores registrados y comunicaciones | Fichero con la información referente a los valores registrados contablemente en Iberclear, ya estén admitidos a negociación en mercados secundarios oficiales o no. Esta comunicación será de todos los valores en la carga inicial, posteriormente se comunicarán los valores que sufran alguna modificación. | d) | AD | FTP | CS en carga inicial y en cada modificación |
| IV-10 | Entidades adheridas | Fichero con la información referente a las Entidades Adheridas registradas en Iberclear. Esta comunicación será de todas las entidades en la carga inicial, posteriormente se comunicarán las entidades que sufran alguna modificación. | d) | AD | FTP | CS en carga inicial y en cada modificación |
| IV-11 | Saldos de clase de valor | Fichero en el que Iberclear comunica por clase de valor el precio medio y el saldo vencido. | d) | D | FTP | CS |
| IV-12 | Valores de préstamo bilateral | Fichero en el que Iberclear comunica los valores de préstamo bilateral entre entidades. | d) | D | FTP | CS |
| IV-13 | Operaciones en valores de renta fija en AIAF y CADE | Fichero con el registro de operaciones de Renta Fija del día. | d) | D | FTP | CS |
| IV-14 | Saldos por entidad y valor de renta fija de AIAF y CADE registrados por participante | Fichero en el que Iberclear comunica la valoración del depósito que cada entidad participante tiene registrada en el sistema de valores de Renta Fija que operan en los mercados de AIAF y DEUDA. | d) | D | FTP | CS |
| IV-15 | Operaciones en valores de AIAF y CADE realizadas por las Gestoras con sus terceros | Fichero en el que Iberclear comunica las declaraciones de terceros realizadas sobre valores de renta fija en los mercados de AIAF y DEUDA. | d) | D | FTP | CS |

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|---------|--|---|------------|--------------|--------------|------------------------------|
| IV-16 | Registro de terceros | Fichero de Valoración de actividad de entidades gestoras. | d) | M | FTP | 3DHM |
| IV-17 | Recompras. Detalle de miembro | Fichero en el que se solicita al miembro de Bolsa correspondiente que efectúe las órdenes de compra citadas y en base a los requisitos indicados. | d) | AD | FTP | Un envío por cada orden dada |
| IV-18 | Cambios de entidad liquidadora | Fichero - Mercado Bursátil y Latibex. | d) | M | FTP | 3DHM |
| IV-19 | Declaraciones del SUC | Fichero Mercados de Deuda y AIAF, Mercado Bursátil, SMN MAB y Latibex y SMN MARF. | d) | M | FTP | 3DHM |
| IV-20 | Operaciones rechazadas | Fichero Mercado Bursátil, MAB y Latibex. | d) | M | FTP | 3DHM |
| IV-21 | Recompras efectuadas | Fichero - Detalle por fecha de liquidación, por valor y por entidad. Mercado Bursátil, MAB y Latibex. | d) | M | FTP | 3DHM |
| IV-22 | Rectificaciones de desglose | Fichero - Se detalla, entre otras, la fecha, el miembro del mercado, el motivo de la rectificación, el código de valor, etc. | d) | M | FTP | 3DHM |
| IV-23 | Valores e importes vencidos | Fichero. Informe sobre valores e importes vencidos y porcentajes respecto a vencido total y contratado. Desglose por entidad y por valor. Mercado Bursátil, MAB y Latibex. | d) | M | FTP | 3DHM |
| IV-24 | Arqueo de titulares | Fichero. Informe agregado con los errores en la comunicación de las referencias de registro (RR) en los ficheros de comunicación de titulares. | d) | M | FTP | 3DHM |
| IV-25 | Fianzas complementarias | Fichero. Detalle por día y entidad adherida del ingreso/retirada, seguros y avales. | d) | S | FTP | 1DHS |
| IV-26 | Fianzas mensuales | Listado de entidades adheridas a Iberclear con el cálculo del riesgo medio diario, la fianza actual y la fianza próxima, tanto para las operaciones bursátiles-MAB como para las operaciones en el Latibex. | d) | M | FTP | 3DHM |
| IV-27 | Información titularidad de operaciones | Comunicación de Iberclear a la CNMV, y a petición de ésta, de las titularidades requeridas, o solo las operaciones, dependiendo de la opción pedida. | d) | AD | FTP | 10DHCR |
| IV-28 | Comunicación de titulares | Comunicación de titulares a emisoras bajo petición. | d) | AD | FTP | 10DHCR |
| IV-29 | Incidencias de liquidación de Renta Fija | Fichero con información sobre las incidencias de liquidación de renta fija. | d) | D | FTP | CS |
| IV-30 | Información sobre operaciones OTC: | Información sobre las operaciones que se liquiden y registren al amparo del Título V del Reglamento de la Sociedad de Gestión de los Sistemas de Registro, Compensación y Liquidación de Valores. Consta de los siguientes cuatro ficheros: | | | | |
| IV-30.1 | Operaciones | Operaciones comunicadas directamente a Iberclear por las entidades que han participado en la ejecución de las operaciones. | d) | D | FTP | CS |
| IV-30.2 | Liquidaciones | Información remitida sobre liquidaciones en las operaciones comunicadas a través de una Cámara de Contrapartida Central u otra entidad que la represente. | d) | D | FTP | CS |
| IV-30.3 | Agrupaciones | Información remitida sobre agrupaciones de negociaciones en las operaciones comunicadas a través de una Cámara de Contrapartida Central u otra entidad que la represente. | d) | D | FTP | CS |

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|-----------|-----------------|---|------------|--------------|--------------|--|
| IV-30.4 | Incidencias | Información remitida sobre incidencias en las operaciones comunicadas a través de una Cámara de Contrapartida Central u otra entidad que la represente. | d) | D | FTP | CS |
| IV-31 | Listados | Ficheros en formato texto recibidos por FTP sobre la evolución de la liquidación bursátil en el día, ventas penalizadas e importe de la penalización. | d) | D | FTP | Un envío por cada ciclo de liquidación |
| IV-31 bis | Justificaciones | Información sobre: a) justificaciones con RR de compra de fecha igual a fecha de contratación de la venta; b) justificaciones con RR de préstamo de fecha igual o superior a la fecha de contratación de la venta; c) Justificaciones con RR de préstamo de fecha inferior a la fecha de contratación de la venta | d) | D | FTP | CS |

V. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de MEFF Exchange y BME Clearing

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|------|--|--|------------|---------------------------|--|---------------------------------|
| V-01 | Data Feed Mercado e infraestructura poscontratación (MEFF y ECC) | Datos con origen en la Plataforma de difusión de información en tiempo real del Grupo Bolsas y Mercados Españoles (BME Data Feed) que consolida en un formato único múltiples contenidos generados por los distintos Mercados Regulados y Sistemas Multilaterales de Negociación del Grupo BME. Deberá proporcionar los siguientes contenidos referidos a MEFF y BME Clearing: Contratos negociables en la sesión (código, delta, tipo de contrato, "strike", vencimiento, subyacente, volatilidad, precio de cierre, grupos de contratos). Desde MEFF y BME Clearing en formato propietario: cuentas activas, operaciones (miembro, operador, cuenta, signo, contrato, precio, volumen, tipo de operación, fecha, hora, nº de registro), órdenes, posición abierta agregada, garantías exigibles por cuenta, datos estadísticos. Fichero de operaciones definitivas de BME Clearing Derivados Financieros y Energía | a) | TR | A acordar con las infraestructuras del mercado | TR |
| V-02 | Front Data de Terminal del Mercado | Terminal del mercado por el que se accede en tiempo real a datos de negociación o consultas de históricos, de negociación, de liquidación o gestión de riesgos. Debe proporcionar acceso al máximo nivel de consulta, incorporando como mínimo ficheros de traspaso para: órdenes, operaciones, contratos, miembros y cuentas, estadísticas, posición abierta y garantías. | b) | TR | A acordar con el Mercado | TR y CS en ficheros traspaso |
| V-03 | Fichero avance comprobación de la base de la tasa por supervisión de la actividad de los miembros de los mercados secundarios oficiales de contratos de futuros y opciones | Fichero de avance para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro negociador del mercado secundario de futuros y opciones MEFF Exchange acerca del número de contratos de derivados de subyacente financiero negociados por cada uno de ellos en el trimestre correspondiente, agrupados según el tipo de contrato (futuros u opciones), según el tipo de subyacente (valores mobiliarios e índices o deuda) y según su valor nominal (menor o mayor a 50.000 €). Para el caso de contratos de derivados de subyacente no financiero, el número de unidades de servicio, suministro o entrega que subyacen en el objeto de los contratos negociados en el trimestre correspondiente. | d) | Primer y tercer trimestre | FTP | 30DNTR |

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|------|---|--|------------|---------------------------|--------------|---------------|
| V-04 | Comprobación de la base de la tasa por supervisión de la actividad de los miembros de los mercados secundarios oficiales de contratos de futuros y opciones | Fichero para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro negociador del mercado secundario de futuros y opciones MEFF Exchange acerca del número de contratos de derivados de subyacente financiero negociados por cada uno de ellos en el semestre, agrupados según el tipo de contrato (futuros u opciones), según el tipo de subyacente (valores mobiliarios e índices o deuda) y según su valor nocional (menor o mayor a 50.000 €). Para el caso de contratos de derivados de subyacente no financiero, el número de unidades de servicio, suministro o entrega que subyacen en el objeto de los contratos negociados en el semestre de devengo. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| V-05 | Tasa por supervisión de las sociedades rectoras de los mercados secundarios oficiales de contratos de futuros y opciones | Fichero con el número de contratos de futuros y opciones negociados en el semestre. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| V-06 | Fichero avance comprobación de la tasa de supervisión de la actividad de los miembros compensadores de entidades de contrapartida central | Fichero de avance para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro compensador en la entidad BME Clearing acerca del número de transacciones de renta variable y su importe efectivo y número de contratos de derivados de subyacente financiero y no financiero llevados a compensar. Importe promedio de las garantías por la posición abierta requeridas a lo largo del trimestre correspondiente por las transacciones u operaciones simples y simultáneas sobre valores representativos de deuda y por las transacciones u operaciones o contratos de derivados llevadas a compensar. | d) | Primer y tercer trimestre | FTP | 30DNTR |
| V-07 | Comprobación de la tasa de supervisión de la actividad de los miembros compensadores de entidades de contrapartida central | Fichero para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro compensador en la entidad BME Clearing acerca del número de transacciones de renta variable y su importe efectivo y número de contratos de derivados de subyacente financiero y no financiero llevados a compensar. Importe promedio de las garantías por la posición abierta requeridas a lo largo del semestre por las transacciones u operaciones simples y simultáneas sobre valores representativos de deuda y por las transacciones u operaciones o contratos de derivados llevadas a compensar. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| V-08 | Tasa por supervisión de las entidades de contrapartida central. | Fichero con indicación de si la entidad realiza a la fecha de devengo servicios de compensación con o sin liquidación de contratos de derivados, si realiza servicios de compensación de valores de renta variable, y de si realiza servicios de compensación de valores de renta fija. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| V-09 | Miembros de MEFF Exchange y BME Clearing | Fichero en el que aparece el listado completo de las Entidades Miembro: los Segmentos en los que estén actuando, su condición o categorización en cada uno, y su estado: alta, baja, modificación o sin cambios. | d) | D | FTP | CS |
| V-10 | Actividad de MEFFRepo | Fichero con datos anuales sobre volumen efectivo y nº operaciones, según sea en plataforma Senaf o en operaciones bilaterales, recibido cada año previa solicitud. | d) | AD | FTP | 10DHCR |

VI. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de AIAF

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad. | Modo entrega | Plazo entrega |
|-------|---|--|------------|---------------------------|--------------|---------------|
| VI-01 | Fichero avance comprobación de la base de la tasa por supervisión de la actividad de los miembros | Fichero de avance para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro acerca del número de operaciones de compra y venta y el importe nominal total de las operaciones para los valores de renta fija, excluida la deuda pública, realizadas por cada miembro y agrupadas en base a su importe efectivo o nominal según los tramos especificados en el artículo 66, apartado 1 de la Ley 16/2014, de 30 de septiembre, por la que se regulan las tasas de la Comisión Nacional del Mercado de Valores. | d) | Primer y tercer trimestre | FTP | 30DNTR |
| VI-02 | Comprobación de la base de la tasa por supervisión de la actividad de los miembros | Fichero para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro acerca del número de operaciones de compra y venta y el importe nominal total de las operaciones para los valores de renta fija, excluida la deuda pública, realizadas por cada miembro y agrupadas en base a su importe efectivo o nominal según los tramos especificados en el artículo 66, apartado 1 de la Ley 16/2014, de 30 de septiembre, por la que se regulan las tasas de la Comisión Nacional del Mercado de Valores. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| VI-03 | Tasa por supervisión de las sociedades rectoras | Fichero con el valor nominal de los valores de renta fija, excepto deuda pública, negociados en cada semestre. | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| VI-04 | Saldos vivos | Fichero enviado en el que se recoge el saldo vivo por ISIN, aportando además información sobre el emisor y el tipo de activo. | d) | M | FTP | 2DHM |
| VI-05 | Contenido total de las negociaciones | Información detallada de las negociaciones de la sesión en AIAF y en MARF | d) | D | FTP | CS |
| VI-06 | Emisiones | Nuevas emisiones y modificaciones de las existentes, para AIAF y MARF. También para emisiones de Mercado de Deuda Pública, SENAF y Bolsas. | d) | D | FTP | CS |
| VI-07 | Miembros | Fichero con los nuevos miembros y modificaciones de los ya existentes, para AIAF, SEND, MARF y SENAF. | d) | D | FTP | CS |
| VI-08 | Sociedades emisoras | Fichero con las nuevas sociedades emisoras y modificaciones de las existentes, para AIAF y MARF. | d) | D | FTP | CS |
| VI-09 | Saldos vivos | Saldos vivos de las emisiones de AIAF existentes. | d) | D | FTP | CS |
| VI-10 | Amortizaciones anticipadas | Comunicación de las amortizaciones anticipadas parciales o totales de emisiones de AIAF. | d) | D | FTP | CS |
| VI-11 | Precios | Detalles del volumen negociado y precios del mercado AIAF publicados por este mercado. | d) | D | FTP | CS |

VII. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de SENAF

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|--------|--|--|------------|--------------|--------------------------|---------------|
| VII-01 | Front Data Terminal Mercado | Terminal del mercado donde se pueden consultar en tiempo real las órdenes introducidas y ejecutadas. Debe proporcionar acceso al máximo nivel de consulta, permitiendo como mínimo: recibir o acceder a las funciones de consulta de órdenes (individuales y mejores posiciones); operaciones de la sesión, miembro comprador y vendedor; instrumentos; entidades. | b) | TR | A acordar con el Mercado | TR |
| VII-02 | Fichero de operaciones a fin de sesión | Información detallada de las negociaciones de la sesión en SENAF. | d) | D | FTP | CS |

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|--------|--|---|------------|--------------|--------------|---------------|
| VII-03 | Informe de actividad | Ficheros conteniendo los volúmenes negociados en el mes y distinguiendo entre mercado de letras, mercado de repos, deuda avalada o a vencimiento. | d) | M | FTP | 2DHM |
| VII-04 | Segmentos de miembros de SENAF | Relación de los miembros de SENAF y su inclusión en cada uno de los segmentos del sistema. | d) | D | FTP | CS |
| VII-05 | Entidades suspendidas | Envío, solo en caso de incidencia, de los miembros suspendidos, con información sobre la fecha de suspensión, motivo, etc. | d) | D | FTP | CS |
| VII-06 | Miembros de SENAF | Envío, solo en caso de alta, baja o modificación de la situación anterior de un miembro. | d) | D | FTP | CS |
| VII-07 | Comprobación de la base de la tasa por supervisión de la actividad de los miembros | Fichero para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro acerca del número de operaciones de compra y venta y el importe nominal total de las operaciones para los valores de renta fija, excluida la deuda pública, realizadas por cada miembro y agrupadas en base a su importe efectivo o nominal según los tramos especificados en el artículo 66, apartado 1 de la Ley 16/2014, de 30 de septiembre, por la que se regulan las tasas de la CNMV | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| VII-08 | Tasa por supervisión de las sociedades rectoras | Fichero con el valor efectivo de los valores de renta variable y con el valor nominal de los valores de renta fija, excepto deuda pública, negociados en cada semestre. | d) | SM | FTP | 30DNSM |

VIII. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de MERF

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|---------|--|--|------------|--------------|--------------------------|---------------|
| VIII-01 | Data feed Mercados (datos de MERF y otros MSO) | Datos con origen en la Plataforma de difusión de información en tiempo real del Grupo Bolsas y Mercados Españoles (BME Data Feed) que consolida en un formato único múltiples contenidos generados por los distintos Mercados Regulados y Sistemas Multilaterales de Negociación del Grupo BME. Deberá proporcionar los siguientes contenidos referidos a a RF de Bolsa, MERF, y mercados electrónicos de deuda de las Bolsas de Barcelona y de Valencia: todos los registros correspondientes a los mensajes de precios, ejecuciones, todos los campos relativos a identificación del ISIN; identificación de los miembros; hora, minuto y segundo; volúmenes y precios. Fecha, hora, ISIN, valor, comprador, vendedor, precio, TIR, importe nominal €, efectivo €, fecha vencimiento, cupón, tipo cupón, periodicidad, próximo cupón, cupón corrido, cupón corrido €, nominal unitario, precio referencia, % oscilación, categorías, activo, segmento, COD SIBE, nº. operación, indicador cta. compradora, indicador cta. venta. | a) | TR | A acordar con el Mercado | TR |
| VIII-02 | Front Data Terminal del Mercado (conjunto mercados y sistemas de RF) | Terminal del mercado por el que se recibe la información conjunta de SEND, MARF, MERF y mercados electrónicos de deuda de las Bolsas de Barcelona y Valencia. Debe proporcionar acceso al máximo nivel de consulta | b) | TR | A acordar con el Mercado | TR |
| VIII-03 | Proveedores de liquidez | Información detallada de proveedores de liquidez, relación a actualizar con cada modificación | d) | AD | FTP | 10DHCR |

IX. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de MARF

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|-------|--|---|------------|--------------|--------------------------|---------------|
| IX-01 | Data feed Mercados (datos de MARF) | Datos con origen en la Plataforma de difusión de información en tiempo real del Grupo Bolsas y Mercados Españoles (BME Data Feed) que consolida en un formato único múltiples contenidos generados por los distintos Mercados Regulados y Sistemas Multilaterales de Negociación del Grupo BME. Deberá proporcionar los siguientes contenidos referidos al MARF: todos los registros correspondientes a los mensajes de precios, ejecuciones, todos los campos relativos a identificación del ISIN; identificación de los miembros; hora, minuto y segundo; volúmenes y precios. Fecha, hora, ISIN, valor, comprador, vendedor, precio, TIR, importe nominal €, efectivo €, fecha vencimiento, cupón, tipo cupón, periodicidad, próximo cupón, cupón corrido, cupón corrido €, nominal unitario, precio referencia, % oscilación, categorías, activo, segmento, COD SIBE, n°. operación, indicador cta. compradora, indicador cta. venta. | a) | TR | A acordar con el Mercado | TR |
| IX-02 | Asesores registrados | Información detallada de asesores registrados, relación a actualizar con cada modificación | d) | AD | FTP | 10DHCR |
| IX-03 | Comprobación de la base de la tasa por supervisión de la actividad de los miembros | Fichero para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro acerca del número de operaciones de compra y venta y el importe nominal total de las operaciones para los valores de renta fija, excluida la deuda pública, realizadas por cada miembro y agrupadas en base a su importe efectivo o nominal según los tramos especificados en el artículo 66, apartado 1 de la Ley 16/2014, de 30 de septiembre, por la que se regulan las tasas de la CNMV | d) | SM | FTP | 30DNSM |
| IX-04 | Tasa por supervisión de las sociedades rectoras | Fichero con el valor efectivo de los valores de renta variable y con el valor nominal de los valores de renta fija, excepto deuda pública, negociados en cada semestre. | d) | SM | FTP | 30DNSM |

X. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de SEND

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|------|------------------------------------|---|------------|--------------|--------------------------|---------------|
| X-01 | Data feed Mercados (datos de SEND) | Datos con origen en la Plataforma de difusión de información en tiempo real del Grupo Bolsas y Mercados Españoles (BME Data Feed) que consolida en un formato único múltiples contenidos generados por los distintos Mercados Regulados y Sistemas Multilaterales de Negociación del Grupo BME. Deberá proporcionar los siguientes contenidos referidos al SEND: todos los registros correspondientes a los mensajes de precios, ejecuciones, todos los campos relativos a identificación del ISIN; identificación de los miembros; hora, minuto y segundo; volúmenes y precios. Fecha, hora, ISIN, valor, comprador, vendedor, precio, TIR, importe nominal €, efectivo €, fecha vencimiento, cupón, tipo cupón, periodicidad, próximo cupón, cupón corrido, cupón corrido €, nominal unitario, precio referencia, % oscilación, categorías, activo, segmento, COD SIBE, n°. operación, indicador cta. compradora, indicador cta. venta. | a) | TR | A acordar con el Mercado | TR |
| X-02 | Operaciones | Información detallada de las negociaciones de la sesión en SEND (incluye también MARF) | d) | D | FTP | CS |
| X-03 | Mediadores | Información detallada de mediadores de SEND (incluye también MARF) | d) | D | FTP | CS |

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|------|-------------------------|---|------------|--------------|--------------|---------------|
| X-04 | Mediación | Relación entre mediadores y miembros, para SEND (incluye también MARF) | d) | D | FTP | CS |
| X-05 | Proveedores | Información detallada de proveedores de liquidez de SEND. | d) | D | FTP | CS |
| X-06 | Órdenes y negociaciones | Fichero que incluye las órdenes y negociaciones de los mercados que se negocian en la misma plataforma técnica de contratación de renta fija: SEND, MERF, MARF, mercado electrónico de deuda de la Bolsa de Barcelona y mercado electrónico de deuda de la Bolsa de Valencia. | d) | D | FTP | CS |

XI. Conjuntos de datos de información estadística generada por las Bolsas para el SAMMS

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|-------|--|---|------------|--------------|--------------|---------------|
| XI-01 | Emisiones Vivas de Renta Variable BME | Fichero con las emisiones válidas para el día siguiente para Valores de Renta Variable. | d) | D | FTP | CS |
| XI-02 | ETF Vivos de BME. | Fichero con los valores de ETF vivos. | d) | D | FTP | CS |
| XI-03 | Warrants Vivos de BME. | Fichero con las emisiones válidas para el día siguiente para Valores de Warrants. | d) | D | FTP | CS |
| XI-04 | Especialistas por valor de Warrants de BME | Fichero con los especialistas por Warrant. | d) | D | FTP | CS |
| XI-05 | Warrants disponibles por especialista de BME | Fichero con los valores disponibles por Warrant. | d) | S | FTP | CS |
| XI-06 | Especialista de Warrants con valores agotados de BME | Fichero con los especialistas que tienen valores agotados para warrant. | d) | D | FTP | CS |
| XI-07 | Especialistas ETF de BME. | Fichero con los especialistas por ETF. | d) | D | FTP | CS |
| XI-08 | Tipos de contratos de derivados de BME | Fichero Maestro de Tipos de Contratos de Derivados de BME. | d) | D | FTP | CS |
| XI-09 | Fichero de contratos disponibles de derivados de BME | Información general de los contratos disponibles en la sesión D+1 de BME. | d) | D | FTP | CS |
| XI-10 | Índices de BME. | Fichero de BME con los índices existentes. | d) | D | FTP | CS |
| XI-11 | Composición y ponderación de índices | Ficheros de BME con la composición de los índices de la familia del IBEX: un fichero por cada índice. | d) | D | FTP | CS |
| XI-12 | Estado del valor en el índice | Fichero de BME con la información del estado del valor en el índice. | d) | D | FTP | CS |
| XI-13 | Ticks de índices | Fichero con el precio de los índices en cada momento y sus precios de referencia a fin de sesión. | d) | D | FTP | CS |
| XI-14 | Estimadores de índices | Fichero con información de Estimadores de cada índice durante las subastas a fin de sesión. | d) | D | FTP | CS |

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|-------|---|---|------------|--------------|--------------|---------------|
| XI-15 | Precios y volúmenes de valores de Renta Variable | Fichero donde se describen para cada mercado los Valores, el número de operaciones, el efectivo, los títulos y los precios correspondientes a los valores de Renta Variable que se han negociado en el día. | d) | D | FTP | CS |
| XI-16 | Precios y volúmenes de valores de ETF | Fichero donde se describen para cada mercado los Valores, el número de operaciones, el efectivo, los títulos, los precios, el valor liquidativo y la fecha del valor liquidativo correspondientes a los valores de ETF que se han negociado en el día. | d) | D | FTP | CS |
| XI-17 | Precios y volúmenes de valores de Warrants | Fichero donde se describen para cada mercado los Valores, el número de operaciones, el efectivo, los títulos y los precios correspondientes a los valores de Warrants que se han negociado en el día. | d) | D | FTP | CS |
| XI-18 | Precios y volúmenes de Índices | Fichero donde aparece para cada índice, entre otra, información sobre títulos negociados, efectivo y valor del índice. | d) | D | FTP | CS |
| XI-19 | Precios y volúmenes de Derivados de Renta Variable | Fichero donde aparece información sobre el precio de liquidación, volatilidad de la liquidación, volumen total registrado, número de operaciones registradas o posición abierta del titular, entre otro tipo de información. | d) | D | FTP | CS |
| XI-20 | Ejecuciones del Mercado para Renta Variable | Fichero con información sobre el valor negociado, volumen negociado, precio de negociación, broker comprador y vendedor, modalidad de la contratación, efectivo negociado y los precios de la sesión, entre otros campos de información, para los valores de Renta Variable. | d) | D | FTP | CS |
| XI-21 | Ejecuciones B/S del Mercado para Renta Variable | Fichero en el que aparece, entre otra, información sobre el tipo de operación especial negociada para los valores de Renta Variable. | d) | D | FTP | CS |
| XI-22 | Cancelaciones/Retrocesiones del Mercado para Renta Variable | Fichero con los mismos campos que el fichero anterior más un campo nuevo con el número de operación SIB Retrocedida, para los valores de Renta Variable. | d) | D | FTP | CS |
| XI-23 | 5 Mejores posiciones para Renta Variable | Fichero con campos que recogen, entre otros, la identificación del Valor, nº de órdenes de compra de la posición 1, volumen acumulado de la mejor orden de compra, precio de la mejor compra, precio de la mejor venta, volumen acumulado de la mejor orden venta, nº de órdenes de venta de la posición 1, nº de órdenes de compra de la posición 2, etc., para los valores de Renta Variable. | d) | D | FTP | CS |
| XI-24 | Ejecuciones del Mercado para ETF | Fichero con información sobre el valor negociado, volumen negociado, precio de negociación, broker comprador y vendedor, modalidad de la contratación, efectivo negociado y los precios de la sesión, entre otros campos de información, para los valores ETF. | d) | D | FTP | CS |
| XI-25 | Ejecuciones B/S del Mercado para ETF | Fichero en el que aparece, entre otra, información sobre el tipo de operación especial negociada para los valores ETF. | d) | D | FTP | CS |
| XI-26 | Cancelaciones/Retrocesiones del Mercado para ETF | Fichero con los mismos campos que el fichero anterior más un campo nuevo con el número de operación SIB Retrocedida, para los valores ETF. | d) | D | FTP | CS |

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|-------|---|---|------------|--------------|--------------|---------------|
| XI-27 | 5 Mejores posiciones para ETF | Fichero con campos que recogen, entre otros, la identificación del Valor, nº de órdenes de compra de la posición 1, volumen acumulado de la mejor orden de compra, precio de la mejor compra, precio de la mejor venta, volumen acumulado de la mejor orden venta, nº de órdenes de venta de la posición 1, nº de órdenes de compra de la posición 2, etc., para los valores ETF. | d) | D | FTP | CS |
| XI-28 | Ejecuciones del Mercado para Warrants | Fichero con información sobre el valor negociado, volumen negociado, precio de negociación, broker comprador y vendedor, modalidad de la contratación, efectivo negociado y los precios de la sesión, entre otros campos de información, para warrants. | d) | D | FTP | CS |
| XI-29 | Ejecuciones B/S del Mercado para Warrants | Fichero en el que aparece, entre otra, información sobre el tipo de operación especial negociada para warrants. | d) | D | FTP | CS |
| XI-30 | Cancelaciones/Retrocesiones del Mercado para Warrants | Fichero con los mismos campos que el fichero anterior más un campo nuevo con el número de operación SIB Retrocedida, para warrants. | d) | D | FTP | CS |
| XI-31 | 5 Mejores Posiciones para Warrants | Fichero con campos que recogen, entre otros, la identificación del Valor, nº de órdenes de compra de la posición 1, volumen acumulado de la mejor orden de compra, precio de la mejor compra, precio de la mejor venta, volumen acumulado de la mejor orden venta, nº de órdenes de venta de la posición 1, nº de órdenes de compra de la posición 2, etc., para warrants. | d) | D | FTP | CS |
| XI-32 | Fichero MO (Libro de Órdenes de Renta Variable) snap-shot | Fichero con campos que recogen la identificación del valor; el sentido (compra o venta); identificación del broker, volumen y precio de la orden 1; identificación del broker, precio y volumen de la orden 2; etc. | d) | D | FTP | CS |
| XI-33 | Fichero órdenes durante subasta (alarma 23) | Ficheros con información durante la subasta del mejor precio de compra y de venta (best bid y best ask) para una acción y el volumen de compra y de venta asociado a esos mejores precios desglosado por miembro. Los ficheros han de separarse según se trate de valores del fixing, mercado continuo, MAB y Latibex. | d) | D | FTP | CS |
| XI-34 | Fichero MC (Estado del mercado) | Ficheros con información sobre la fecha, hora, modalidad de contratación, estado (Activo o Inactivo), etc. Ficheros separados para la renta variable y para los ETF | d) | D | FTP | CS |
| XI-35 | Fichero rSY (Estado del valor) | Ficheros con información sobre identificación del valor, código ISIN, estado (Ready to Trade, Not available for trading o Subasta), precio de referencia, motivo de subasta, motivo de suspensión, tipo de actuación del Especialista, etc. Ficheros separados para cada segmento | d) | D | FTP | CS |

XII. Otras Informaciones recurrentes

| ID | Nombre otra información | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|--------|---|---|------------|--------------|-----------------------------|---------------|
| XII-01 | Libro de accionistas de BME Holding | Listado de accionistas de BME Holding solicitado a una fecha determinada | d) | AD | CIFRA-DOC Trámite zzz | 10DHCR |
| XII-02 | Instrucciones operativas y otra información publicada en la web del mercado | Ficheros correspondientes a Sociedad de Bolsas (equivalentes a los que ha de reflejarse en su página web) | d) | AD | C.E. | 10DHCR |
| XII-03 | Instrucciones operativas y otra información publicada en la web del mercado | Ficheros procedentes de los SMN Mercado Alternativo Bursátil y del Latibex (equivalentes a los que ha de reflejarse en su página web) | d) | AD | C.E. | 10DHCR |
| XII-04 | Avisos, Circulares, Instrucciones Operativas y Notas Informativas | Ficheros procedentes de Iberclear (equivalentes a los que ha de reflejarse en su página web) | d) | AD | C.E. | 10DHCR |
| XII-05 | Avisos, Circulares, Instrucciones Operativas y Comunicados | Ficheros procedentes de MEFF Exchange y BME Clearing (equivalentes a los que ha de reflejarse en su página web) | d) | AD | C.E. | 10DHCR |
| XII-06 | Avisos, Circulares, Instrucciones Operativas y Comunicados | Ficheros procedentes del Mercado de Renta Fija AIAF (equivalentes a los que ha de reflejarse en su página web) | d) | AD | C.E. | 10DHCR |
| XII-07 | Avisos, Circulares, Instrucciones Operativas y Comunicados | Ficheros procedentes del SMN SENAF (equivalentes a los que ha de reflejarse en su página web) | d) | AD | C.E. | 10DHCR |
| XII-08 | Avisos, Circulares, Instrucciones Operativas y Comunicados | Ficheros procedentes del SMN Mercado Alternativo de Renta Fija (equivalentes a los que ha de reflejarse en su página web) | d) | AD | C.E. | 10DHCR |

XIII. Conjuntos de datos de información estadística procedentes de MFAO

| ID | Nombre | Descripción | Tipo datos | Periodicidad | Modo entrega | Plazo entrega |
|---------|---|--|------------|--------------|--|---------------|
| XIII-01 | Front Data Terminal Mercado | Terminal del mercado donde se pueden consultar en tiempo real las órdenes introducidas y ejecutadas. Debe proporcionar acceso al máximo nivel de consulta, permitiendo como mínimo: acceder a las funciones de consulta de órdenes (individuales y mejores posiciones), operaciones (miembro, operador, cuenta, signo, contrato, precio, volumen, tipo de operación, fecha, hora, nº de registro), instrumentos, entidades, mensajes, y a los ficheros de órdenes, operaciones, contratos, miembros y cuentas, estadísticas, posición abierta y garantías. | b) | TR | A acordar con infraestructuras mercado | TR |
| XIII-02 | Comprobación de la base de la tasa por supervisión de la actividad de los miembros de los mercados secundarios oficiales de contratos de futuros y opciones | Fichero para comprobar la corrección de la información recabada de cada miembro acerca del número de unidades de servicio, suministro o entrega que subyacen en el objeto de los contratos negociados en el semestre de devengo. | d) | SM | FTP | 5DHSM |
| XIII-03 | Tasa por supervisión de las sociedades rectoras de los mercados secundarios oficiales de contratos de futuros y opciones | Fichero con el número de contratos de futuros y opciones negociados en el semestre. | d) | SM | FTP | 5DHSM |