



Order Record Keeping

Versión 2.0

10 de enero de 2020

Índice

| | |
|--|-----------|
| 1. Introducción | 3 |
| Datos en la orden..... | 5 |
| Short codes o uso de Códigos de identificación | 6 |
| Gestión histórica de la Base de Datos ORK..... | 6 |
| 2. Tipos de registro | 8 |
| Cambios en los registros DW y EW respecto a la versión anterior | 8 |
| Registro DW – Decisión de inversión dentro de la empresa..... | 9 |
| Registro EW – Ejecución dentro de la empresa | 10 |
| 3. Validaciones | 11 |
| 4. Horario | 12 |
| Datos del Miembro hacia BME | 12 |
| Datos de BME hacia el miembro | 12 |
| 5. Comunicaciones | 13 |
| Aspectos técnicos de los ficheros de entrada | 13 |
| Nomenclatura de los ficheros enviados por los Miembros..... | 13 |
| Nomenclatura y formato de los ficheros del ORK hacia los Miembros | 14 |
| Limite en el tamaño de los ficheros de respuesta ORK y ORVB: | 15 |
| Registros FI | 15 |
| Registros VA..... | 15 |
| Registros VB..... | 21 |
| Ficheros SHCD | 22 |
| 6. Correcciones | 23 |
| Campos susceptibles de ser modificados en una corrección | 23 |
| Método de actuación..... | 23 |
| 7. Ejemplos | 24 |
| Ejemplo 1. Se corresponde con el ejemplo 43 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452 | 24 |
| Ejemplo 2. Se corresponde con el ejemplo 82 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452 | 25 |
| Ejemplo 3. Se corresponde con el ejemplo 65 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452 | 26 |
| Ejemplo 4. Orden de renta variable agregada informando de referencia titular. | 27 |
| Ejemplo 5. Informar una operación individualmente mediante el registro RC. | 28 |
| ANEXO 1: Formato de Campos | 30 |
| Formato registro RI. Registro por Identificador..... | 30 |
| Formato SubRegistro CT de Clientes..... | 30 |
| Formato SubRegistro DW de decisores “within the firm” | 31 |
| Formato SubRegistro EW de ejecutores “within the firm” | 31 |

Modificaciones al documento versión 2.0

- Las ordenes ya no pueden ser modificadas con un registro DA (pág. 8)
- Se elimina la funcionalidad de las fechas y MIC de los registros RI (pág. 8). Los registros DW y EW ya no necesitan tener los campos "F_inicio", "F_Fin" ni "TrdnVn" informados (pág. 8)
- Modificaciones en las altas y bajas de información con registros RI. (págs. 9 y 10)
- Gestión histórica de datos: Área histórica e Histórico ORK. Registros que están admitidos y cuales son rechazados (págs. 13-22)
- Límite de número de mensajes en los ficheros de respuesta (pág. 15)
- Ficheros SHCD: códigos cortos enviados al área histórica (pág. 22)

1. Introducción

El Reglamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 15 de mayo de 2014, relativo a los mercados de instrumentos financieros, y en particular su artículo 25, punto 2, señala que *“El gestor de un centro de negociación mantendrá a disposición de la autoridad competente, por lo menos durante cinco años, los datos pertinentes sobre todas las órdenes relativas a instrumentos financieros que se reciban en sus sistemas...”*

El Reglamento Delegado (UE) 2017/580 de la Comisión, de 24 de junio de 2016, especifica que los datos asociados a cada orden que deben ser guardados son:

| Número de campo | Descripción |
|---|---|
| Identificación de las partes pertinentes | |
| 1 | Identificación de la entidad que presentó la orden |
| 2 | Direct Electronic Access (DEA) |
| 3 | Código de identificación del cliente |
| 4 | Decisión de inversión dentro de la empresa |
| 5 | Ejecución dentro de la empresa |
| 6 | Intermediario no ejecutor |
| Capacidad en la que se actúa en la negociación y provisión de liquidez | |
| 7 | Capacidad de negociación |
| 8 | Actividad de provisión de liquidez |
| Fecha y hora | |
| 9 | Fecha y hora |
| Período de validez y restricciones de las órdenes | |
| 10 | Período de validez |
| 11 | Restricciones de las órdenes |
| 12 | Período de validez y hora |
| Prioridad y número de secuencia | |
| 13 | Marca de tiempo de prioridad |
| 14 | Prioridad volumen |
| 15 | Número de secuencia |
| Identificación de la orden | |
| 16 | Código MIC de segmento |
| 17 | Código de libro de órdenes |
| 18 | Código ISIN del instrumento financiero |
| 19 | Fecha de recepción de la orden original |
| 20 | Código de identificación de la orden |
| Eventos que afectan a la orden | |
| 21 | Nueva orden, modificación de orden, cancelación de orden, rechazo de orden, ejecución parcial o total |
| Tipo de orden | |
| 22 | Tipo de orden |
| 23 | Clasificación de los tipos de orden |

| Precios | |
|---|---|
| 24 | Precio límite |
| 25 | Precio límite adicional |
| 26 | Precio de stop |
| 27 | Precio límite ajustado |
| 28 | Precio de la operación |
| 29 | Moneda del precio |
| 30 | Moneda del componente 2 |
| 31 | Notación del precio |
| Instrucciones de las órdenes | |
| 32 | Indicador de compra / venta |
| 33 | Estado de la orden |
| 34 | Notación de la cantidad |
| 35 | Moneda de la cantidad |
| 36 | Cantidad inicial |
| 37 | Cantidad restante incluidas las cantidades ocultas |
| 38 | Cantidad mostrada |
| 39 | Cantidad negociada |
| 40 | Cantidad mínima aceptable |
| 41 | Volumen mínimo ejecutable |
| 42 | Volumen mínimo ejecutable solo para primera ejecución |
| 43 | Indicador solo pasiva |
| 44 | Indicador pasiva o agresiva |
| 45 | Prevención de auto ejecución |
| 46 | Identificación de orden vinculada a una estrategia |
| 47 | Estrategia de routing |
| 48 | Código de identificación de operación del centro de negociación |
| Fases de negociación y precio y volumen de subasta indicativos | |
| 49 | Fases de negociación |
| 50 | Precio de subasta indicativo |
| 51 | Volumen de subasta indicativo |

Los datos necesarios para completar el registro en el Order Record Keeping (ORK) de BME, que exige MiFID II, se obtendrán de dos fuentes:

- 1- Datos en la orden: Son informados por el miembro de mercado en la introducción de la orden por medio del SAPI o del terminal de SENAF, donde entre otros datos, se incluye la comunicación de los códigos que identifican al decisor y ejecutor dentro del miembro del mercado.
- 2- Información a facilitar por el miembro del mercado: Los miembros del mercado deberán comunicar al sistema de BME la información relativa al tipo de orden y la identificación del decisor y ejecutor (LEI, identificación de las personas físicas, algoritmo, etc.) vinculada a cada uno de los códigos contenidos en la orden.

BME llevará a cabo las validaciones pertinentes de la información recibida desde los miembros del mercado para asegurar la coherencia de los datos de las órdenes. El resultado de dichas validaciones se enviará a los miembros a través de unos ficheros específicos (ver capítulo 5 Comunicaciones).

Datos en la orden

Los siguientes campos serán informados por los Miembros de mercado en la orden.

| Número de campo | Descripción |
|---|---|
| Identificación de las partes pertinentes | |
| 1 | Identificación del Miembro que introdujo la orden |
| 4 | Código de decisión de inversión dentro del miembro |
| 5 | Código de ejecución dentro del miembro |
| 6 | Intermediario no ejecutor |
| Provisión de liquidez | |
| 8 | Actividad de provisión de liquidez |
| Identificación de la orden | |
| 17 | Código de libro de órdenes |
| Eventos que afectan a la orden | |
| 21 | Nueva orden, modificación de orden, cancelación de orden, rechazo de orden, ejecución parcial o total |
| Tipo de orden | |
| 22 | Tipo de orden |
| Precios | |
| 24 | Precio límite |
| 25 | Precio límite adicional |
| 26 | Precio de stop |
| Instrucciones de las órdenes | |
| 32 | Indicador de compra / venta |
| 36 | Cantidad inicial |
| 38 | Cantidad mostrada |
| 40 | Cantidad mínima aceptable |
| 41 | Volumen mínimo ejecutable |
| 45 | Prevención de auto ejecución |
| 46 | Identificación de orden vinculada a una estrategia |

Short codes o uso de Códigos de identificación

Los campos 4 y 5 funcionarán de forma codificada. Deben ser cumplimentados en SENAF para que la orden no sea rechazada por el mercado tal y como está definido en las especificaciones técnicas del SAPI.

Estos campos serán remitidos en la orden utilizando números enteros entre 100 y 4.294.967.295 ($2^{32}-1$) (ambos inclusive). Estos números son códigos de identificación que representan claves únicas vinculadas a una base de datos gestionada por BME.

Los miembros del mercado SENAF para completar y modificar la información correspondiente a sus órdenes registradas en el sistema de BME, lo harán mediante los siguientes 2 tipos de registros:

1. Registro tipo DW – Decisor
2. Registro tipo EW – Ejecutor

Estos registros se comunican de la siguiente forma:

- a) Mediante la utilización de los códigos de decisor y/ o ejecutor para incorporar/ modificar los datos al conjunto de órdenes donde estén implicados dichos códigos identificadores. Para ello, se usarán los registros:

Registro tipo DW – Decisor
Registro tipo EW – Ejecutor

Gestión histórica de la Base de Datos ORK

La gestión histórica de los datos del ORK consiste en una separación de la base de datos, cuya finalidad es lograr una mayor eficiencia y racionalización de la información recibida desde los miembros del mercado que, además, redunde en el proceso de consolidación diario de las órdenes introducidas en los mercados, así como en el proceso de consolidación de datos históricos.

La base de datos del ORK está dividida en dos áreas:

- **Área de trabajo:**
 - Órdenes del mes en curso y el mes anterior, independientemente de que estén completas o no.
 - Órdenes de cualquier fecha que aún no estén completamente informadas.
- **Histórico ORK:**
 - Órdenes anteriores al día 1 del mes pasado correctamente informadas.

A fin de realizar esta división, cada fin de mes se va a realizar un movimiento de órdenes y códigos cortos al Histórico ORK:

- **Órdenes:** se moverán al Histórico ORK todas aquellas órdenes anteriores al día 1 del mes anterior, que hayan quedado correctamente informadas.

- **Códigos cortos:** se moverán al Histórico ORK todos los códigos cortos utilizados en alguna orden enviada al Histórico ORK. Se informará de qué códigos se mueven al histórico mediante un fichero de tipo SHCD.

A continuación se muestran ejemplos del movimiento de órdenes que se realizaría poniendo como ejemplo que estuviéramos en el 31 de julio de 2019:

1. Orden posterior al día 1 del mes previo, que no está completa.

| NUM. ORDEN | FECHA ORDEN | VIVA | CORRECTA | HISTÓRICO |
|------------|-------------|------|----------|-----------|
| 100000001 | 25/06/2019 | NO | NO | NO |

La orden 100000001 tanto por ser posterior al día 1 del mes previo como por no estar completamente informada **no se enviará al área histórica, sino que se mantendrá en el área de trabajo.**

2. Orden anterior al día 1 del mes previo, que no está completa

| NUM. ORDEN | FECHA ORDEN | VIVA | CORRECTA | HISTÓRICO |
|------------|-------------|------|----------|-----------|
| 100000002 | 10/05/2019 | NO | NO | NO |

La orden 100000002 aunque es anterior al mes en curso, no está completa, por lo tanto **no se puede enviar al área histórica y se mantendrá en el área de trabajo.**

3. Orden del mes en curso que ya ha sido informada

| NUM. ORDEN | FECHA ORDEN | VIVA | CORRECTA | HISTÓRICO |
|------------|-------------|------|----------|-----------|
| 100000003 | 25/07/2019 | NO | SI | NO |

La orden 100000003 aunque ya está completa, al ser posterior al día 1 del mes previo, **no se envía al área histórica y se mantendrá en el área de trabajo.**

4. Orden anterior al día 1 del mes previo, que ya ha sido informada.

| NUM. ORDEN | FECHA ORDEN | VIVA | CORRECTA | HISTÓRICO |
|------------|-------------|------|----------|-----------|
| 100000004 | 17/03/2019 | NO | SI | SI |

La orden 100000004, que ya está completa, y al no ser del mes previo ni actual **se envía al área histórica.**

2. Tipos de registro

Cambios en los registros DW y EW respecto a la versión anterior

En el caso de que la información de las órdenes se quiera comunicar mediante los registros de códigos cortos (DW y EW), el miembro de mercado tendrá que tener en cuenta el nuevo funcionamiento de los registros RI, el cual supone una simplificación respecto de la versión anterior:

- **Se ha eliminado la funcionalidad de los campos de fecha** “F_Inicial” y “F_Final”, suponiendo una mayor simplicidad en el envío y gestión de la información. No obstante, la estructura del fichero queda sin modificar, por lo que esos campos deberán ir vacíos (en caso de contener información no será utilizada).

La eliminación de la funcionalidad de las fechas implica que la información de los códigos cortos enviada mediante los registros DW y EW **tendrá una vigencia permanente**.

- **El campo “TrdnVn”** (código MIC del mercado) **dejará de tener funcionalidad**. Por tanto, la información asociada a los códigos cortos enviada en los registros DW y EW se aplicará a todos los mercados (teniendo el mismo efecto que cuando se informaba este campo con un asterisco “*” en la versión anterior). La estructura del fichero queda sin modificar, por lo que este campo deberá ir vacío (en caso de contener información no será utilizada).

En consecuencia, la información enviada mediante registros DW y EW implica dar de **alta la información para todos los mercados de BME**.

- La información se podrá dar de baja tal y como se hace actualmente para los registros del Área de Trabajo, enviando el correspondiente registro DW o EW de baja. La baja implica eliminar la información asociada al código corto, dejándolo vacío sin información.

Sólo se podrán realizar bajas de información de un código corto (DW y EW) no utilizado en órdenes ubicadas en el Histórico ORK. Las solicitudes de baja de registros RI utilizados en el Histórico ORK serán rechazadas.

- Se informará de qué códigos se han movido al Histórico ORK mediante los ficheros de tipo SHCD.
- **Eliminación de registros innecesarios:** Cada fin de mes se eliminarán aquellos registros RI que, habiendo sido enviados en los últimos dos meses, no se hayan utilizado nunca en ninguna orden.

Registro DW – Decisión de inversión dentro de la empresa

Estos registros recogen la información relativa a la identificación del decisor informado en la orden, cuando la decisión de la orden haya sido tomada dentro del miembro de mercado.

Tiene la siguiente estructura:

| Nº | Campo | Dato | Descripción |
|----|-----------------|-------------------------------|--|
| 1 | TypeReg | RI | Tipo de registro de Código de Identificación. |
| 2 | Action | A-Alta/Modificación B-Baja | Indica la finalidad que tiene el registro RI. |
| 3 | ExctgPty | Identificador LEI | Código LEI de la entidad que introduce la orden. |
| 4 | Vacío | | |
| 5 | Vacío | | |
| 6 | Vacío | | |
| 7 | Identificador | | Código corto de decisor de dentro de la empresa. |
| 8 | SubRegistro | DW | Indica que el tipo de registro es de DW |
| 9 | Dcsn_typePrsn | P-Person A-Algoritmo | Tipo de decisor |
| 10 | Dcsn_Algo | Código del algoritmo | Si Dcsn_typePrsn='A'. Código del algoritmo que toma la decisión de la operación dentro del miembro. |
| 11 | Dcsn_Othr_SchNm | NIDN, CCPT, CONCAT | Si Dcsn_typePrsn='P'. Tipo de código de identificación de persona: NIDN = National ID CCPT = número de pasaporte CONCAT = código CONCAT |
| 12 | Dcsn_Othr_Id | National_ID | Si Dcsn_typePrsn='P'. National_ID de la persona que toma la decisión de la operación dentro del miembro. |

El primer envío de un registro RI-DW implica dar de alta la información del decisor de un código corto para todos los mercados desde el inicio del ORK (03-01-2018) hasta el 31-12-9999.

Cuando se envía un registro RI-DW, con un código corto de decisor que ya había sido informado previamente en otro fichero, la información del nuevo RI-DW sustituirá a la del anterior a partir del día de este envío.

En el caso de que la información enviada en un registro RI-DW asociada a un código corto sea la misma que la información que el sistema ya tiene para ese código corto, el nuevo registro RI-DW será rechazado (al ser redundante).

La información enviada previamente en registros RI-DW de alta que no estén en el histórico se puede dar de baja con registros RI-DW con el campo Action="B". Esto implica eliminar la información enviada anteriormente para ese código corto, por lo que el siguiente envío de un RI-DW se considerará como el primer envío de la información, es decir, se aplicará la información para todas las fechas en lugar de sólo desde la fecha de envío

La baja de un registro RI-DW de un código corto de decisor que haya sido utilizado en el Histórico ORK será rechazada.

Registro EW – Ejecución dentro de la empresa

Estos registros recogen la información relativa a la identificación del ejecutor de la orden dentro del miembro.

Tiene la siguiente estructura:

| Nº | Campo | Dato | Descripción |
|----|-----------------|-----------------------------------|--|
| 1 | TypeReg | RI | Tipo de registro de Código de Identificador. |
| 2 | Action | A- Alta/Modificación B-Baja | Indica la finalidad que tiene el registro RI. |
| 3 | ExctgPty | Identificador LEI | Código LEI de la entidad que introduce la orden. |
| 4 | Vacío | | |
| 5 | Vacío | | |
| 6 | Vacío | | |
| 7 | Identificador | | Código corto de ejecutor o Referencia de cliente informado en la orden. |
| 8 | SubRegistro | EW | Indica que el tipo de registro es de EW |
| 9 | Exct_typePrsn | P-Person A-Algoritmo | Tipo de ejecutor de la operación dentro del miembro. |
| 10 | Exct_Algo | Código del algoritmo | Si Dcsn_typePrsn='A'. Código del algoritmo que envía la orden al mercado dentro del miembro ejecutor. |
| 11 | Exct_Othr_SchNm | NIDN, CCPT, CONCAT | Si Dcsn_typePrsn='P'. Tipo de código de identificación de persona: NIDN = National ID CCPT = número de pasaporte CONCAT = código CONCAT |
| 12 | Exct_Othr_Id | National_ID | Si Dcsn_typePrsn='P'. National_ID de la persona que envía la orden al mercado dentro del miembro ejecutor. |

El primer envío de un registro RI-EW implica dar de alta la información del ejecutor de un código corto para todos los mercados desde el inicio del ORK (03-01-2018) hasta el 31-12-9999.

Cuando se envía un registro RI-EW, con un código corto de ejecutor que ya había sido informado previamente en otro fichero, la información del nuevo RI-EW sustituirá a la del anterior a partir del día de este envío.

En el caso de que la información enviada en un registro RI-EW asociada a un código corto sea la misma que la información que el sistema ya tiene para ese código corto, el nuevo registro RI-EW será rechazado (al ser redundante).

La información enviada previamente en registros RI-EW de alta que no estén en el histórico se puede dar de baja con registros RI-EW con el campo Action="B". Esto implica eliminar la información enviada anteriormente para ese código corto, por lo que el siguiente envío de un RI-EW se considerará como el primer envío de la información, es decir, se aplicará la información para todas las fechas en lugar de sólo desde la fecha de envío

La baja de un registro RI-EW de un código corto de ejecutor que haya sido utilizado en el Histórico ORK será rechazada.

3. Validaciones

BME realizará las siguientes comprobaciones para validar la coherencia de los datos enviados por los Miembros. Estas validaciones se harán relacionando los siguientes campos:

Los siguientes identificadores están predefinidos y fijados:

Campo 2, Acceso Electrónico Directo:

- Siempre Falso.

Campo 3, Código de identificación del cliente:

- 0. No hay cliente en esta orden (es una orden de cuenta propia).

Campo 7, Calidad en la que se actúa en la negociación:

- Siempre Deal (negociación por cuenta propia).

Los campos 4, 5 y 8 serán remitidos por la entidad en la orden para que ésta no sea rechazada:

Campo 4, Decisión de inversión dentro de la empresa:

- Siempre será un número entero comprendido entre 100 y 4.294.967.295 ($2^{32}-1$).

Campo 5. Código de ejecución dentro de la empresa:

- Siempre será un número entero comprendido entre 100 y 4.294.967.295 ($2^{32}-1$).

Campo 8, Actividad de provisión de liquidez:

- Vendrá cumplimentado como verdadero (1 en el flujo del SAPI) o falso (0 en el flujo del SAPI).

Si no se cumplen las especificaciones mencionadas para cada campo, la orden será rechazada por el sistema.

4. Horario

Datos del Miembro hacia BME

Los ficheros con los registros necesarios para completar la información dada en las órdenes se podrán enviar a cualquier hora del día al servidor SFTP habilitado.

A efectos de envío de ficheros, los ficheros recibidos después del inicio del proceso de consolidación se considerarán enviados al día siguiente, incluyéndose en el proceso de consolidación del día siguiente.

Datos de BME hacia el miembro

1. Validación del fichero de entrada INB

Los miembros del mercado recibirán un fichero OUT con la contestación de cada fichero enviado, y el resultado de las validaciones que correspondan a él. El estado del fichero se indicará en un registro FI cuyos estados se describen en la tabla 1 (pág. 21)

2. Primer fichero ORVB. Consolidación diaria:

A partir de las 23:30h de la fecha de introducción de las órdenes (fecha D) se enviará un primer fichero de tipo ORVB con la consolidación de los días D y D-1, que contendrá las ordenes e identificadores que deberían haber sido informados y las ordenes que no cumplen las validaciones de coherencia de la información

3. Segundo fichero ORVB. Consolidación histórica:

Este fichero solo se generará en el caso de que la entidad haya enviado información que aplique a órdenes fuera de plazo, es decir, aquellas enviadas al mercado antes de D-1.

El fichero se generará, a partir de las 23:30 y después de que se haya generado el primer fichero ORVB con la consolidación diaria, y solo en el caso de que durante el día se hayan enviado registros con información fuera de plazo que aplique a órdenes enviadas en fechas anteriores a D-1 (siendo D el día de envío de la orden al mercado).

En el fichero se permitirá conocer la situación de las órdenes afectadas por los registros enviados, en el caso de que hayan quedado en error.

5. Comunicaciones

Aspectos técnicos de los ficheros de entrada

Los ficheros están codificados en formato texto UTF8 con longitud de línea variable según el tipo de registro, delimitando los campos por el carácter “,”.

Los campos de tipo Texto (Char) irán entre comillas dobles. Dentro de un campo no puede haber comillas dobles.

Se especifican los siguientes tipos de datos para saber los valores máximos admitidos:

| | |
|-----------------|---|
| Decimal | Son campos numéricos donde se usa el carácter “.” (punto) para separar los decimales. Para cifras negativas se incluye el signo ‘-’ a la izquierda del primer dígito significativo. No se puede sobrepasar los dígitos significativos especificados. |
| Date | Son campos para informar fechas y tienen el formato YYYY-MM-DD |
| Datetime | Se usan para expresar fechas y hora, seguirán el formato ISO 8601 YYYY-MM-DDThh:mm:ss.ffffffZ |
| Char | Son campos texto que deben informarse con el número de caracteres especificados, rellenado con blancos a la derecha en caso de tener menos caracteres. |
| Varchar | Son campos texto que pueden informarse con los caracteres que sean necesarios sin sobrepasar el máximo especificado. |

Nomenclatura de los ficheros enviados por los Miembros

El nombre del fichero que contiene los registros long code que el Miembro desea remitir se compondrá de la siguiente manera:

INB_LEI1_LEI2_TIPO_AAAAMMDD_SEQ.EXT_MD5

- INB (3) → INBOUND. Indica que es un fichero de entrada.
- LEI1(20) → Código LEI del Miembro de mercado que realiza el envío
- LEI2 (20) → Código LEI del Miembro de mercado por el que realiza el envío. Puede ser el mismo que el LEI1 en caso de que coincida.
- TIPO(4) → Tipo de fichero: **ORK**
- AAAAMMDD (8) → Fecha de comunicación del fichero.
- SEQ (3) → Secuencia de 3 dígitos. Ejemplo: 001
- EXT(3) → Extensión del fichero: **DAT**
- MD5 (33) → Se puede incluir el hash MD5 del fichero de 32 caracteres a continuación de la extensión para poder validar que el fichero es el mismo en origen y destino.

Este fichero contendrá los registros de los distintos tipos que se definen en este documento. Cada fichero .DAT estará comprimido en un fichero .ZIP.

Como regla general, se admitirá cualquier envío del miembro de mercado. Los envíos son aditivos (excepto cuando hay un error de SINTAXIS en el contenido del fichero en cuyo caso se rechaza el fichero completo). Se permitirán múltiples cargas de ficheros.

Los ficheros de entrada al ORK se procesarán por orden de llegada. Es responsabilidad del Miembro enviarlos en el orden correcto.

Cada fichero cargado en el sistema ORK generará un fichero de respuesta a los pocos minutos, indicando si el fichero fue incorporado satisfactoriamente.

El proceso de carga de ficheros INB realizará las siguientes validaciones antes de procesar la información

- **Ficheros con nomenclatura repetida:** Si se envía un fichero con un nombre idéntico al de otro fichero enviado previamente se renombrará el fichero enviado en la carpeta *filesin* del SFTP, añadiendo el prefijo "REP_" y dicho fichero no se procesará.
- **Ficheros con el mismo contenido:** Si se envía un fichero cuyo contenido es idéntico al de otro ya enviado se renombrará el fichero enviado, en la carpeta *filesin* del SFTP, añadiendo el prefijo "MD5_" y dicho fichero no se procesará.

Nomenclatura y formato de los ficheros del ORK hacia los Miembros

El nombre del fichero que contiene los registros de información sobre el estado de los registros recibidos que ORK remite al miembro de mercado, se compondrá de la siguiente manera:

OUT_LEI1_LEI2_TIPO_AAAAMMDD_SEQ.EXT_MD5

- OUT (3) → OUTBOUND. Indica que es un fichero de salida.
- LEI1(20) → Código LEI del Miembro de mercado que realiza el envío
- LEI2 (20) → Código LEI del Miembro de mercado por el que realiza el envío. Puede ser el mismo que el LEI1 en caso de que coincida.
- TIPO(4) → Tipo de fichero: **ORK, ORVB y SHCD**
- AAAAMMDD (8) → Fecha de generación del fichero.
- SEQ (3) → Secuencia de 3 dígitos. Ejemplo: 001
- EXT (3) → Extensión del fichero: **CSV**
- MD5 (33) → Se puede incluir el hash MD5 del fichero a continuación de la extensión para poder validar que el fichero es el mismo en origen y destino.

Este fichero contiene dos tipos de registros que indican información relativa a:

1. Resultado de la validación sintáctica y de contenido de los registros RI o RC.
2. Resultado de las validaciones realizadas en el proceso de consolidación de los datos en la orden y la información a facilitar por el miembro del mercado.

Limite en el tamaño de los ficheros de respuesta ORK y ORVB:

Los ficheros de respuesta mostrarán hasta un máximo de 10 mil mensajes. Si debido al número de errores, se superara este límite, en la última línea se mostrará un mensaje informando que el número de errores supera el límite del fichero:

“There are errors that are not displayed. Number of messages has exceeded the limit”

Registros FI

Este registro contiene información relativa al GLOBAL del fichero.

Su estructura es la siguiente:

| Nº | Campo | Dato | Descripción |
|----|---------------------|---------------|---|
| 1 | TypeReg | FI | Tipo de registro |
| 2 | Origin | | ORK: Sistema ORK BME |
| 3 | CreDT | | Fecha de envío |
| 4 | ExctgPty | LEIIdentifier | LEI del Miembro |
| 5 | FileName | | Nombre del fichero INB enviado por el miembro |
| 6 | Sts | | Estatus (Tabla 1) |
| 7 | TtINbOfRcrds | | Número total de registros |
| 8 | stACTP | | Número de registros aceptados |
| 9 | stPDNG | | Número de registros pendientes |
| 10 | stRJCT | | Número de registros rechazados |
| 11 | stRCVD | | Número de registros recibidos |

Tabla 1:

| StatusCode | Name | Definition |
|------------|--------------------|---|
| ACPT | Accepted | El reporte ha sido aceptado |
| CRPT | Corrupted File | El fichero está corrupto |
| INCF | Incorrect Filename | El nombre del fichero es incorrecto |
| PART | Partially Accepted | Reporte parcialmente aceptado. Algunos registros han sido aceptados y otros no lo han sido. |
| RJCT | Rejected | Todo el reporte ha sido rechazado. |
| MISS | Missing records | El reporte ha sido aceptado, pero faltan registros. |

Registros VA

Este tipo de registros contienen información de BME hacia el Miembro, relativa al tratamiento que BME ha realizado de un fichero remitido por el Miembro, indicando el detalle de los errores de validación encontrados.

Los registros FI y VA se procesarán en orden, ya que todos los registros VA consecutivos se relacionan con el registro FI inmediatamente superior.

Su estructura es la siguiente:

| Nº | Campo | Dato | Descripción |
|----|------------------|------|--|
| 1 | TypeReg | VA | Tipo de registro |
| 2 | | | Vacío |
| 3 | Origin | | Origen de la información de respuesta. |
| 4 | LineNum | | Nº de línea del fichero original donde está el error |
| 5 | Sts | | Estado (Tabla 1) |
| 6 | RuleId | | Id regla de validación |
| 7 | FieldNm | | Nombre del Campo en el que da el error |
| 8 | IdRTS | | Campo relacionado con formato de RTS 22. |
| 9 | ErrCd | | Código de error |
| 10 | ErrMssg | | Mensaje del error en formato texto |
| 11 | OrgnValue | | Valor original |

Tabla de códigos de error:

| CODIGO | DEFINICION |
|-------------|---|
| 1055 | DA record Ending Date must be prior to D-1 |
| 2001 | Orders with this short code has not its associated information for this date |
| 2002 | This order has code 5 in Client field, but its information has not been submitted in a RC record. |
| 2003 | This order has code 5 in Decision field, but its information has not been submitted in a RC record. |
| 2004 | This order has code 5 in Executor field, but its information has not been submitted in a RC record. |
| 2011 | Order has no client, there has to be decision within the firm and capacity cannot be AOTC |
| 2012 | The order has a Client, capacity cannot be DEAL |
| 2013 | DEA order. There must be a Client, there is no Decision within the firm and capacity will have to be AOTC |
| 2014 | If Client executes the order, the holder cannot be the market member, there is not decision within firm and capacity has to be AOTC |
| 2015 | Client short code cannot be a number below 100 |
| 2016 | Decision maker short code cannot be a number below 100 |
| 2017 | Executor short code cannot be a number below 100 |
| 2101 | The RC register does not match with any order available in the current Data Base |
| 2102 | RC record has additional data fields that cannot amend an order that is still in the market and must be amended through the GUI |
| 2103 | DA record cannot be associated to any order |
| 2104 | DA record has additional data fields that cannot amend an order that is still in the market and must be amended through the GUI |
| 2105 | RI record cannot be associated to any order |
| 2107 | RC record has found an order and has been consolidated correctly |

| | |
|----------------|--|
| 2108 | DA record has found orders and has been consolidated correctly |
| 2109 | RI record has found orders and has been consolidated correctly |
| ACPT | All orders information has been consolidated correctly |
| CON-048 | The value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers. |
| CON-074 | The format of the buyer identification code is incorrect |
| CON-077 | If person national identifier is used, only one of the following values can be populated: 'NIDN', 'CCPT', 'CONCAT' |
| CON-078 | If LEI is used, the value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers. / If national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If MIC is used, the value should be a string of 4 characters (letters or numbers). / For internal, the 'INTC' code should be reported. |
| CON-164 | The format of the seller code is incorrect |
| CON-168 | If LEI is used, the value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers. / If national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If MIC is used, the value should be a string of 4 characters (letters or numbers). / For internal, the 'INTC' code should be reported. |
| CON-297 | Only one of the following values can be populated: 'DEAL', 'MTCH', 'AOTC'. |
| CON-368 | The reported value should be a string of 4 characters (letters or numbers). / |
| CON-573 | If person national identifier is used, the first 2 characters of the national identification code should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date |
| CON-574 | The format of the executing person code is incorrect |
| CON-577 | If person national identifier is used, only one of the following values can be populated: 'NIDN', 'CCPT', 'CONCAT' |
| CON-578 | In case an algorithm identifier is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters (A-Z), numbers (0-9). |
| CON-590 | The national identification code does not include valid country code |
| CON-591 | The format of the executing person code is incorrect |
| CON-597 | If person national identifier is used, only one of the following values can be populated: 'NIDN', 'CCPT', 'CONCAT' |
| CON-598 | In case an algorithm identifier is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters (A-Z), numbers (0-9). |
| CON-807 | Only 'B' or 'S' values allowed (Buy/Sell) |
| CON-857 | Only one of the following values can be populated: 'LEI', 'MIC', 'P', 'INTC' |
| CON-867 | Only one of the following values can be populated: 'LEI', 'P' |
| CON-897 | Data should be one of the following: P=Person; A=Algoritm |
| CON-907 | The format should be one of the following: P=Person; A=Algoritm |
| CON-917 | Only 'A' or 'B' values allowed (A-Registration/B-Deregistration) |
| CON-927 | Only one of the following values can be populated: 'LEI', 'P', 'PNAL', 'AGGR', 'N' |

| | |
|----------------|--|
| CON-937 | Only one of the following values can be populated: 'ORD', 'QUO', 'BLO', 'RFQ', 'PLV', 'FON' |
| CON-950 | Date time must be the same or before the system date time. |
| CON-951 | Trading date cannot be earlier than the agreed date of the first trading date to be reported under MiFIR or earlier than 5 years before the current date. |
| CON-967 | Only 'True' or 'False' values allowed |
| CON-977 | Only 'True' or 'False' values allowed |
| CON-987 | Only 'CT', 'DW' or 'EW' values allowed |
| CTR-046 | Submitting / Executing LEI not allowed by BME. Please check registration |
| CTR-070 | LEI XXX is not valid |
| CTR-071 | If person national identifier is used, the first 2 characters of the national identification code should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date |
| CTR-160 | If LEI is used, this field shall be populated with a LEI accurately formatted and in the LEI database included in the GLEIF database maintained by the Central Operating Unit. / 1. The status of the LEI shall be "Issued", "Lapsed", "Pending transfer" or "Pending archival". / 2. The InitialRegistrationDate of the LEI shall be equal or before the trading date. / 3. The EntityStatus shall be Active or if the EntityStatus is Inactive, the LastUpdateDate shall be equal or after the trading date. |
| CTR-161 | If national identifier is used, the first 2 characters of the national identification code should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date |
| CTR-362 | Not authorised MIC |
| CTR-701 | Deregistration Action. No Registration record was found or it was rejected |
| CTR-761 | Field should be a text string of no more than 10 characters |
| CTR-763 | Short code. RI short code cannot be a number below 100 |
| CTR-764 | Field should not be greater than 4.294.967.295 |
| CTR-765 | Wrong client short code, please submit a RC record to provide client information |
| CTR-766 | The RI register has been used in orders previous to the current Data Base |
| CTR-869 | This client has already been submitted |
| CTR-900 | Short code not allowed, it must be above 100 |
| CTR-900 | Short code not allowed, it must be above 100 |
| CTR-911 | Deregistration Action. No Registration record was found or it was rejected |
| CTR-955 | Date must be a trading date |
| CTR-956 | Initial date cannot be after Final Date |
| DAR-001 | The DA register has been used in orders previous to the current Data Base |
| DWR-765 | Wrong decisión maker short code, please submit a RC record to provide decision maker information |
| DWR-766 | The RI register has been used in orders previous to the current Data Base |
| DWR-909 | This decisor has already been submitted |

| | |
|-----------------|--|
| EWR-765 | Wrong executor short code, please submit a RC record to provide executor information |
| EWR-766 | The RI register has been used in orders previous to the current Data Base |
| EWR-899 | This ejecutor has already been submitted |
| NOORDERS | No order has been submitted to the market |
| STA-001 | File containing the report has an incorrect filename. |
| STA-002 | File containing the report is corrupted. |
| STA-004 | Error Parser CSV. Check that limiters and the file is codified as UTF8 |
| STA-005 | Error in the de-encryption. Check you have used the BME public key. |
| STA-006 | File containing the report has an incorrect filename. LEI of the member sending the file |
| STA-007 | File containing the report has an incorrect filename. LEI of the member on behalf of which the file is being sent |
| STA-008 | File containing the report has an incorrect filename. File type |
| STA-009 | File containing the report has an incorrect filename. File communication date |
| STA-010 | File containing the report has an incorrect filename. Sequence |
| STA-011 | File containing the report has an incorrect filename. File extension DAT / XML |
| STA-012 | File containing the report has an incorrect filename. File extension gpg |
| STA-013 | File containing the report has an incorrect filename. MD5 |
| STA-014 | File containing the report has an incorrect filename. INBOUND |
| STA-015 | File containing the report has an incorrect filename. Content zip file |
| STA-016 | File containing the report has an incorrect filename. File extension zip |
| STA-045 | ExctgPty LEI code cannot be different from filename ExctgPty LEI code |
| STA-971 | Wrong register type |
| STA-990 | Record type does not exist |
| STA-991 | Number of fields in your register do not match with the requested. |
| STR-925 | RC record with no information added |
| STX-040 | ExctgPty. Field is mandatory |
| STX-042 | Field should be a text string of no more than 20 characters |
| STX-070 | Client identification. Field is mandatory |
| STX-072 | If LEI is used, the value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers. / If national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If MIC is used, the value should be a string of 4 characters (letters or numbers). / For internal, the 'INTC' code should be reported. |
| STX-073 | Field should be a text string of no more than 6 character |
| STX-160 | Client identification. Field is mandatory |
| STX-162 | If LEI is used, the value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers. / If national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If MIC is used, the value should be a string of 4 characters (letters or numbers). / For internal, the 'INTC' code should be reported. |

| | |
|----------------|---|
| STX-163 | Field should be a text string of no more than 6 character |
| STX-292 | Field should be a text string of no more than 4 characters |
| STX-360 | MIC code. Field is mandatory |
| STX-362 | Field should be a text string of no more than 4 characters |
| STX-572 | If national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If algorithm identifier is used, the value should be a string of no more than 50 characters. |
| STX-573 | If person national identifier is used, it should be restricted to a passport number (use of code CCPT in the SchmeNm/Cd tag), other national identifier as defined in RTS Annex 2 (use of code NIDN in the SchmeNm/Cd tag) or CONCAT (use of proprietary with value CONCAT in the SchmeNm/Prtry tag). |
| STX-592 | If person national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If algorithm identifier is used, the value should be a string of no more than 50 characters. |
| STX-593 | If national identifier is used, it should be restricted to a passport number (use of code CCPT in the SchmeNm/Cd tag), other national identifier as defined in RTS Annex 2 (use of code NIDN in the SchmeNm/Cd tag) or CONCAT (use of proprietary with value CONCAT in the SchmeNm/Prtry tag). / |
| STX-760 | Shortcode. Field is mandatory. |
| STX-762 | The reported value should be a string of 20 characters |
| STX-800 | BuySell. Field is mandatory. |
| STX-802 | Field should be a text string of no more than 1 characters |
| STX-850 | Action. Field is mandatory. |
| STX-852 | Field should be a text string of no more than 4 characters |
| STX-862 | Field should be a text string of no more than 4 characters |
| STX-892 | Field should be a text string of no more than 1 characters |
| STX-900 | Decision maker type. Field is mandatory. |
| STX-902 | Field should be a text string of no more than 1 characters |
| STX-922 | Field should be a text string of no more than 1 characters |
| STX-930 | Order type. Field is mandatory. |
| STX-932 | Field should be a text string of no more than 3 character |
| STX-940 | OrderID. Field is mandatory. |
| STX-942 | Field should be a text string of no more than 12 character |
| STX-950 | Date. Field is mandatory. |
| STX-952 | Field must be populated with a valid date in the following format: YYYY-MM-DD |
| STX-962 | Field should be a text string of no more than 1 character |
| STX-972 | Field should be a text string of no more than 1 character |
| STX-980 | Shortcode type. Field is mandatory. |
| STX-982 | Field should be a text string of no more than 2 characters |
| STR-926 | There are errors that are not displayed. Number of messages has exceeded the limit of 10.000 |

Registros VB

Este tipo de registros contienen información de BME hacia el Miembro, relativa al estado en que quedan las órdenes y se genera después de las 23:30h, una vez se ha completado el proceso de unificar la información recibida en la orden y en los ficheros facilitados por el miembro

Su estructura es la siguiente:

| Nº | Campo | Dato | Descripción |
|----|-------------------|------------------------------|---|
| 1 | TypeReg | VB | Tipo de registro |
| 2 | Fecha | YYYY-MM-DD | Fecha de la orden cuya información está incompleta. (Solo si es RC). Si no en blanco |
| 3 | Tipo_Err | RI, VA | Indica si está incompleta por: <ul style="list-style-type: none"> • RI: se ha utilizado un identificador para el que no se han facilitado datos posteriores. • RC: se ha utilizado el código 5 en la orden y no se ha remitido la información mediante un registro RC. No en SENAF • VA: indica que la orden tiene un error de coherencia. |
| 4 | Tipo_RI | CT, DW, EW | Si Tipo_Err='RI', informará sobre el tipo de identificador que es necesario remitir y no ha sido remitido |
| 5 | Tipo_Ord | ORD, QUO, BLO, RFQ, PLV, FON | Si Tipo_Err='RC' informará sobre el tipo de orden para la que no se ha remitido la información necesaria. |
| 6 | BuySell | B-Buy S-Sell | Si Tipo_Err='RC' informará sobre el sentido de la orden para la que no se ha remitido la información necesaria. (Solo si es RC) |
| 7 | Id | | Número de orden si es RC y código corto del registro si es RI. |
| 8 | ErrCd | | Código de Error |
| 9 | ErrDscrptn | | Descripción del error |

Ficheros SHCD

Los ficheros SHCD se generarán cada inicio de mes en la carpeta filesout del SFTP.

La finalidad de estos ficheros es informar de qué códigos cortos han sido movidos al área histórica.

| Nº | Campo | Dato | Descripción |
|----|----------------------|------------|--|
| 1 | ExctgPty | Código LEI | Código LEI de la entidad que introduce la orden |
| 2 | SubRegistro | CT/ DW/ EW | Indica el tipo de código corto que se muestra en el siguiente campo: CT=Cliente DW=Decisor EW=Ejecutor |
| 3 | Identificador | | Código corto que se ha enviado al área histórica |
| 4 | Fecha | aaaaMMdd | Fecha en la que se realiza el movimiento al área histórica |
| 5 | Tipo | H/ D | Cambio de situación del código corto: H: el código corto se ha movido al área histórica D: el código corto se ha eliminado por no haber sido utilizado en ninguna orden en los últimos dos meses |

6. Correcciones

Es responsabilidad del miembro de mercado notificar los datos relativos a órdenes relacionadas con instrumentos financieros, según el Reglamento Delegado (UE) 2017/580, antes de fin de día de D+1.

En términos de ORK, la actualización de cualquier campo de una orden implica un nuevo apunte en su historia y la consolidación de los nuevos datos aportados para sucesivas anotaciones de la misma. Por lo tanto, quedarán tanto los registros originales como la notificación de cambio sobre aquellos registros.

Dado que el ORK se alimenta de las órdenes introducidas en mercado, mientras una orden permanezca en el mercado toda modificación debe ser realizada en el mercado. Esta modificación fluirá hacia el ORK de forma natural (igual que lo hace por ejemplo la introducción de una orden nueva).

Por tanto, las correcciones descritas en este capítulo se podrán utilizar **una vez la orden ya no esté en el mercado**. Mientras la orden esté en el mercado, las correcciones al ORK no producen efecto sobre la orden de mercado.

Asimismo, cuando una orden haya pasado al Histórico ORK (ver punto “Gestión histórica de datos del ORK” dentro del apartado 1) no podrá ser modificada.

Campos susceptibles de ser modificados en una corrección

A continuación se presenta la relación de campos de ORK potencialmente modificables:

| Número de campo ORK | Descripción |
|---------------------|--|
| 4 | Decisión de inversión dentro de la empresa |
| 5 | Ejecución dentro de la empresa |
| 8 | Actividad de provisión de liquidez |

Método de actuación

En el caso de SENAF no existen registros RC por lo que no se pueden corregir individualmente los campos potencialmente modificables.

Para cambios en los campos 4 y 5 de órdenes que estén en el área de trabajo, habrá que enviar un RI de baja y posteriormente un nuevo RI de alta con los datos correctos.

En el caso de querer modificar el campo 8, habría que enviar un correo a supervisionsenaf@grupobme.es y el departamento de Supervisión gestionaría el cambio internamente.

No se podrán modificar los campos de órdenes que ya estén en la base de datos Histórica.

7. Ejemplos

Ejemplo 1. Se corresponde con el ejemplo 43 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452

Un operador supervisado por su oficina principal de una Entidad americana, la Entidad F con LEI 549300ASTRCPTXGNEI40 con sucursales en Paris (FR), Londres (GB) y Frankfurt (DE) decide comprar cierto instrumento financiero. La transacción es ejecutada por el operador en el mercado con MIC XMRV. La membresía de la entidad F se tiene mediante su sucursal en Frankfurt. La firma está negociando por cuenta propia.

El operador de la Entidad F introducirá en la boleta de la orden el código 0 en el campo "Identificador de cliente" ya que la entidad está actuando por cuenta propia. Al usar un código predefinido, no será necesario que mande un registro RI-CT asociado al cero.

Los identificadores short code DW y EW suponemos que son el 120 y 125 respectivamente, para los que deberá enviar un long code asociado con el siguiente formato:

| Nº | Campo | REGISTRO RI-DW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300ASTRCPTXGNEI40 |
| 4 | Vacío | |
| 5 | Vacío | |
| 6 | Vacío | |
| 7 | Identificador | 120 |
| 8 | SubRegistro | DW |
| 9 | Dcsn_typePrsn | P |
| 10 | Dcsn_Algo | |
| 11 | Dcsn_Othr_SchNm | CONCAT |
| 12 | Dcsn_Othr_Id | US19770912JON#DEWIT |

| Nº | Campo | REGISTRO RI-EW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300ASTRCPTXGNEI40 |
| 4 | Vacío | |
| 5 | Vacío | |
| 6 | Vacío | |
| 7 | Identificador | 125 |
| 8 | SubRegistro | EW |
| 9 | Exct_typePrsn | P |
| 10 | Exct_Algo | |
| 11 | Exct_Othr_SchNm | CONCAT |
| 12 | Exct_Othr_Id | HU19800413ADAM#JONES |

*Los datos sombreados se han supuesto para los ejemplos, no vienen en el enunciado.

Ejemplo 2. Se corresponde con el ejemplo 82 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452

La Empresa de Servicios de Inversión (ESI) X (cliente por DEA) que tiene LEI 12345678901234500000 usa el código de miembro de la ESI Y (proveedor de DEA) que tiene LEI 549300P0EH641RMF7T94 para remitir una orden al mercado regulado M que tiene MIC XMRV. La orden de la ESI X consiste en la compra de instrumentos financieros en el mercado M. La ESI X actúa en nombre del Cliente 1 llamado Jean Cocteau, cuyos detalles son transmitidos a la ESI Y con arreglo al artículo 4 del RTS 22. El algoritmo 123456789 es el responsable de la ejecución.

El operador de la ESI introducirá en la boleta de la orden los identificadores short codes CT y EW únicamente ya que no ha habido decisor dentro de la firma (DW). Para este caso suponemos que son los identificadores 122 y 159 respectivamente para los que deberá enviar un long code asociado con el siguiente formato:

| Nº | Campo | REGISTRO RI-CT |
|----|---------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300P0EH641RMF7T94 |
| 4 | Vacío | |
| 5 | Vacío | |
| 6 | Vacío | |
| 7 | Identificador | 122 |
| 8 | SubRegistro | CT |
| 9 | PType | P |
| 10 | LEI | |
| 11 | Prsn_SchmeNm | CONCAT |
| 12 | Prsn_Id | FR19620604JEAN#COCTE |

| Nº | Campo | REGISTRO RI-EW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300P0EH641RMF7T94 |
| 4 | Vacío | |
| 5 | Vacío | |
| 6 | Vacío | |
| 7 | Identificador | 159 |
| 8 | SubRegistro | EW |
| 9 | Exct_typePrsn | A |
| 10 | Exct_Algo | 123456789 |
| 11 | Exct_Othr_SchNm | |
| 12 | Exct_Othr_Id | |

*Los datos sombreados se han supuesto para los ejemplos, no vienen en el enunciado.

Ejemplo 3. Se corresponde con el ejemplo 65 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452

El Trader 1 toma la decisión de comprar un instrumento financiero para el Cliente A bajo un mandato discrecional del Cliente A y el Trader 2 introduce la orden con la firma de inversión Y para comprar el instrumento. La firma de inversión Y actuando con capacidad matched principal, ejecuta la orden en el mercado M el 1 de junio de 2018 a las 14:51:09.123 a un precio de 32.50 EUR usando un algoritmo cuyo identificador es: ALGO12345.

El operador de la Entidad Y introducirá en la boleta de la orden los identificadores short codes CT, DW y EW, que para este caso suponemos que son los identificadores 188, 114 y 127 respectivamente para los que deberá enviar un long code asociado con el siguiente formato:

| Nº | Campo | REGISTRO RI-CT |
|----|---------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 5493007EY8MYC8PNZP26 |
| 4 | Vacío | |
| 5 | Vacío | |
| 6 | Vacío | |
| 7 | Identificador | 188 |
| 8 | SubRegistro | CT |
| 9 | PType | LEI |
| 10 | LEI | 123456123456123 |
| 11 | Prsn_SchmeNm | |
| 12 | Prsn_Id | |

| Nº | Campo | REGISTRO RI-DW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 5493007EY8MYC8PNZP26 |
| 4 | Vacío | |
| 5 | Vacío | |
| 6 | Vacío | |
| 7 | Identificador | 114 |
| 8 | SubRegistro | DW |
| 9 | Dcsn_typePrsn | P |
| 10 | Dcsn_Algo | |
| 11 | Dcsn_Othr_SchNm | CONCAT |
| 12 | Dcsn_Othr_Id | ES12345678TRADER#UNO |

| Nº | Campo | REGISTRO RI-EW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 5493007EY8MYC8PNZP26 |
| 4 | Vacío | |
| 5 | Vacío | |
| 6 | Vacío | |
| 7 | Identificador | 127 |
| 8 | SubRegistro | EW |
| 9 | Exct_typePrsn | A |
| 10 | Exct_Algo | ALGO12345 |
| 11 | Exct_Othr_SchNm | |
| 12 | Exct_Othr_Id | |

*Los datos sombreados se han supuesto para los ejemplos, no vienen en el enunciado.

Ejemplo 4. Orden de renta variable agregada informando de referencia titular.

La entidad E1 recibe una solicitud de venta de 9000 títulos del Cliente A con referencia de titular 1234567890123456789 y de 1000 títulos del Cliente B con referencia de titular ABCDEFGHIJKLMNOPQRST para cerrar sus posiciones abiertas en acciones sobre TELEFONICA.

La Entidad E1 realiza una operación por cuenta propia en el mercado XMAD de venta de 10.000 acciones de TELEFONICA. La Entidad utiliza varios algoritmos que se encargan tanto de la decisión de la operación como de su envío al mercado.

El operador de la Entidad E1 introducirá en la boleta de la orden los identificadores short codes CT, DW y EW. Para el primero, dado que es una orden agregada, deberá rellenar el campo con el valor 1 (valor pre asignado a las órdenes agregadas AGGR). Para el resto, en este caso suponemos que son los identificadores 222 y 333 respectivamente para los que deberá enviar un long code asociado con el siguiente formato:

| Nº | Campo | REGISTRO RI-DW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300470IY7S220K805 |
| 4 | Vacío | |
| 5 | Vacío | |
| 6 | Vacío | |
| 7 | Identificador | 222 |
| 8 | SubRegistro | DW |
| 9 | Dcsn_typePrsn | A |
| 10 | Dcsn_Algo | 1234ALGO |
| 11 | Dcsn_Othr_SchNm | |
| 12 | Dcsn_Othr_Id | |

| Nº | Campo | REGISTRO RI-EW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300470IY7S220K805 |
| 4 | Vacío | |
| 5 | Vacío | |
| 6 | Vacío | |
| 7 | Identificador | 333 |
| 8 | SubRegistro | EW |
| 9 | Exct_typePrsn | A |
| 10 | Exct_Algo | 456ALGO |
| 11 | Exct_Othr_SchNm | |
| 12 | Exct_Othr_Id | |

*Los datos sombreados se han supuesto para los ejemplos, no vienen en el enunciado.

Ejemplo 5. Informar una operación individualmente mediante el registro RC.

La entidad de servicios de inversión X envía una orden de compra al mercado XMAD de compra de 1000 títulos para el cliente A. El cliente A ha otorgado un poder de representación a la entidad de asesoramiento E. La entidad de servicios de inversión X ha realizado en envío de la orden al mercado M mediante el algoritmo "1234ALGO".

La orden se introduce en el sistema utilizando el short code 5 en los campos de "Identificación del Cliente", "Decisor de dentro de la empresa" y "Ejecutor de dentro de la empresa". La orden queda recibida en el mercado con el IdOrden número 1237.

Posteriormente, la entidad X remite el siguiente registro RC.

| Nº | Campo | REGISTRO RC |
|----|--------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RC |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctPty | 5493007EY8MYC8PNZP26 |
| 4 | MIC | XMAD |
| 5 | TipoOrden | ORD |
| 6 | IdOrden | 12377412 |
| 7 | Fecha | 2018-02-01 |
| 8 | BuySell | B |
| 9 | PType | P |
| 10 | LEI | |
| 11 | Prsn_SchmeNm | NIDN |

| | | |
|----|-----------------|-----------|
| 12 | Prsn_Id | ES456789V |
| 13 | Dcsn_typePrsn | N |
| 14 | Dcsn_Algo | |
| 15 | Dcsn_Othr_SchNm | |
| 16 | Dcsn_Othr_Id | |
| 17 | Exct_typePrsn | A |
| 18 | Exct_Algo | ALGO12345 |
| 19 | Exct_Othr_SchNm | |
| 20 | Exct_Othr_Id | |
| 21 | DEA | |
| 22 | TradCap | |
| 23 | LiqProvAct | |

ANEXO 1: Formato de Campos

Formato registro RI. Registro por Identificador

| Nº | RT S 22 | Campo | Tipo | Long | Dato |
|----|---------------|-------------|------|------|--|
| 1 | | TypeReg | Char | 2 | RI |
| 2 | | Action | Char | 1 | A-Alta/Modificación B-Baja |
| 3 | 4 | ExctgPty | Char | 20 | Código LEI de la entidad que ejecuta la operación. |
| 4 | | Vacío | | | |
| 5 | | Vacío | | | |
| 6 | | Vacío | | | |
| 7 | | Id | Char | 20 | ClientID cuando el subregistro es CT DcsnwFirm cuando el subregistro es de tipo DW (todos) ExctwFirm cuando el subregistro es de tipo EW (todos) |
| 8 | | SubRegistro | Char | 2 | Indica el tipo de registro que esta cabecera antecede CT, DW o EW |

Formato SubRegistro CT de Clientes

| Nº | RT S 22 | Campo | Tipo | Long | Dato |
|----|---------------|--------------|------|------|--|
| 1 | | SubRegistro | Char | 2 | CT |
| 2 | | PType | Char | 4 | LEI, MIC, P, INTC. Tipo de identificación del comprador o vendedor. Cuando la operación sea agregada se informará INTC. |
| 3 | 7,16 | LEI | Char | 20 | Si PType=LEI. Código LEI del cliente persona jurídica. En el supuesto de que el identificador sea un ordenante (caso de gestoras) será el LEI de la gestora. |
| 4 | 7,16 | Prsn_SchmeNm | Char | 6 | Si PType=P. Tipo de identificación de la persona física. NIDN,CCPT,CONCAT |
| 5 | 7,16 | Prsn_Id | Char | 35 | Si PType=P. Código de identificación del cliente. DNI para España |

Formato SubRegistro DW de decisores “within the firm”

| Nº | RTS 22 | Campo | Tipo | Long | Dato |
|----|--------|-----------------|------|------|--|
| 1 | | SubRegistro | Char | 2 | DW |
| 2 | 57 | Dcsn_typePrsn | Char | 1 | P-Person A-Algorithm |
| 3 | 57 | Dcsn_Algo | Char | 50 | Si Dcsn_typePrsn='A'. Código del algoritmo que toma la decisión de la operación dentro de la entidad. |
| 4 | 57 | Dcsn_Othr_SchNm | Char | 6 | Si Dcsn_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID. NIDN, CCPT, CONCAT |
| 5 | 57 | Dcsn_Othr_Id | Char | 35 | Si Dcsn_typePrsn='P'. National_ID de la persona que toma la decisión de la operación dentro de la entidad. |

Formato SubRegistro EW de ejecutores “within the firm”

| Nº | RTS 22 | Campo | Tipo | Long | Dato |
|----|--------|-----------------|------|------|--|
| 1 | | SubRegistro | Char | 2 | EW |
| 2 | 59 | Exct_typePrsn | Char | 1 | P-Person A-Algorithm C-Client |
| 3 | 57 | Exct_Algo | Char | 50 | Si Exct_typePrsn='A'. Código del algoritmo que ejecuta la operación dentro de la entidad. |
| 4 | 59 | Exct_Othr_SchNm | Char | 6 | Si Dcsn_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID |
| 6 | 59 | Exct_Othr_Id | Char | 35 | Si Dcsn_typePrsn='P'. National_ID de la persona que envía la orden al mercado dentro del miembro ejecutor. |