Servicio de Transaction Reporting de los mercados de BME

STR v 2.1

Contenido

1 SERVICIO DE *TRANSACTION REPORTING* DE LOS MERCADOS DE BME 5

Introducción 5

Comunicación de los registros de *Transaction Reporting* a la autoridad competente 8

2 FLUJO DE FICHEROS DEL SERVICIO DE REPORTE DELEGADO 9

Organización de la información de los registros 9

RO, Registro por Operación 9

RI, Registro de Identificador 10

Funcionamiento de los registros mediante Identificador (RI) 12

Detalle del registro tipo TP 14

Detalle de registro tipo CT 17

Detalle de registro tipo DT 18

Detalle de registro tipo TS 20

Detalle de registro tipo DW 20

Detalle de registro tipo EW 21

Detalle de registro tipo DR 22

3 VALIDACIONES DE LOS REGISTROS REALIZADAS POR EL STR 25

Validaciones de ESMA 25

Validaciones de BME 25

4 HORARIOS 30

Horarios para enviar información 30

Horarios para la recepción de información 30

Esquema general 30

5 COMUNICACIONES 31

Aspectos técnicos de los ficheros de entrada 31

Nomenclatura de los ficheros del Miembro de mercado hacia el STR 31

Sensitivity: C2 Internal

Nomenclatura y formato de los ficheros del STR hacia el Miembro de mercado 33
Registros FI 34
Registros VA 36
Concepto de consolidación 37
Consolidación Previa 37
Casos Especiales sobre información no enviada todavía a CNMV 38

6 CORRECCIONES 39

Ficheros de requerimientos 40

7 EJEMPLOS 49

Ejemplo 1. Se corresponde con el ejemplo 43 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452 49
Ejemplo 2. Se corresponde con el ejemplo 82 de los Guidelines de ESMA. 52
Ejemplo 3. Corresponde con ej. 65 para Investment Firm y Guidelines ESMA. 55
Ejemplo 4. 59
Ejemplo 5. 68
Ejemplo 6.1. Corresponde con ejemplo 70 de Guidelines de ESMA. 72
Ejemplo 6.2. Corresponde con ejemplo 71 de Guidelines de ESMA. 80
Ejemplo 7. Operación sobre instrumentos de energía en el mercado de MEFF*Power* 84
Ejemplo 8. Operación de una gestora de fondos 87
7.1 Ficheros de texto plano de ejemplo 90

ANEXO 1: FORMATO DE CAMPOS 91

Formato registro TP 91
Prefijos 94
Formato registro RO. Registro por operación 94
Formato registro RI. Registro por identificador 95
Subregistros 96
Formato SubRegistro CT de clientes 96
Formato Subregistro DT de Decisores de un cliente 97
Formato SubRegistro DW de decisores *Within Firm* 98
Formato SubRegistro EW de ejecutores *Within Firm* 99
Formato subregistro DR de otros datos 100

Sensitivity: C2 Internal

Formato SubRegistro TS de transmisión 101

ANEXO 2: VERIFICACIONES DE ESMA 102

Sensitivity: C2 Internal

Modificaciones al documento ver 1.2

- El registro TP y CT de las operaciones XOFF van a ser comunicados por el miembro.
- El registro CT de las operaciones de mercado pasará a ser comunicado por el miembro.
- El ID del *Transaction Reporting* del mercado de renta variable se va componer igual que en los mercados de RF y MEFF.
- PTI únicamente enviará al STR un registro TP en aquellas operaciones derivadas de eventos corporativos.
- Eliminación de los períodos de comunicación de corrección de operaciones.
- Especificaciones de los ficheros de requerimientos de la CNMV.

Modificaciones al documento ver 2.0

- Nuevas validaciones de BME para el indicador de Short selling y fichero de remisión complementaria.

Sensitivity: C2 Internal

1 Servicio de *Transaction Reporting* de los mercados de BME

Introducción

El presente documento tiene el objetivo de describir el funcionamiento del servicio de Transaction Reporting, que va a ser proporcionado por los mercados de BME, acorde con las exigencias de MiFID II.

MiFID II exige que para cada operación realizada con productos financieros, toda ESI (y todo Mercado para aquellas ESIs que no pertenezcan a la Unión Europea) realice un reporte que incluya los siguientes campos:

NÚMERO DE CAMPO RTS 22	DESCRIPCIÓN
1	Report Status.
2	Transaction reference number.
3	Trading venue transaction identification code.
4	Executing entity identification code.
5	Investment firm covered by Directive 2014/65/EU.
6	Submiting entity identification code.
DATOS DEL COMPRADOR	
7	Buyer identification code.
8	Country of the branch for the buyer.
9	Buyer First Name.
10	Buyer Surname.
11	Buyer Date of birth.
DATOS DEL DECISOR EN NOMBRE DEL COMPRADOR	
12	Buyer decision maker code.
13	Buy decision maker, First name.
14	Buy decision maker, Surname.
15	Buy decision maker, Date of birth.
DATOS DEL VENDEDOR	
16	Seller identification code.
17	Country of the branch for the Seller.
18	Seller First Name.

Sensitivity: C2 Internal

19	Seller Surname.
20	Seller Date of birth.
DATOS DEL DECISOR EN NOMBRE DEL VENDEDOR	
21	Seller decision maker code.
22	Sell decision maker, First name.
23	Sell decision maker, Surname.
24	Sell decision maker, Date of birth.
DATOS DE LA TRANSMISIÓN	
25	Transmission of order indicator.
26	Transmitting firm identification code for the buyer.
27	Transmitting firm identification code for the seller.
DATOS DE LA OPERACIÓN	
28	Trading date time.
29	Trading capacity.
30	Quantity.
31	Quantity Currency.
32	Derivative notional increase / decrease.
33	Price.
34	Price Currency.
35	Net amount.
36	Venue.
37	Country of the branch membership.
38	Up-front payment.
39	Up-front payment currency.
40	Complex trade component ID.
DATOS DEL INSTRUMENTO	
41	Instrument identification code.
42	Instrument full name.
43	Instrument classification.
44	Notional currency 1.
45	Notional currency 2.

Sensitivity: C2 Internal

46	Price multiplier.
47	Underlying instrument code.
48	Underlying index name.
49	Term of the underlying index.
50	Option type.
51	Strike price.
52	Strike price currency.
53	Option exercise style.
54	Maturity date.
55	Expiry date.
56	Delivery type.
OPERADOR, ALGORITMOS, EXENCIONES E INDICADORES	
57	Investment decision within firm.
58	Country of the branch responsible for the person making the investment decision.
59	Execution within firm.
60	Country of the branch supervising the person responsible for the execution.
61	Waiver indicator.
62	Short selling indicator.
63	OTC Post-trade indicator.
64	Commodity derivative indicator.
65	Securities financing transaction indicator.

En el Servicio de Transaction Reporting que los mercados de BME ofrecen, estos campos serán informados desde dos fuentes:

a) Provenientes de los datos que disponen los mercados de BME, y

b) Una base de datos donde se recogerán los datos facilitados por los Miembros de mercado.

A fin de optimizar los datos disponibles desde BME, y de facilitar la introducción de datos adicionales por parte del Miembro de mercado, BME ha segmentado la información necesaria para construir el Transaction Reporting de una operación en distintos tipos de registro, todos ellos con formato de texto plano (CSV).

La nomenclatura de los Registros es la siguiente:

TIPO DE REGISTRO	DESCRIPCIÓN
TP	Será el registro que recoge los datos de la operación provenientes del mercado. Este tipo de registros será facilitado por el Miembro de mercado solo en algunas circunstancias, tal y como se especifica más adelante.
CT	Recoge la información relativa a la identificación del titular de la operación.
DT	Contiene la información relativa a la persona o entidad que ha tomado la decisión para el cliente.
TS	Proporciona la información relativa a la transmisión de órdenes.
DW	Contiene la información relativa al decisor de la operación dentro de la entidad.
EW	Recoge la información relativa al ejecutor de la operación dentro de la empresa.
DR	Para informar de otros datos no incluidos en los registros anteriores.

Comunicación de los registros de *Transaction Reporting* a la autoridad competente

El servicio de Transaction Reporting de los mercados de BME está abierto no solo a las entidades cuya Autoridad Competente sea la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) sino también a entidades que tengan la obligación de comunicar a otras Autoridades Competentes europeas.

El servicio permite facilitar un fichero con formato XML que contiene el Transaction Reporting de la entidad:

- Directamente a la Autoridad Competente europea para todas aquellas operaciones hechas en el mercado (con MIC del mercado).
- A través del ARM de BME a la Autoridad Competente europea para todas aquellas operaciones que, provenientes de operaciones realizadas en el mercado, se realicen fuera del mercado (operaciones XOFF provenientes de una(s) operación(es) realizada(s) en el mercado)
- Directamente a la CNMV para todas aquellas operaciones que, provenientes de operaciones realizadas en el mercado, se hagan fuera del mercado (operaciones XOFF provenientes de una(s) operación(es) realizada(s) en el mercado), siempre que el Miembro de mercado que las realice sea un Miembro de mercado de fuera de la Unión Europea.

2 Flujo de ficheros del servicio de reporte delegado

Organización de la información de los registros

Los distintos tipos de registros existentes pueden ser utilizados de dos formas:

1. Mediante la asignación de los registros a una operación. Al utilizarlos de esta forma, será necesario que el Miembro de mercado remita al STR la información relativa a cada uno de los tipos de registro para cada operación.

2. Mediante la asignación de registros a un identificador. Al utilizarlos de esta forma, cada registro tendrá asociado una clave de identificador, que podrá ser introducida en la orden de mercado (en vinculación con las obligaciones del Order Record Keeping). El STR recogerá los registros de cada tipo apropiados para formar la información necesaria para esa operación en el Transaction Reporting. Puede encontrar más información al respecto en el punto "Forma de funcionamiento de los registros mediante Identificador (RI)" de este documento.

A fin de informar al STR en qué forma se desea utilizar cada registro, se requiere que el registro remitido venga siempre precedido por una cabecera denominada:

1. "**RO**" si se desea utilizar la forma de asociar el registro a una operación en concreto.

2. "**RI**" si se desea utilizar la forma de asociar el registro a un identificador o código corto.

En el supuesto de que una operación pudiera completar su información a través de registros RI y a través de registros RO, siempre se considerará como correcta la información facilitada con registros RO (para más información, ver ejemplo 3 en el capítulo de Ejemplos).

RO, Registro por Operación

El prefijo RO permite asociar un conjunto de registros a una operación. Dado que la información necesaria para hacer el Transaction Reporting de esta operación ha sido dividida en distintos tipos de registro, será necesario introducir un registro de cada clase: CT, DT, TS, DW, EW y DR. Cada registro contiene un tipo de información y debe ser comunicado en función de los datos de la operación, es decir, según el tipo de operación alguno de estos registros no será necesario.

Cada uno de estos tipos de registro deberá venir precedido por una cabecera RO con la siguiente estructura:

Nº	RTS 22	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	RO	Tipo de registro.
2		Action	A-Alta B-Baja	Indica qué finalidad tiene el registro TP remitido.
3	4	ExctgPty	Identificador LEI	Código LEI de la entidad que ejecuta la operación.
4	36	TrdnVn	MIC	Código MIC del Mercado para el que se crea el registro.
5		Número de ejecución		Número de la operación para la que se facilitan datos.
6		Fecha de ejecución	YYYY-MM-DD	Detalle de la fecha de la ejecución con el formato: YYYY-MM-DD
7		BuyrSellr	B-Compra S-Venta	Sentido de la operación.
8		SubRegistro	DR, CT, DW, EW, DT o TS	Indica el tipo de registro al que esta cabecera antecede CT, DT, TS, DW, EW o DR.

Tal y como se aprecia en la descripción, en lo relativo a su campo 8, el registro RO permite facilitar información de distinto tipo (en función del tipo de registro que le siga) para uno de los sentidos de la operación. Si en una operación el Miembro de mercado que reporta fuera tanto el comprador como el vendedor, deberá mandar un juego de registros para la compra de esa operación, y otro juego de registros para la venta de esa operación.

RI, Registro de Identificador

El prefijo RI permite asociar información a un Identificador. Los tipos de registro que se pueden asociar son todos los existentes excepto el TP.

El miembro solo podrá utilizar el registro RI para remitir información de operaciones realizadas en D y D-1, siendo D la fecha de envío del registro RI. En caso de enviar varios para un misma fecha y mismo identificador, el último enviado sustituye al anterior.

La información relativa a un identificador puede mandarse de dos modos:

- Diariamente y el STR se encargará de gestionar la información necesaria para completar cada operación teniendo en cuenta los cambios en la información enviada a lo largo del tiempo, incluso aunque los datos que identifica la clave sean los mismos que los del día anterior. Para ello la fecha inicial y la fecha final de validez deberán ser iguales, indicando la fecha de ejecución de las operaciones a las que se va a vincular esta información.

- Una única vez, en este caso se indica una fecha inicial, no anterior a D-1, siendo D el día en que se envía el registro RI; y la fecha final de validez "9999-12-31" o una fecha muy lejana en el tiempo.

- De manera puntual cada vez que haya cambios, es decir, se indica una fecha inicial, no anterior a D-1, siendo D el día en que se envía el registro RI y una fecha final de validez diferente a la fecha inicial. De esta manera, el día de fin de vigencia será necesario enviar otro registro RI o, el día, antes del fin de vigencia, que se produzca un cambio en la información asociada a ese identificador enviar de nuevo el registro RI.

Cada uno de estos tipos de registro deberá venir precedido por una cabecera RI que tiene la siguiente estructura:

Nº	RTS 22	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	RI	Tipo de registro
2		Action	A-Alta B-Baja	Indica qué finalidad tiene el registro TP remitido.
3	4	ExctgPty	Identificador LEI	Código LEI de la entidad que ejecuta la transacción
4	36	TrdnVn	MIC	Código MIC del Segmento de Mercado para el que se crea el registro. Podrá utilizarse el carácter "*" (asterisco) para informar que el registro es válido para todos los MICs.
5		F_Inicial	YYYY-MM-DD	Fecha inicial de validez del registro en formato: YYYY-MM-DD Detalle de la fecha de la ejecución con el formato: YYYY-MM-DD
6		F_Final	YYYY-MM-DD	Fecha final de validez del registro en formato YYYY-MM-DD. Puede coincidir con la fecha inicial, para registros válidos un solo día.
7		Identificador		Número de identificador clave asociado al registro que esta cabecera antecede.
8		SubRegistro	CT, DW, EW, DT, TS o DR	Indica el tipo de registro al que esta cabecera antecede CT, DT, TS, DR, DW o EW.

Las fechas de validez permiten definir la vigencia de la información que acompaña a este registro:

- Es obligatorio que se informe la fecha de validez inicial y final.

- Si se va a informar para solo un día la fecha inicial y final serán del mismo día.

Si se quiere que la información que acompaña al RI se mantenga para siempre la fecha final a informar debe ser 9999-12-31. Para aquellos casos en que la información que acompaña al registro se considera estática el STR la mantendrá hasta la fecha de vigencia o hasta que se envíe otro registro RI que sustituya al anterior.

- La fecha inicial no podrá ser anterior a D-1, siendo D el día en que se envía el registro RI al STR.
- Cuando un registro RI tenga un rango de fechas que solape parte del rango de fechas de un RI enviado anteriormente, se utilizará la información del último RI enviado para el rango de fechas informado en el registro

Funcionamiento de los registros mediante Identificador (RI)

Con arreglo al Reglamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo, artículo 25, los centros de negociación tienen obligación de mantener a disposición de la autoridad competente 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 establece en concreto qué datos deben ser grabados.

Dentro de los datos que deben ser guardados en cada orden, tres de ellos podrían ser utilizados en relación al Transaction Reporting:

RTS 24	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
3	Código de identificación del cliente.		Código utilizado para identificar al cliente del Miembro de mercado o participante del centro de negociación.
4	Decisión de inversión dentro de la empresa.		Código utilizado para identificar a la persona o el algoritmo en el Miembro de mercado o participante del centro de negociación que es responsable de la decisión de inversión, de conformidad con el artículo 8 del Reglamento Delegado (UE) 2017/590.
5	Ejecución dentro de la empresa.		Código utilizado para identificar a la persona o algoritmo en el Miembro de mercado o participante del centro de negociación que es responsable de la ejecución de la operación derivada de la orden, de conformidad con el artículo 9 del Reglamento Delegado (UE) 2017/590.

Estos datos serán facilitados por cada Miembro de mercado en cada orden mediante números enteros entre 100 y 4.294.967.295 (2^32-1). Estos números son códigos de identificación que representan claves únicas vinculadas a una base de datos gestionada por BME. Estos códigos en la orden será el que posteriormente el Transaction Reporting podrá utilizar con los Registros por Identificador que el Miembro de mercado haya facilitado. En concreto:

- El identificador informado en la orden como "código de identificación del cliente" será utilizado para establecer qué registro CT, qué registro DT y qué registro TS deben ser utilizados en el Transaction Reporting de la operación que esa orden genere.
- El identificador informado en la orden como "decisión de inversión dentro de la entidad" será utilizado para establecer qué registro DW será utilizado en el Transaction Reporting de la operación que esa orden genere.
- El identificador informado en la orden como "ejecución dentro de la entidad" será utilizado para establecer qué registro EW será utilizado en el Transaction Reporting de la operación que esa orden genere.

Los siguientes códigos de identificación quedan fijados para todos los usuarios con los siguientes valores:

Campo 4, Código de identificación del cliente (ClientID):

0. No hay cliente en esta orden (es una orden de cuenta propia). En este caso no es necesario que el Miembro de mercado remita información posterior de identificación del titular de la orden.
1. Orden Agregada: asociado al flag de titularidad/contrapartida "INTC".

Campo 5, Código de decisión de inversión dentro de la empresa (DcsnwFirm):

0. No hay decisión dentro de la empresa (la decisión se ha tomado fuera de la empresa).

Campo 6, Código de ejecución dentro de la empresa (ExctwFirm):

3. Se utiliza la información del cliente para rellenar la del ejecutor

Los datos que contienen los registros CT, DW y EW son más numerosos en el caso del STR que los solicitados en el Order Record Keeping (ORK). En la medida que una entidad contrate el STR, podrá facilitar no solo los datos que de estos tres registros se piden en el ORK, sino los datos adicionales necesarios para realizar el Transaction Reporting, de forma que no sea necesario reportar datos adicionales.

Detalle del registro tipo TP

El STR recibirá registros tipo TP de cada uno de los mercados de BME en los que el Miembro de mercado tenga contratado el servicio de Transaction Reporting para todas las operaciones realizadas en el mercado (no para las operaciones realizadas fuera de mercado XOFF). Estos registros contendrán la siguiente información:

Nº	RTS 22	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	TP	Tipo de registro.
2		Action	A-Alta B-Baja	Indica qué finalidad tiene el registro TP remitido.
3		BuyrSellr	B-Compra S-Venta	Sentido de la orden. Informa si la operación es de compra o venta.
4		ClientID		Código corto de cliente, informado en la orden.
5		DcsnwFirm		Código corto de decisor dentro de la entidad, informado en la orden.
6		ExctwFirm		Código corto de ejecutor dentro de la entidad, informado en la orden.
7		PType	LEI, MIC, INTC	Tipo de identificación de la contrapartida.
8	7,16	LEICnpty		Si PType=LEI, el LEI de la Contrapartida de la operación. (LEI de la Entidad de Contrapartida Central del mercado).
9	7,16	MICCnpty		Si PType=MIC, para operaciones bilaterales sin cámara de compensación. Código MIC del mercado donde se ha ejecutado la operación.
10	2	TxId		ID del Transaction Reporting.
11	3	TradPlcMtchgId		ID de la ejecución de mercado.
12	4	ExctgPty		Código LEI de la entidad que ejecuta la transacción.
13	5	InvstmtPtyInd		Indicador de si el Miembro de mercado está o no bajo las Directivas 39/2004 o 65/2014.
14	6	SubmitgPty		Código LEI de la entidad que remite el TR.
15	25	TrnsmssnInd		Indicador de transmisión de la orden.
16	28	TradDt		Fecha y hora de la ejecución.
17	29	TradgCpcty		Indicador de capacidad.
18	30	TypeQty		Tipo de unidades de la cantidad de la operación.
19	30	Unit		Unidades de contratación. Para Renta Variable, Derivados y algunas operaciones de los mercados de Renta Fija.

20	30	NnmMntry		Unidades monetarias.
21	31	QtyCurrency		Divisa de la cantidad.
22	33	TypePric		Tipo de precio de la operación.
23	33	Pric		Precio.
24	33	BsisPts		Precio del instrumento expresado en porcentaje. Solo aplica a algunos productos de los mercados de Renta Fija.
25	34	Currency		Divisa del precio de la transacción. Solo si el precio es expresado en unidades monetarias.
26	35	NetAmt		Importe neto de la transacción.
27	36	TradVn		Código MIC del mercado donde se ha ejecutado la transacción.
28	37	CtryOfBrnch		País de la sucursal del Miembro de mercado.
29	38	UpFrntPmt		Importe del pago up-front.
30	39	UpFrntPmt _currency		Divisa del pago up-front.
31	40	CmplxTradCmpntID		Código que relaciona distintas ejecuciones como parte de un package.
32	41	InstrmId		Código ISIN del instrumento financiero.
33	61	WvrInd		Indicador de tipo de waiver.
34	65	SctiesFincgTxInd	TRUE FALSE	Se indicará «true» cuando la operación esté comprendida en el ámbito de actividad, pero esté exenta de la obligación de comunicación según el Reglamento (UE) 2015/2365. «false» en caso contrario.

En el caso de que se haya realizado una retrocesión de una operación en los mercados de renta variable, será el Mercado quien se encargue de solicitar al STR la baja de la operación y, en el caso de que ya haya sido reportada, se envíe una baja a la autoridad competente. La baja de una operación agregada implicará que el miembro envíe la baja de todos los XOFF asociados.

En las operaciones de eventos corporativos será el sistema PTI quien enviará tanto el registro TP al STR.

Los miembros podrán dar de baja registros TP de operaciones XOFF enviando el registro con el campo Action=B. Esto implica dar de baja la operación XOFF entera.

Para modificar las operaciones XOFF el miembro tiene que enviar otro TP con el campo Action=A con la nueva información.

En las operaciones realizadas fuera de mercado (XOFF), los Miembros de mercado tendrán que enviar un registro TP correspondiente a las asignaciones que realicen o cualquier otra operativa que sea realizada fuera del mercado (XOFF).

Cuando sea el Miembro de mercado el que envíe el registro TP para comunicar una operación XOFF, los campos 8 (TxId) y 9 (TradPlcMtchgId o Número de ejecución) deberán ser rellenados siguiendo la siguiente lógica:

- Los caracteres XX.
- La fecha de la operación original que genera el XOFF con posterioridad.
- El MIC del mercado original que genera el XOFF con posterioridad.
- El número de la operación en el mercado (TradPlcMtchgId) original que genera el XOFF con posterioridad.
- El sentido de la operación original, siendo B para compras y S para ventas.
- Tres dígitos correlativos, empezando por el 001, que permitirán hacer único el código de cada operación XOFF.

Ejemplo: En fecha 20180322 se realizó una compra en el mercado de Derivados con MIC XMIC con número de operación FI1234567890. Ésta era una operación agregada que debe separarse en tres asignaciones o desgloses utilizando un secuencial que los enumere. Estos desgloses deberán tener los siguientes números de ejecución:

XX20180322XMICFI1234567890B001

XX20180322XMICFI1234567890B002

XX20180322XMICFI1234567890B003

Detalle de registro tipo CT

Los registros tipo CT facilitan los datos correspondientes a la identificación del cliente. Tendrán la siguiente estructura:

Nº	RTS 22	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
1		SubRegistro	CT	Tipo de registro.
2		PType	LEI, P, INTC	Tipo de identificación del comprador o vendedor.
3	7,16	LEI	Identificador LEI.	Si PType=LEI. Código LEI del cliente. En el supuesto de que el identificador sea un ordenante (caso de Gestoras) será el LEI de la gestora.
4	7,16	Prsn_SchmeNm	NIDN, CCPT, CONCAT	Si PType=P. Tipo de identificación de la persona física.
5	7,16	Prsn_Id	National_ID	Si PType=P. Código de identificación del cliente. DNI para España.
6	9,18	Prsn_FrstNm		Si PType=P. Nombre del cliente.
7	10,19	Prsn_Nm	Apellidos	Si PType=P. Apellidos del cliente.
8	11,20	Prsn_BirthDt	Fecha de nacimiento	Si PType=P. Fecha de nacimiento del cliente.
9	8, 17	CtryOfBrnch [No aplica a Renta Variable, sí aplica a Derivados y Renta Fija].	País donde se recibe la orden.	Este campo debe indicar el país de la sucursal que haya recibido la orden del cliente o haya tomado una decisión de inversión en nombre de un cliente de conformidad con un mandato discrecional otorgado por dicho cliente. Si dicha actividad no ha sido llevada a cabo por una sucursal, se indicará el código del Estado miembro de origen de la empresa de servicios de inversión o el código del país en el que la empresa de servicios de inversión tenga su administración central o domicilio social (en el caso de empresas de terceros países). Cuando la operación corresponda a una orden transmitida que cumpla las condiciones de transmisión previstas en el artículo 4, este campo se deberá cumplimentar con la información recibida de la empresa transmisora.

El código de identificación de las personas físicas deberá seguir la prelación descrita en el Anexo II "Identificadores nacionales que deben utilizarse en las comunicaciones de operaciones cuando los clientes sean personas físicas", del Reglamento Delegado (UE) 2017/590 de la Comisión de 28 de julio de 2016.

Cuando para un mismo identificador u operación existan varios clientes (cotitularidad), deberán enviarse varios registros CT (uno para cada individuo de la cotitularidad) en líneas separadas usando el mismo número de operación (si se utiliza RO) o de identificación (si se utiliza RI). Es decir, cada registro CT con el campo Action=A añade un cliente nuevo.

En el caso de mandar un registro con la acción "Baja" en un registro CT para el que se hubiera mandado cotitulares, el STR dará de baja todos los cotitulares asociados a esa operación (si se usa RO) o a ese identificador (si se usa RI), es decir, en registros de cotitularidad no será posible dar de baja uno solo de los titulares, sino que será necesario dar de baja todos y enviar de nuevo la lista correcta.

En el caso de que el miembro de mercado quiera realizar modificaciones en la titularidad de una operación, tanto si es de mercado como XOFF, deberá enviar un RO-CT con el campo Action=B para dar de baja la titularidad de esa operación y posteriormente los registros RO-CT con el campo Action=A para dar de alta el/los nuevo/s titular/es de la operación. En el caso de que quiera modificar los titulares asociados a un identificador (código corto) se hará lo mismo pero con el registro de tipo RI-CT.

En las operaciones agregadas, cuando se haga una modificación del registro CT de la operación de mercado, lo que implica que el miembro envíe la baja de todas las operaciones XOFF asociadas. El único titular posible de una operación agregada es el flag INTC, no se permite que la operación de mercado sea agregada y tenga un titular, ya que es incoherente. La titularidad de la operación de mercado se deberá desagregar en operaciones XOFF con los diferentes clientes de la entidad.

Para realizar cambios de titularidad que se hagan en una operación XOFF es necesario dar de baja la operación XOFF entera mediante un TP con el campo Action=B y, posteriormente, enviar de nuevo los registros de la operación con la nueva titularidad.

No es necesario que el miembro de mercado envíe un registro CT cuando la operación es por cuenta propia (DEAL), es decir, el propio miembro es el titular de la operación. Será el mercado quien se encargue de enviar el registro CT de la operación al STR. Cuando la operación sea por cuenta propia solo admitirá un único titular.

Detalle de registro tipo DT

Estos registros tienen asociada la información relativa al decisor del cliente. En el caso de que el cliente sea su propio decisor o el titular de la operación sea el propio Miembro de mercado, no es necesario que el Miembro de mercado envíe un registro DT, ya que estos datos se dejan en blanco en el Transaction Reporting.

Nº	RTS 22	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
1		SubRegistro	DT	Tipo de registro.
2		Dcsn_typePrsn	LEI, P	Indica si el decisor es persona física o jurídica.
3	12,21	LEI	LEI	Si PType=LEI. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación. LEI del decisor .
4	12,21	Prsn_SchmeNm	NIDN,CCPT,CONCAT	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación y este es una persona física. Tipología de código de identificación del decisor persona física.
5	12,21	Prsn_Id	National_ID	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación. National ID del decisor.
6	13,22	Prsn_FrstNm	Nombre	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación y este es una persona física. Nombre del decisor.
7	14,23	Prsn_Nm	Apellidos	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación y este es una persona física. Apellidos del decisor.
8	15,24	Prsn_BirthDt	Fecha nacimiento	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación y este es una persona física. Fecha de nacimiento del decisor.

Cuando el registro DT se utiliza por el método del Identificador (mediante RI), el identificador del decisor debe ser el mismo que el del cliente. En el caso de que un mismo cliente realice operaciones en las que el decisor es el mismo, y operaciones en las que el decisor es otro, el Miembro de mercado deberá crear dos identificadores distintos.

Ejemplo: Registro CT con identificador 32.655 y registro DT con identificador 32.655: para el caso en el que el cliente tiene un decisor.

Registro CT con identificador 32.656 y registro DT inexistente: para el caso en el que el cliente es su propio decisor.

Los datos del cliente en el registro 32.655 y 32.656 son los mismos (ya que es el mismo cliente) pero se utilizará un identificador u otro en la orden para señalar correctamente el decisor en el Transaction Reporting.

Detalle de registro tipo TS

Estos registros tienen asociada la información relativa a la transmisión de una orden tal y como se define en el artículo 4 del RTS 22. En el caso de que no exista transmisión de la orden no es necesario que el Miembro de mercado remita un registro TS, ya que estos datos se dejan en blanco en el Transaction Reporting.

Nº	RTS 22	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	TS	Tipo de registro.
2	25	Transmission of order indicator.	0-False / 1-True	Indica si hay transmisión de la orden de una entidad a otra.
3	26,27	Trnsmttg	Identificador LEI	Código LEI de otra entidad que transmite la orden al Miembro de Mercado, cuando se cumplen las condiciones de transmisión.

Cuando el registro TS se utiliza por el método del Identificador (mediante RI), el identificador de la transmisión debe ser el mismo que el del cliente. En el caso de que un mismo cliente realice operaciones en las que existe una transmisión, y operaciones en las que no existe transmisión, el Miembro de mercado deberá crear dos identificadores distintos.

Ejemplo: Registro CT con identificador 32.655 y registro TS con identificador 32.655: para el caso en el que el la operación procede de una transmisión.

Registro CT con identificador 32.656 y registro TS inexistente: para el caso en el que la operación no procede de una transmisión.

Los datos del cliente en el registro 32.655 y 32.656 son los mismos (ya que es el mismo cliente) pero se utilizará un identificador u otro en la orden para señalar correctamente la existencia de una transmisión en el Transaction Reporting.

Detalle de registro tipo DW

Estos registros recogen la información relativa a la identificación del decisor de la operación cuando la decisión ha sido tomada dentro del Miembro de mercado. En el resto de los casos no es necesario facilitar esta información.

Nº	RTS 22	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
1		SubRegistro	DW	Tipo de registro.

2	57	Dcsn_typePrsn	P-Person A-Algoritmo	Tipo de decisor.
3	57	Dcsn_Algo	Código del algoritmo	Si Dcsn_typePrsn='A'. Código del algoritmo que toma la decisión de la operación dentro de la entidad.
4	57	Dcsn_Othr_SchNm	NIDN, CCPT, CONCAT	Si Dcsn_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID.
5	57	Dcsn_Othr_Id	National_ID	Si Dcsn_typePrsn='P'. National_ID de la persona que toma la decisión de la operación dentro de la entidad.
6	58	Dcsn_CtryOfBrnch	Código país	Si Dcsn_typePrsn='P'. País donde se encuentra el responsable de la decisión de la operación dentro de la entidad. Si la decisión la toma un algoritmo se deja vacío.

Detalle de registro tipo EW

Estos registros recogen la información relativa a la identificación del ejecutor de la operación dentro de la entidad.

Nº	RTS 22	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
1		SubRegistro	EW	Tipo de registro.
2	59	Exct_typePrsn	P-Person A-Algoritmo C-Cliente	Tipo de ejecutor de la operación dentro de la entidad. Si la ejecución la realiza el cliente se informa tipo de ejecutor="C" para que el STR informe como "Execution within firm" el código "NORE".
3	59	Exct_Algo	Código del algoritmo	Si Exct_typePrsn='A'. Código del algoritmo que envía la orden al mercado dentro del miembro ejecutor.
4	59	Exct_Othr_SchNm	NIDN, CCPT, CONCAT	Si Exct_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID.
5	59	Exct_Othr_Id	National_ID	Si Exct_typePrsn='P'. National_ID de la persona que envía la orden al mercado dentro del miembro ejecutor.
6	60	Exct_CtryOfBrnch	Código país	Si Exct_typePrsn='P'. País de la sucursal que supervisa a la persona responsable de la ejecución. Solo se cumplimenta si no es un algoritmo.

Detalle de registro tipo DR

Estos registros recogen el resto de información que el Transaction Reporting requiere y que no ha sido incluida en el resto de registros.

Si el Miembro de mercado así lo desea, podrá enviar un registro DR mediante identificador (utilizando RI) con el identificador cero. Esto produciría que los valores asignados a cada uno de los campos asociados a este registro DR con identificador cero se utilizarían como valores por defecto en todas las operaciones del Miembro de mercado para el mercado especificado en el campo MIC del registro RI.

Los registros tipo DR también pueden ser facilitados para operaciones concretas (usando RO), ya sea porque no se han facilitado datos por defecto (porque no se ha remitido un registro DR con identificador cero) o porque los datos que fueron definidos como datos por defecto para alguna operación en concreto no son correctos.

Nº	RTS 22	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	DR	Tipo de registro.
2	40	CmplxTradCmpntID		Código de identificación único para las ejecuciones que componen una cesta o una estrategia de contratos.
3	62	ShrtSellgInd	SESH, SELL, SSEX, UNDI	Indicador de venta en corto. Se cumplimenta en las operaciones de venta, tanto para cuenta propia como para clientes. Si es una orden agregada se deja en blanco. Se puede rellenar con los códigos: 'SSEX' - Short sale with exemption. Es una operación de venta en corto de tipo Market Making o en mercado primario. 'SESH' - Short sale with no exemption. Todas las demás ventas en corto. 'SELL' - No short sale. Es una venta ordinaria, no hay venta en corto. 'UNDI' – Information not available.
4	64	RskRdcgTx		Indicador de disminución del riesgo en materias primas, solo aplica en warrants, certificados y derivados de energía. Si la operación reduce el riesgo en una commodity="True", sino "False".

5	8,17	CtryOfBrnch [Aplica a Renta Variable, no aplica a Derivados y Renta Fija].	Este campo debe indicar el país de la sucursal que haya recibido la orden del cliente o haya tomado una decisión de inversión en nombre de un cliente de conformidad con un mandato discrecional otorgado por dicho cliente, conforme a lo dispuesto en el artículo 14, apartado 3. Si dicha actividad no ha sido llevada a cabo por una sucursal, se indicará el código del Estado miembro de origen de la empresa de servicios de inversión o el código del país en el que la empresa de servicios de inversión tenga su administración central o domicilio social (en el caso de empresas de terceros países). Cuando la operación corresponda a una orden transmitida que cumpla las condiciones de transmisión previstas en el artículo 4, este campo se deberá cumplimentar con la información recibida de la empresa transmisora.
6	63	OTCPstTradInd	Indicador de post-trade OTC Solo aplicable a la pata de la transacción del Miembro de mercado con su cliente, es decir, al XOFF (del Miembro de mercado a sus clientes). Se puede completar con los siguientes flags: Para todos los instrumentos: BENC = Operación con parámetros de referencia. ACTX = Operación cruzada (agency cross). LRGS = Operación de gran volumen post-negociación. ILQD = Operación con instrumentos no líquidos. SIZE = Operación por encima del tamaño específico. CANC = Anulación. AMND = Modificación. Para las acciones e instrumentos similares: SDIV = Operaciones con dividendo especial. RPRI = Operaciones que han obtenido una mejora de precio. DUPL = Comunicaciones de negociación duplicadas. TNCP = Operaciones que no contribuyen al proceso de formación de precios a efectos del artículo 23 del Reglamento (UE) n 600/2014. Para los instrumentos distintos de acciones y de instrumentos similares: TPAC = Operación combinada. XFPH = Operación de intercambio de activos físicos.

Sensitivity: C2 Internal

7	29	TradgCpcty		Indicador de capacidad. Este campo podrá ser utilizado por el miembro para que modifique la capacidad de una ejecución que ha sido informado en el registro TP. No es necesario completarlo si se quiere mantener la capacidad de la ejecución de manera que el STR utilizará la capacidad del registro TP. Si el miembro modifica la capacidad para un identificador o una operación, es necesario que en la próxima modificación de este DR también se informe de la capacidad.
8		Exento	0-FALSE 1-TRUE	Todas las operaciones estarán por defecto incluidas en el TR (este campo será FALSE por defecto). En el caso de que alguna operación de la entidad no tuviera que ser reportada, este campo debería ser marcado como TRUE. En el caso de que ya se hubiera reportado la transacción, el miembro enviará un registro RO-DR con el campo Exento=1 y el STR enviará una baja de la operación reportada a la autoridad competente y se guardará esta operación en el STR pero con Exento=1.

Sensitivity: C2 Internal

3 Validaciones de los registros realizadas por el STR

Validaciones de ESMA

La Autoridad Europea de Valores y Mercados (ESMA) ha comunicado una serie de validaciones que toda operación del Transaction Reporting debería superar. La tabla completa está disponible en el Anexo 2.

Validaciones de BME

Adicionalmente a todas las validaciones que ESMA propone, BME realizará las siguientes validaciones:

- ClientID: Si el código de cliente asociado a una operación es cero (valor predeterminado, ver punto "Forma de funcionamiento de los registros mediante Identificador (RI)" dentro del capítulo "2. Flujo de Ficheros del Servicio de reporte delegado"), el campo "Trading Capacity" debe contener el valor DEAL o MATCH.
- BME se reserva el uso de los 100 primeros identificadores (números del 0 al 99). Cualquier registro tipo RI que utilice números por debajo de 100 será rechazado.
- BME validará que, en las operaciones de mercado agregadas, aquellas cuyo titular es el flag INTC, solo tienen un único registro CT para la operación de mercado.
- Las validaciones concretas sobre cada uno de los campos serán las siguientes:

RTS 22	NOMBRE DEL CAMPO	DESCRIPCIÓN / CUMPLIMENTACIÓN DEL CAMPO / VALIDACIONES
1	Estado del reporte	Podrá ser: NEW/CANC. CANC solo para cuando se vaya a cancelar un TR ya enviado.
2	ID del TR	Es el identificador del Transaction Reporting.
3	Referencia ejecución del mercado. ID de ejecución.	Es el número de ejecución del mercado.
4	Código de entidad que ejecuta la transacción.	LEI del miembro del mercado. Se validará que el Miembro de mercado esté adherido al TR de los mercados de BME en ese segmento y activo para la fecha de la negociación que se informa.
5	Miembro bajo las Directivas 39/2004 o 65/2014 (art. 4.1).	Campo para confirmar si el Miembro de mercado es entidad financiera reconocida en la UE.
6	Código de la entidad que remite el TR.	Código LEI de la entidad que remite el TR. Código LEI del mercado de BME o el LEI del ARM.

Sensitivity: C2 Internal

7	Identificador de comprador.	LEI o National_ID del titular de los instrumentos comprados. En el supuesto de ser contrapartida de la operación se cumplimentará con: el LEI de BMECLEARING en las operaciones de cámara, o con el MIC del segmento de mercado en las operaciones bilaterales de mercado sin ECC. En el caso de que sea una operación agregada se informara con "INTC". En el supuesto de que el identificador sea un ordenante (caso de Gestoras) será el LEI de la gestora. Si la capacidad de negociación (29) es DEAL no se rellenan los campos del 9 al 15.
8	País de la sucursal del comprador.	Código país de la sucursal de la entidad donde se generó la orden. Solo se rellena si la orden es de un cliente o hecha para un cliente bajo un mandato genérico (entonces rellenar también campos 9-15), si es una orden del propio Miembro de mercado se deja vacío.
9	Nombre del comprador.	Nombre del comprador, persona física. Si hubiera co-titularidad, podrán ser hasta 25.
10	Apellido del comprador.	Apellido del comprador si es persona física. Si hubiera co-titularidad, podrán ser hasta 25.
11	Fecha de nacimiento del comprador.	Fecha de nacimiento del comprador si es persona física. Si hubiera co-titularidad, podrán ser hasta 25 nacional.
12	Código de persona / institución que toma la decisión en la compra.	Solo se rellena si el decisor no es el propio cliente. Será el LEI o National_ID del decisor.
14	Apellido de la persona que toma la decisión de la compra.	Solo se rellena si el decisor no es el propio cliente y el decisor es una persona física.
15	Fecha de nacimiento de la persona que toma la decisión de la compra.	Solo se rellena si el decisor no es el propio cliente y el decisor es una persona física.
16	Identificación del vendedor.	Igual que el campo 7, pero con el dato de la venta.
17	País de la sucursal del vendedor.	Igual que el campo 8, pero con el dato de la venta.
18	Nombre del vendedor.	Igual que el campo 9, pero con el dato de la venta.
19	Apellido del vendedor.	Igual que el campo 10, pero con el dato de la venta.
20	Fecha de nacimiento del vendedor.	Igual que el campo 11, pero con el dato de la venta.

Sensitivity: C2 Internal

21	Código de persona / institución que toma la decisión en la venta.	Igual que el campo 12, pero con el dato de la venta.
22	Nombre de la persona que toma la decisión de la compra.	Igual que el campo 13, pero con el dato de la venta.
23	Apellido de la persona que toma la decisión de la venta.	Igual que el campo 14, pero con el dato de la venta.
24	Fecha de nacimiento de la persona que toma la decisión de la venta.	Igual que el campo 15, pero con el dato de la venta.
25	Transmisión del indicador de la orden.	La empresa transmisora indicará «true» en su comunicación cuando no se cumplan las condiciones de transmisión establecidas en el artículo 4 del RTS 22. Indicará «false» en todas las demás circunstancias.
26	Código del miembro comprador que transmite la orden.	Si la hubiera, código LEI de otra entidad que le transmite la orden de compra al Miembro de Mercado.
27	Código del miembro vendedor que transmite la orden.	Si la hubiera, código LEI de otra entidad que le transmite la orden de venta al Miembro de Mercado.
28	Día y hora de ejecución.	Detalle de la fecha y hora de la ejecución con el formato: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.ddddddZ. Siendo T un separador de fecha con las horas y Z indicador de que la hora mostrada es UTC. 'dddddd' son fracciones de segundo. Para el lado del XOFF se pone la misma hora que la de mercado.
29	Capacidad de negociación.	Podrá ser: MTCH: Negociación por cuenta ajena. / DEAL: Negociación por cuenta propia / AOTC: Cualquier otra capacidad.
30	Cantidad.	Número de unidades del instrumento.
31	Divisa de la cantidad.	No aplica, ya que las cantidades no son en unidades monetarias si no en número de títulos o contratos.
32	Aumento o disminución del nocional del contrato de derivados.	No aplica para los mercados de BME.
33	Precio de la transacción.	Es el precio de la operación.

Sensitivity: C2 Internal

34	Divisa del precio de la transacción.	Divisa en la que se ha realizado la operación. Siempre EUR.
35	Importe neto de la transacción.	Solo para Renta Fija. Resto de validaciones las descritas en el anexo 2.
36	Mercado donde se ha ejecutado la transacción.	El código MIC donde se negocia el valor.
37	País de la sucursal del miembro.	Código País del Miembro de mercado ejecutor de la orden.
38	"Up-front payment".	No aplica, vacío.
39	Divisa del "up-front payment".	No aplica, vacío.
40	Ind. relación reporte distintas ejecuciones.	Código de identificación único para las ejecuciones que componen una cesta en Renta Variable o estrategia en Derivados.
41	Código identificador del instrumento financiero.	Es el ISIN del instrumento financiero sobre el que se opera.
42	Nombre del instrumento financiero.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
43	Clasificación del instrumento financiero.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
44	Divisa 1 del nocional.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
45	Divisa 2 del nocional.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
46	Precio multiplicador.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
47	Código instrumento financiero subyacente.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
48	Nombre del índice subyacente.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
49	Plazo del índice subyacente.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
50	Tipo de opción.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
51	Strike.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
52	Divisa del strike.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
53	Estilo de la opción.	Vacío. Informado mediante FIRDS.

Sensitivity: C2 Internal

54	Fecha de vencimiento del instrumento. Financiero.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
55	Fecha de vencimiento del derivado.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
56	Tipo de entrega.	Vacío. Informado mediante FIRDS.
57	Persona o algoritmo que toma la decisión de inversión (within firm).	Se rellena con el NATIONAL ID de la persona o del código del algoritmo que toma la decisión dentro de la entidad. Solo se cumplimenta en cuenta propia o cuando se actúa por un cliente con mandato genérico.
58	País de la sucursal responsable de la decisión de inversión (within firm).	País donde se encuentra el responsable de la decisión de la operación dentro de la entidad. Se cumplimenta solo en caso de personas físicas, si es algoritmo no se rellena.
59	Persona o algoritmo responsable de la ejecución (within firm).	Se rellena con el NATIONAL ID de la persona o del código del algoritmo que envía la orden al mercado dentro del miembro ejecutor.
60	País de la sucursal que supervisa a la persona responsable de la ejecución (within firm).	Código país de la sucursal donde se encuentra el responsable de la ejecución. Vacío si la orden la ejecuta un algoritmo.
61	Waiver indicator.	Indicador de la tipología del waiver (bloques, volumen oculto... etc.). Vacío o con waiver. Este campo solo se rellena en caso de operaciones con MIC de mercado. En XOFF siempre está vacío.
62	Indicador de venta en corto.	Se cumplimenta para ventas por cuenta propia como para clientes. Vacío si es una orden agregada. No aplica a derivados.
63	Indicador de post-trade OTC.	Solo aplicable a la pata de la transacción del Miembro de mercado con su cliente, es decir, al XOFF (del Miembro de mercado a sus clientes).
64	Indicador de derivado sobre materias primas (riesgo en commodities).	Indicador de riesgo en derivados sobre materias primas. Si la operación REDUCE el riesgo en una commodity="True", si no "False".
65	Indicador de exención de reporting.	FALSE (fijo). Ninguna operación en la bolsa se va a realizar para obtener financiación. SFT, por ejemplo compra de bonos del ECB.
66	Indicador de exención de reporting	No se puede volver a marcar una operación como exenta si ya lo está.
67	Indicador de exención de reporting	No se puede informar una operación como exenta en las remisiones complementarias. Se rechazará el fichero de remisión complementaria.

Sensitivity: C2 Internal

4 Horarios

Horarios para enviar información

El servicio SFTP que permitirá recibir información de los miembros en cualquier momento del día.

Durante este periodo de tiempo será posible enviar ficheros con registros que faciliten la información necesaria para que los mercados de BME puedan realizar el Transaction Reporting contratado.

A efectos del STR se considerará un cambio de fecha, en cuanto al envío de los ficheros, a las 20h, es decir, todos los ficheros recibidos a partir de las 20h se considerarán recibidos el día siguiente.

Horarios para la recepción de información

El servicio de STR generará a partir de las 17:00 de D+1 un informe sobre el estado de los registros que deberían ser mandados al Transaction Reporting relativos al día D.

El proceso de generación del Transaction Reporting se iniciará en D+1 a partir de las 20:00. Al finalizar este proceso el servicio de STR facilitará información sobre el estado final de cada operación: si ha sido enviada en el fichero XML al supervisor, o si por el contrario estaba incompleta o mal informada, en cuyo caso dará información sobre la razón de su no incorporación en el fichero XML.

Esquema general

07:30	Apertura de los canales de información de los Miembros de mercado hacia el STR.
Después de las 17:00	A las 17:00 se iniciarán los procesos para generar la información desde el STR sobre el estado de las operaciones y su incorporación en el Transaction Reporting.
20:00	Cierre de los canales de información de los Miembros de mercado hacia el STR.
Después de las 20:00	Generación de los registros de Transaction Reporting, para su envío a CNMV, ARM de BME y al Miembro de mercado. Generación del informe relativo a las operaciones no comunicadas y el motivo de su no comunicación.

Sensitivity: C2 Internal

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 un número máximo de caracteres especificados. No es necesario completar el campo hasta alcanzar la longitud máxima de caracteres especificada.
Int32	Número entero de 32 bits.

Nomenclatura de los ficheros del Miembro de mercado hacia el STR

El nombre del fichero que contiene los registros que el Miembro de mercado desea remitir al STR 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:
  - **TR:** Para los ficheros enviados dentro del período 1 (hasta D+8 respecto de la fecha de ejecución)
  - **ORTR:** Para los ficheros enviados dentro del período 1 (hasta D+8 respecto de la fecha de ejecución). El fichero aplica al TR y al ORK (Order Record Keeping).
  - **FR:** ficheros enviados al STR ante un requerimiento de información de la autoridad competente.
- AAAAMMDD(8) → Fecha de comunicación del fichero.
- SEQ(3) → Secuencia de 3 dígitos. Ejemplo: 001
- EXT(3) → Extensión del fichero: **DAT**
- MD5(33) → Se incluirá 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 contendrá los registros de los distintos tipos que se definen en este documento. El fichero estará cifrado.

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 que en ese caso se rechaza el fichero completo). En el apartado de los tipos de registro RI y RO se indica cómo realizar las bajas.

Se permitirán múltiples cargas de ficheros, mediante el campo ACTION se distinguirá si es un ALTA (Campo ACTION='A' y el registro no existe STR), MODIFICACION (Campo ACTION='A' y el registro existe en el STR), BAJA (Campo ACTION='B').

Cualquier cambio que no sea acumulativo sobre los registros asociados a un único identificador (registro CT) implicará enviar un registro de baja y varios de alta con los nuevos titulares.

Los ficheros de entrada al STR se procesaran por orden de llegada, es responsabilidad del Miembro de mercado enviarlos en el orden correcto.

Cada fichero cargado en el sistema STR generará un fichero de respuesta en el momento indicando si el fichero fue incorporado satisfactoriamente a la espera de la consolidación (cruce de la información del Miembro de mercado + información del Mercado y validaciones ESMA/BME).

Nomenclatura y formato de los ficheros del STR hacia el Miembro de mercado

El nombre del fichero que contiene los registros de información sobre el estado del TR que el STR 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:
  - **TR**: Para los ficheros enviados dentro del período 1 (hasta D+8 respecto de la fecha de ejecución).
  - **ORTR**: Para los ficheros enviados dentro del período 1 (hasta D+8 respecto de la fecha de ejecución). El fichero aplica al TR y al ORK (Order Record Keeping).
  - **FR**: respuesta a ficheros enviados ante un requerimiento de información de la autoridad competente. (ver fichero de requerimientos)
  - **CPRE**: Resultado de la Consolidación Previa realizada a las 17h en D+1.
  - **CFIN**: Resultado de la Consolidación Final realizada a las 20h en D+1.
  - **TRCA**: Respuesta de la autoridad competente (CNMV) a la información de los ficheros TR emitidos.
  - **FRCA**: Respuesta de CNMV a los requerimientos de información realizados (ficheros FR enviados al STR).
- AAAAMMDD(8) → Fecha de generación del fichero.
- SEQ(3) → Secuencia de 3 dígitos. Ejemplo: 001
- EXT(3) → Extensión del fichero.
- MD5(33) → Se incluirá el hash MD5 del fichero a continuación de la extensión para poder validar que el fichero es el mismo en origen y destino.

Los ficheros de respuesta contienen dos tipos de registros que indican al Miembro de mercado el estado del contenido de los ficheros que el STR ha procesado. El fichero estará cifrado.

STR envía ficheros de respuesta al Miembro de mercado en varios casos:

1. Resultado de la validación sintáctica y de contenido de los registros TP, RO-RI. Se realiza tras cada envío de ficheros del Miembro de mercado al STR.
2. Resultado del proceso de consolidación BME.
3. Resultado de las validaciones realizadas por CNMV.

Registros FI

Este tipo de registros contienen información del STR hacia el Miembro de mercado, relativa al tratamiento que el STR ha realizado de un fichero remitido por el Miembro de mercado, indicando el estado GLOBAL del fichero. Los detalles acerca de los posibles errores de validación producidos se indican en el registro VA.

Su estructura es la siguiente:

Nº	CAMPO	DATO	DESCRIPCIÓN
1	TypeReg	FI	Tipo de registro.
2	Origin	BME, NCA	Origen de la información de respuesta. BME o el organismo regulador del mercado (CNMV).
3	CreDT		Fecha de envoi.
4	ExctgPty	LEIIdentifier	LEI del Miembro de mercado.
5	FileName		Nombre del fichero remitido.
6	Sts		Status (Table 1).
7	TtlNbOfRcrds		Número total de registros.
8	stACTP		Number of accepted transactions.
9	stPDNG		Number of pending transactions.
10	stRJCT		Number of rejected transactions.
11	stRCVD		Number of received transactions.

Tabla 1

STATUSCODE	NAME	DEFINITION
ACPT	Accepted	El reporte ha sido aceptado.
CRPT	Corrupted File	El fichero estaba corrupto.

INCF	Incorrect Filename	El nombre del fichero era 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.

Por ejemplo:

- Si Sts="ACPT" indica que el fichero "FileName" fue aceptado en su totalidad.
- Si Sts="PART" indica que el fichero "FileName" fue aceptado de forma parcial y la información sobre el motivo de rechazo de los registros erróneos viene informada en los registros de tipo VA.
- Si STS="CRPT" el fichero estaba corrupto y no se pudo abrir, en ese caso sólo se envía el registro FI, sin VA
- Si STS="RJCT", todo el contenido del fichero fue rechazado y en los registros VA se informa de las reglas de validación que no fueron superadas.

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

El sistema realizará una validación del nombre del fichero para que se ajuste a las nomenclaturas acordadas.

Los campos STS=ACTP, STS=PDNG, STS=RJCT y STS=RCVD sólo van informados en los casos 2 y 3: consolidación de BME y respuesta de la CNMV. (Son estados que se corresponden con los estados de transacciones CNMV/ESMA, campo Origin=NCA)

El campo "Origin" indica si la información es originada por la NCA o STR.

El sistema realizará una validación sintáctica de los registros RI, RO (DW, EW, TS, DT, DR, CT) usados por el Miembro de mercado para completar la información proporcionada por el registro TP. En el caso de recibir un TP por parte del Miembro de mercado también se validará.

Un error sintáctico implica el rechazo completo del fichero, se indicará mediante el registro FI con el código de estado Sts= **RJCT** y varios registros VI que indicarán los errores de validación encontrados.

Registros VA

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

Los registros FI y VA se deben procesar 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	TxId		Identificador del registro del Transaction Reporting.
3	Origin	ARM,CA	Origen de la información de respuesta.
4	Line		Línea que ocupa en el fichero de texto.
5	Sts		Status Table 2.
6	Rule_ID		Validation Rule (Table 2).
7	Field		Nombre del campo.
8	FieldRTS22		Campo relacionado con formato de RTS 22.
9	ErrorCode		Código de error.
10	Msg		Mensaje del error en formato texto.
11	Value		Valor afectado.

Tabla 2

STATUSCODE	NAME	DEFINITION
ACPT	Accepted	La transacción ha sido aceptada.
PDNG	Pending	El procesado de la transacción está pendiente de procesar por la NCA.
RCVD	Received	La transacción ha sido aceptada y está pendiente de validación por la NCA.
RJCT	Rejected	La transacción ha sido rechazada.

Concepto de consolidación

La consolidación consiste en unir los datos de los registros TP con el resto de los registros facilitados por los Miembros de mercado, y aplicar las validaciones obligatorias de ESMA y las propias de BME para su posterior envío a CNMV a una hora prefijada

La consolidación se realizará diariamente para operaciones ejecutadas desde D-1 a días anteriores, para las que el STR haya recibido los ficheros con los registros complementarios. No se realizará el Transaction Reporting para las operaciones realizadas en el día.

Los pasos internos en la consolidación serían los siguientes:

- Se comprueba la integridad de datos: que en el registro TP no falte ningún identificador que no esté informado (RI) y que el número de ejecución + fecha de ejecución del registro TP tengan asociados los registros obligatorios RO o RI, en el caso de existir los dos siempre tendrá prioridad el registro RO sobre el RI. Si hay inconsistencias en el cruce de datos, se informa al Miembro de mercado y Mercado. La operación se marca como ERROR y no se envía a la CA hasta que se corrija.

- Por cada registro que cumple la integridad de datos se aplican las validaciones ESMA y las propias de BME. En el caso de no superar las validaciones, la operación se marcará como ERROR y no enviará a CA hasta que se corrija.

- Al final de la consolidación se informará con un fichero de salida los registros FI-VA adecuados informando del estado de los registros.

Cualquier error producido se comunicará en los registros FI-VA.

Consolidación Previa

Existen dos consolidaciones automáticas, una previa y otra final.

17 horas día D+1: consolidación previa.

20 horas día D+1: consolidación final. Se realiza justo antes de enviar los TR a la autoridad competente.

Si la consolidación previa ha sido ACEPTADA, no es necesario volver a enviar los registros implicados, a no ser que sufran cambios en sus datos y haya que remitirlos de nuevo antes de la consolidación final.

Casos Especiales sobre información no enviada todavía a CNMV

El objetivo de esta sección es explicar cómo actuar antes situaciones excepcionales de forma automática sin intervenir en el sistema de forma manual.

1. Error en la sintaxis de los ficheros de Miembros de mercado (RI-RO)

   El Miembro de mercado debe enviar de nuevo todos los datos RI-RO con las correcciones adecuadas indicadas en el fichero de respuesta. Envía el fichero completo.

2. Error en la validación de contenido de los ficheros de Miembros de mercado (RI-RO)

   El Miembro de mercado enviará sólo los datos corregidos, usando el campo ACTION para distinguir Altas/Modificaciones de las Bajas.

3. Error en la CONSOLIDACION

El Miembro de mercado enviará los registros adecuados (RI-RO) que corrijan los errores de la consolidación que fueron informados en los registros de respuesta FI-VA.

En el proceso de consolidación puede que no exista uno o varios registros necesarios para realizar el Transaction Reporting. En este caso se adjunta en el fichero de respuesta al Miembro de mercado esta situación, a la espera de recibir los datos necesarios. El proceso de consolidación continúa con la siguiente operación.

El Miembro de mercado debe enviar las correcciones adecuadas, usando el campo ACTION.

6 Correcciones

La información del Transaction Reporting será enviada por el STR a la Autoridad Competente después de las 20:00 del día D+1, siendo D la fecha en la que fue realizada la ejecución y contando solamente días en los que hay sesión de negociación.

El plazo establecido para la comunicación de operaciones es hasta las 20h de D+1, en el supuesto de incluir operaciones de fechas anteriores, el sistema lo permite para facilitar una flexibilidad en la operativa diaria, aunque no debería ser lo habitual, puesto que CNMV lleva un control detallado de las operaciones recibidas con retraso con respecto al plazo definido en la MiFID. La información obtenida de fechas anteriores se integrará en el mismo fichero XML del proceso nocturno con la información de las operaciones comunicadas en plazo.

Para operaciones anteriores a D-1 (siendo D el día en que se envía el ficheor al STR) el miembro de mercado podrá enviar nueva información exclusivamente a través de registros RO, en los que informará de nuevos datos o correcciones de datos para operaciones ya informadas al STR.

En el caso de que se realice una modificación de una operación ya comunicada a la autoridad competente, el STR enviará una baja de la operación comunicada y, posteriormente, un alta con la nueva información de la operación.

Con respecto a las modificaciones se deben tener en cuenta las siguientes modificaciones:

1. Para la modificación de la información relativa a un titular de una operación XOFF, será necesario en envío de un TP de baja (implica dar de baja la operación entera), y el envío de los registros de alta (CT, DT, EW, DW, DR) necesarios para dar de alta la operación XOFF con la nueva titularidad.

2. El miembro de mercado tiene la capacidad de modificar la información de un TP en una operación XOFF. El STR validará que no se modifican campos no modificables en la operación (ver tabla campos modificables).

3. Un registro de baja implica dar de baja el registro correspondiente, salvo en los registros TP, que daría de baja la totalidad de la operación.

4. Todas las correcciones se generarán mediante registros TP (solo operaciones XOFF) y RO; no se aceptarán correcciones mediante registros RI para operaciones anteriores a D-1 (siendo D la fecha de envío del fichero).

Ficheros de requerimientos

La CNMV contempla la posibilidad de recibir operaciones, de forma excepcional, siempre bajo requerimiento a la entidad obligada. Para ello se ha implementado un procedimiento de comunicación de operaciones cuyo contenido son operaciones atrasadas y no remitidas en su momento, o rectificadas tras haber detectado la CNMV algún error en la calidad de la información. En cualquier caso la remisión de información en este tipo de ficheros se realizará bajo demanda de la CNMV a la entidad correspondiente, y nunca a iniciativa de la entidad que reporta. Cuando la detección de operaciones no enviadas o enviadas erróneas sea originada en la propia entidad, pondrá los hechos en conocimiento de la CNMV para que esta le autorice el envío de un fichero tipo REQ. Este procedimiento, denominado remisión complementaria, su principal objetivo es permitir a las entidades ponerse al día de la remisión de las operaciones de un modo ágil, sin entorpecer la cadencia diaria de remisión de ficheros de operaciones.

En los ficheros de requerimientos se procesará la totalidad de los registros. Un error en cualquiera de ellos supondrá un rechazo en toda la transmisión. A cada registro se le asignará el correspondiente código de error, en función de si ha superado o no las validaciones.

No todos los datos del Transaction Reporting anterior a corregir podrán ser modificados. Se detalla a continuación los campos de cada uno de los tipos de registro que se pueden enviar, señalando los campos que no pueden ser corregidos respecto al original:

Nº	RTS22	CAMPO	MODIFICA ORIGINAL	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	TP	Tipo de registro.
2		Action	S	Indica qué finalidad tiene el registro TP remitido. Si la operación reportada es XOFF, podrá ser B (baja). Si la operación reportada tiene un MIC de mercado, no podrá ser B (baja).
3		BuyrSellr	N	Sentido de la orden. Informa si la operación es de compra o venta.
4		ClientID	N	Código corto de cliente informado en la orden.
5		DcsnwFirm	N	Código corto de decisor dentro de la entidad informado en la orden.
6		ExctwFirm	N	Código corto de ejecutor dentro de la entidad informado en la orden.
7		PType	S si es XOFF N en otro caso	Tipo de identificación de la contrapartida.
8	7,16	LEICnpty	S si es XOFF N en otro caso	Contrapartida de la operación. (LEI de la Entidad de Contrapartida Central del mercado).

9	7,16	MICCnpty	S si es XOFF N en otro caso	Si PType=MIC, el MIC de la contrapartida de la operación.
10	2	TxId	N	ID del Transaction Reporting.
11	3	TradPlcMtchgId	N	ID de la ejecución de mercado.
12	4	ExctgPty	N	Código LEI de la entidad que ejecuta la transacción.
13	5	InvstmtPtyInd	N	Indicador de si el Miembro de mercado está o no bajo las Directivas 39/2004 o 65/2014.
14	6	SubmitgPty	N	Código LEI de la entidad que remite el TR.
15	25	TrnsmssnInd	S si es XOFF N en otro caso	Indicador de transmisión de la orden.
16	28	TradDt	S si es XOFF N en otro caso	Fecha de la ejecución.
17	29	TradgCpcty	S	Indicador de capacidad.
18	30	TypeQty	S si es XOFF N en otro caso	Tipo de unidades de la cantidad de la operación.
19	30	Unit	N	Unidades de contratación. Para Renta Variable, Derivados y algunas operaciones de los mercados de Renta Fija.
20	30	NnmMntry	N	Unidades monetarias.
21	31	QtyCurrency	N	Divisa de la cantidad.
22	33	TypePric	N	Tipo de precio de la operación.
23	33	Pric	S si es XOFF N en otro caso	Precio.
24	33	BsisPts	S si es XOFF N en otro caso	Precio del instrumento expresado en porcentaje. Solo aplica a algunos productos de los mercados de Renta Fija.
25	34	Currency	N	Divisa del precio de la transacción. Solo si el precio es expresado en unidades monetarias.
26	35	NetAmt	N	Importe neto de la transacción.
27	36	TradVn	N	Código MIC del mercado donde se ha ejecutado la transacción.
28	37	CtryOfBrnch	S	País de la sucursal del Miembro de mercado.
29	38	UpFrntPmt	N	Importe del pago up-front.
30	39	UpFrntPmt _currency	N	Divisa del pago up-front.
31	40	CmplxTrad CmpntId	S	Código que relaciona distintas ejecuciones como parte de un package.
32	41	InstrmId	N	Código ISIN del instrumento financiero.

Sensitivity: C2 Internal

33	61	WvrInd	S	Indicador de tipo de waiver.
34	65	SctiesFincgTxInd	S	Se indicará «true» cuando la operación esté comprendida en el ámbito de actividad, pero esté exenta de la obligación de comunicación en virtud del Reglamento (UE) 2015/2365. «false» en caso contrario.

Nº	RTS 22	CAMPO	MODIFICA ORIGINAL	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	RO	Tipo de registro.
2		Action	S	Indica qué finalidad tiene el registro CT remitido.
3	4	ExctgPty	N	Código LEI de la entidad que ejecuta la operación.
4	36	TrdnVn	N	Código MIC del Mercado para el que se crea el registro.
5		Número de ejecución	N	Número de la operación para la que se facilitan datos.
6		Fecha de ejecución	N	Detalle de la fecha de la ejecución con el formato: YYYY-MM-DD.
7		BuyrSellr	N	Sentido de la operación.
8		SubRegistro	CT	Tipo de registro.
9		PType	S	Tipo de identificación del comprador o vendedor.
10	7,16	LEI	S	Si PType=LEI. Código LEI del cliente. En el supuesto de que el identificador sea un ordenante (caso de Gestoras) será el LEI de la gestora.
11	7,16	Prsn_SchmeNm	S	Si PType=P. Tipo de identificación de la persona física.
12	7,16	Prsn_Id	S	Si PType=P. Código de identificación del cliente. DNI para España.
13	9,18	Prsn_FrstNm	S	Si PType=P. Nombre del cliente.
14	10,19	Prsn_Nm	S	Si PType=P. Apellidos del cliente.
15	11,20	Prsn_BirthDt	S	Si PType=P. Fecha de nacimiento del cliente.

Sensitivity: C2 Internal

16	8, 17	CtryOfBrnch [No aplica a Renta Variable, sí aplica a Derivados y Renta Fija].	S	Este campo debe indicar el país de la sucursal que haya recibido la orden del cliente o haya tomado una decisión de inversión en nombre de un cliente de conformidad con un mandato discrecional otorgado por dicho cliente. Si dicha actividad no ha sido llevada a cabo por una sucursal, se indicará el código del Estado miembro de origen de la empresa de servicios de inversión o el código del país en el que la empresa de servicios de inversión tenga su administración central o domicilio social (en el caso de empresas de terceros países). Cuando la operación corresponda a una orden transmitida que cumpla las condiciones de transmisión previstas en el artículo 4, este campo se deberá cumplimentar con la información recibida de la empresa transmisora.

Nº	RTS 22	CAMPO	MODIFICA ORIGINAL	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	RO	Tipo de registro.
2		Action	S	Indica qué finalidad tiene el registro DT remitido.
3	4	ExctgPty	N	Código LEI de la entidad que ejecuta la operación.
4	36	TrdnVn	N	Código MIC del Mercado para el que se crea el registro.
5		Número de ejecución	N	Número de la operación para la que se facilitan datos.
6		Fecha de ejecución	N	Detalle de la fecha de la ejecución con el formato: YYYY-MM-DD.
7		BuyrSellr	N	Sentido de la operación.
8		SubRegistro	DT	Tipo de registro.
9		Dcsn_typePrsn	S	Indica si el decisor es persona física o jurídica.
10	12,21	LEI	S	Si PType=LEI. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación. LEI del decisor .
11	12,21	Prsn_SchmeNm	S	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación y este es una persona física. Tipología de código de identificación del decisor persona física.
12	12,21	Prsn_Id	S	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación. National ID del decisor.
13	13,22	Prsn_FrstNm	S	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación y este es una persona física. Nombre del decisor.

14	14,23	Prsn_Nm	S	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación y este es una persona física. Apellidos del decisor.
15	15,24	Prsn_BirthDt	S	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación y este es una persona física. Fecha de nacimiento del decisor.

Nº	RTS 22	CAMPO	MODIFICA ORIGINAL	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	RO	Tipo de registro.
2		Action	S	Indica qué finalidad tiene el registro TS remitido.
3	4	ExctgPty	N	Código LEI de la entidad que ejecuta la operación.
4	36	TrdnVn	N	Código MIC del Mercado para el que se crea el registro.
5		Número de ejecución	N	Número de la operación para la que se facilitan datos.
6		Fecha de ejecución	N	Detalle de la fecha de la ejecución con el formato: YYYY-MM-DD.
7		BuyrSellr	N	Sentido de la operación.
8		TypeReg	TS	Tipo de registro.
9	25	Transmission of order indicator	S	Indica si hay transmisión de la orden de una entidad a otra.
10	26,27	Trnsmttg	S	Código LEI de otra entidad que transmite la orden al Miembro de Mercado, cuando se cumplen las condiciones de transmisión.

Nº	RTS 22	CAMPO	MODIFICA ORIGINAL	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	RO	Tipo de registro.
2		Action	S	Indica qué finalidad tiene el registro DW remitido.
3	4	ExctgPty	N	Código LEI de la entidad que ejecuta la operación.
4	36	TrdnVn	N	Código MIC del Mercado para el que se crea el registro.
5		Número de ejecución	N	Número de la operación para la que se facilitan datos.
6		Fecha de ejecución	N	Detalle de la fecha de la ejecución con el formato: YYYY-MM-DD.

Sensitivity: C2 Internal

7		BuyrSellr	N	Sentido de la operación.
8		SubRegistro	DW	Tipo de registro.
9	57	Dcsn_typePrsn	S	Tipo de decisor.
10	57	Dcsn_Algo	S	Si Dcsn_typePrsn='A'. Código del algoritmo que toma la decisión de la operación dentro de la entidad.
11	57	Dcsn_Othr_SchNm	S	Si Dcsn_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID.
12	57	Dcsn_Othr_Id	S	Si Dcsn_typePrsn='P'. National_ID de la persona que toma la decisión de la operación dentro de la entidad.
13	58	Dcsn_CtryOfBrnch	S	Si Dcsn_typePrsn='P'. País donde se encuentra el responsable de la decisión de la operación dentro de la entidad. Si la decisión la toma un algoritmo se deja vacío.

Nº	RTS 22	CAMPO	MODIFICA ORIGINAL	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	RO	Tipo de registro.
2		Action	S	Indica qué finalidad tiene el registro EW remitido.
3	4	ExctgPty	N	Código LEI de la entidad que ejecuta la operación.
4	36	TrdnVn	N	Código MIC del Mercado para el que se crea el registro.
5		Número de ejecución	N	Número de la operación para la que se facilitan datos.
6		Fecha de ejecución	N	Detalle de la fecha de la ejecución con el formato: YYYY-MM-DD.
7		BuyrSellr	N	Sentido de la operación.
8		SubRegistro	EW	Tipo de registro.
9	59	Exct_typePrsn	S	Tipo de ejecutor de la operación dentro de la entidad.
10	59	Exct_Algo	S	Si Exct_typePrsn='A'. Código del algoritmo que envía la orden al mercado dentro del miembro ejecutor.
11	59	Exct_Othr_SchNm	S	Si Exct_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID.
12	59	Exct_Othr_Id	S	Si Exct_typePrsn='P'. National_ID de la persona que envía la orden al mercado dentro del miembro ejecutor.

13	60	Exct_CtryOfBrnch	S	Si Exct_typePrsn='P'. País de la sucursal que supervisa a la persona responsable de la ejecución. Solo se cumplimenta si no es un algoritmo.

Nº	RTS 22	CAMPO	MODIFICA ORIGINAL	DESCRIPCIÓN
1		TypeReg	RO	Tipo de registro.
2		Action	S	Indica qué finalidad tiene el registro DR remitido.
3	4	ExctgPty	N	Código LEI de la entidad que ejecuta la operación.
4	36	TrdnVn	N	Código MIC del Mercado para el que se crea el registro.
5		Número de ejecución	N	Número de la operación para la que se facilitan datos.
6		Fecha de ejecución	N	Detalle de la fecha de la ejecución con el formato: YYYY-MM-DD.
7		BuyrSellr	N	Sentido de la operación.
8		TypeReg	DR	Tipo de registro.
9	40	CmplxTradCmpntID	S	Código de identificación único para las ejecuciones que componen una cesta o una estrategia de contratos.
10	62	ShrtSellgInd	S	Indicador de venta en corto. Se cumplimenta en las operaciones de venta, tanto para cuenta propia como para clientes. Si es una orden agregada se deja en blanco. Se puede rellenar con los códigos: 'SSEX' - Short sale with exemption. Es una operación de venta en corto de tipo Market Making o en mercado primario 'SESH' - Short sale with no exemption. Todas las demás ventas en corto 'SELL' - No short sale. Es una venta ordinaria, no hay venta en corto. 'UNDI' – Information not available.
11	64	RskRdcgTx	S	Indicador de disminución del riesgo en materias primas, solo aplica en warrants, certificados y derivados de energía. Si la operación reduce el riesgo en una commodity="True", sino "False".

12	8,17	CtryOfBrnch [Aplica a Renta Variable, no aplica a Derivados y Renta Fija]	S	Este campo debe indicar el país de la sucursal que haya recibido la orden del cliente o haya tomado una decisión de inversión en nombre de un cliente de conformidad con un mandato discrecional otorgado por dicho cliente, conforme a lo dispuesto en el artículo 14, apartado 3. Si dicha actividad no ha sido llevada a cabo por una sucursal, se indicará el código del Estado miembro de origen de la empresa de servicios de inversión o el código del país en el que la empresa de servicios de inversión tenga su administración central o domicilio social (en el caso de empresas de terceros países). Cuando la operación corresponda a una orden transmitida que cumpla las condiciones de transmisión previstas en el artículo 4, este campo se deberá cumplimentar con la información recibida de la empresa transmisora.
13	63	OTCPstTradInd	S	Indicador de post-trade OTC Solo aplicable a la pata de la transacción del Miembro de mercado con su cliente, es decir, al XOFF (del Miembro de mercado a sus clientes). Se puede completar con los siguientes flags: Para todos los instrumentos: BENC = Operación con parámetros de referencia. ACTX = Operación cruzada (agency cross). LRGS = Operación de gran volumen post-negociación. ILQD = Operación con instrumentos no líquidos. SIZE = Operación por encima del tamaño específico. CANC = Anulación. AMND = Modificación. Para las acciones e instrumentos asimilados: SDIV = Operaciones con dividendo especial. RPRI = Operaciones que han obtenido una mejora de precio. DUPL = Comunicaciones de negociación duplicadas. TNCP = Operaciones que no contribuyen al proceso de formación de precios a efectos del artículo 23 del Reglamento (UE) n 600/2014. Para los instrumentos distintos de acciones y de instrumentos asimilados: TPAC = Operación combinada. XFPH = Operación de intercambio de activos físicos.

Sensitivity: C2 Internal

14	Exento	S	Todas las operaciones estarán por defecto incluidas en el TR (este campo será FALSE por defecto). En el caso de que alguna operación de la entidad no tuviera que ser incluida en el TR, este campo debería ser marcado como TRUE.

Validaciones que realizarán sobre el contenido de los ficheros:

- Se validará la estructura de los registros. Se validará que no se modifica ningún campo no modificable.
- Se verificará que el Miembro de mercado esté adherido al Servicio del Transaction Reporting para las fechas de ejecución comunicadas.
- Se validará que el número de ejecución, el MIC del mercado, el código ISIN, el sentido, la cantidad de valores y el Miembro de mercado informados en cada uno de los registros TP o RO contenidos en el fichero tenga su correspondencia con los datos de la ejecución registrados en el sistema.
- Cuando la modificación afecte a un desglose, se verificará que la suma de títulos asignados a cada uno de los clientes del desglose sea igual al número de títulos/contratos de la negociación.
- Se validará que no existan registros duplicados. Se validará que no haya titulares duplicados dentro de un mismo registro de clientes tipo “CT”.
- El campo tipo de actuación el sistema actuará del siguiente modo:
  - “A”: Alta de la operación. Se verificará que:
    - O bien la operación existe y no ha sido comunicada al supervisor: de ser correctas las validaciones, se generará la comunicación de la operación al supervisor, en caso contrario, se enviará a error.
    - O bien la operación existe y fue comunicada al supervisor: de ser correctas las validaciones, se generará una comunicación de baja de la operación y una de alta con los nuevos datos comunicados por el Miembro de mercado, en caso contrario, se enviará a error.
  - “B”: Baja de la operación, se verificará que la operación existe y que fue comunicada al supervisor, de ser correctas las validaciones, se generará la comunicación de baja de la operación, en caso contrario, se enviará a error.

Sensitivity: C2 Internal

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 9598001WTPGD8A01N979 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.

¿Cómo reportará esta entidad?

El registro TP es enviado directamente por BME al STR. No lo remite el miembro

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	B
4	CT	ClientID	0
5	DW	DcsnwFirm	120
6	EW	ExctwFirm	333
7		PType	LEI
8	7,16	LEICnpty	5299009QA8BBE2OOB349
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	20170821XMRVFI1234678901B
11	3	TradPlcMtchgId	FI1234678901
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800T2W59YXMVKRU25
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T09:55:33.101010Z
17	29	TradgCpcty	DEAL
18	30	TypeQty	U

19	30	Unit	1000
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	
22	33	TypePric	M
23	33	Pric	58.95
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XMRV
28	37	CtryOfBrnch	DE
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	ES0B00036912
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-CT
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		Número de ejecución	FI1234678901
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	B
8		SubRegistro	CT
9		PType	LEI
10	7.16	LEI	9598001WTPGD8A01N979
11	7.16	Prsn_SchmeNm	

12	7.16	Prsn_Id	
13	9.18	Prsn_FrstNm	
14	10.19	Prsn_Nm	
15	11.2	Prsn_BirthDt	
16	8.17	CTCtryOfBrnch	DE

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-DW
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	120
8		SubRegistro	DW
9	57	Dcsn_typePrsn	P
10	57	Dcsn_Algo	
11	57	Dcsn_Othr_SchNm	CONCAT
12	57	Dcsn_Othr_Id	HU19700512JEAN#FAURE
13	58	Dcsn_CtryOfBrnch	US

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-EW
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	333

8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	P
10	59	Exct_Othr_SchNm	
11	59	Exct_Algo	CONCAT
12	59	Exct_Othr_Id	HU19800413ADAM#JONES
13	60	Exct_CtryOfBrnch	US

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 549300CM0SIFOD4OTQ89 usa el código de miembro de la ESI Y (proveedor de DEA) que tiene LEI 9598001WTPGD8A01N979 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 ALGO56789 es el responsable de la ejecución. Dado que la ESI X ha cumplido las condiciones de transmisión bajo el artículo 4 del RTS 22 no tiene obligación de reporte.

¿Cómo reportará la entidad Y?

El registro TP es enviado directamente por BME al STR. No lo remite el miembro

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	B
3	CT	ClientID	122
4	DW	DcsnwFirm	0
5	EW	ExctwFirm	334
7		PType	LEI
8	7.16	LEICnpty	5299009QA8BBE2OOB349
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	20170821XMRVFI1234678011B

11	3	TradPlcMtchgId	FI1234678011
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800T2W59YXMVKRU25
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T09:55:33.101010Z
17	29	TradgCpcty	AOTC
18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	1000
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	
22	33	TypePric	M
23	33	Pric	58.95
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XMRV
28	37	CtryOfBrnch	ES
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	ES0B00036912
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Nº	RTS22	CAMPO	REGISTRO RI-CT
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV

5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	122
8		SubRegistro	CT
9		PType	P
10	7.16	LEI	
11	7.16	Prsn_SchmeNm	CONCAT
12	7.16	Prsn_Id	FR19620604JEAN#COCTE
13	9.18	Prsn_FrstNm	JEAN
14	10.19	Prsn_Nm	COCTEAU
15	11.2	Prsn_BirthDt	04-06-1962
16	8.17	CTCtryOfBrnch	FR

Nº	RTS22	Campo	REGISTRO RI-TS
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	122
8		SubRegistro	TS
9	25	TrnsmssnInd	0
10	26,27	Trnsmttg	549300CM0SIFOD4OTQ89

Nº	RTS22	Campo	REGISTRO RI-EW
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979

4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	334
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	A
10	59	Exct_Algo	ALGO56789
11	59	Exct_Othr_SchNm	
12	59	Exct_Othr_Id	
13	60	Exct_CtryOfBrnch	

Ejemplo 3. Corresponde con ej. 65 para Investment Firm y Guidelines 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 XMRV el 20 de agosto de 2018 a las 14:51:09.123 a un precio de 32.5 EUR usando un algoritmo cuyo identificador es: ALGO12345. El Mercado asigna un código de identificación de transacción de FI1034078012.

¿Cómo reportará la entidad Y?

El registro TP es enviado directamente por BME al STR. No lo remite el miembro

Nº	RTS22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	B
4	CT	ClientID	169
5	DW	DcsnwFirm	
5	EW	ExctwFirm	335
7		PType	LEI

8	7.16	LEICnpty	5299009QA8BBE2OOB349
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	20170821XMRVFI1034078012B
11	3	TradPlcMtchgId	FI1034078012
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800T2W59YXMVKRU25
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T09:55:33.101010Z
17	29	TradgCpcty	MTCH
18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	1000
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	
22	33	TypePric	M
23	33	Pric	32.5
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XMRV
28	37	CtryOfBrnch	ES
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	ES0B00036912
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Nº	RTS22	CAMPO	REGISTRO RI-CT
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	169
8		SubRegistro	CT
9		PType	LEI
10	7.16	LEI	9598001WTPGD8A01N979
11	7.16	Prsn_SchmeNm	
12	7.16	Prsn_Id	
13	9.18	Prsn_FrstNm	
14	10.19	Prsn_Nm	
15	11.2	Prsn_BirthDt	
16	8.17	CTCtryOfBrnch	FR

Nº	RTS22	CAMPO	REGISTRO RI-EW
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	335
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	A
10	59	Exct_Algo	ALGO12345

11	59	Exct_Othr_SchNm
12	59	Exct_Othr_Id
13	60	Exct_CtryOfBrnch

Posteriormente, el Miembro se da cuenta de que el reporte del registro EW es incorrecto porque el ID 335 para informar esta operación corresponde al algoritmo "ALGO2222", en lugar de al algoritmo "ALGO12345" que ha ejecutado esta operación. Se vuelve a enviar corregido el registro EW mediante un Registro por Operación RO.

Nº	RTS22	CAMPO	REGISTRO RO-EW
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		Número de ejecución	FI1034078012
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	B
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	A
10	59	Exct_Algo	ALGO2222
11	59	Exct_Othr_SchNm	
12	59	Exct_Othr_Id	
13	60	Exct_CtryOfBrnch	

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

Ejemplo 4.

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 certificados sobre el oro.

La entidad E1 realiza una operación por cuenta de terceros en el mercado XMAD de venta de 10.000 certificados sobre el oro. La entidad utiliza un algoritmo que se encarga tanto de la decisión de la operación como de su envío al mercado.

Grupo 1 de registros:

El registro TP es enviado directamente por BME al STR. No lo remite el miembro

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	S
4	CT	ClientID	1
5	DW	DcsnwFirm	222
6	EW	ExctwFirm	333
7		PType	LEI
8	7,16	LEICnpty	5299009QA8BBE2OOB349
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	20170821XMAD123456789S
11	3	TradPlcMtchgId	123456789
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800UYJM40XUGVGG78
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T09:55:33.101010Z
17	29	TradgCpcty	AOTC
18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	10000
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	

22	33	TypePric	M
23	33	Pric	10.15
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XMAD
28	37	CtryOfBrnch	ES
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	DE000SG1DQ67
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Al tratarse de un mercado de Renta Variable, el registro RO-CT es enviado directamente por BME al STR. No lo remite el miembro.

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-CT
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMAD
5		Número de ejecución	123456789
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	CT
9		PType	INTC
10	7,16	LEI	
11	7,16	Prsn_SchmeNm	
12	7,16	Prsn_Id	

13	9,18	Prsn_FrstNm
14	10,19	Prsn_Nm
15	11,2	Prsn_BirthDt
16	8,17	CTCtryOfBrnch

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-DW
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMAD
5		Número de ejecución	123456789
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	DW
9	57	Dcsn_typePrsn	A
10	57	Dcsn_Algo	1234ALGO
11	57	Dcsn_Othr_SchNm	
12	57	Dcsn_Othr_Id	
13	58	Dcsn_CtryOfBrnch	

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-EW
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMAD
5		Número de ejecución	123456789
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	A

10	59	Exct_Algo	456ALGO
11	59	Exct_Othr_SchNm	
12	59	Exct_Othr_Id	
13	60	Exct_CtryOfBrnch	

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-DR
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMAD
5		Número de ejecución	123456789
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	DR
9	40	CmplxTradCmpntId	
10	62	ShrtSellgInd	
11	64	RskRdcgTx	0
12	8,17	CtryOfBrnch	ES
13	63	OTCPstTradInd	
14		Exento	0

Grupo 2 de registros:

Nº	RTS22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	S
4	CT	ClientID	121
5	DW	DcsnwFirm	222

6	EW	ExctwFirm	333
7		PType	INTC
8	7,16	LEICnpty	
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	XX20170821XMAD123456789S1234567890123456789
11	3	TradPlcMtchgId	XX20170821XMAD123456789S1234567890123456789
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800QN4DV2FYZS9Q98
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T09:56:33.101010Z
17	29	TradgCpcty	AOTC
18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	9000
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	
22	33	TypePric	M
23	33	Pric	10.15
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XOFF
28	37	CtryOfBrnch	ES
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	DE000SG1DQ67
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-CT
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XOFF
5		Número de ejecución	XX20170821XMAD123456789S1234567890123456789
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	CT
9		PType	P
10	7,16	LEI	
11	7,16	Prsn_SchmeNm	NIDN
12	7,16	Prsn_Id	ES12345678A
13	9,18	Prsn_FrstNm	CARLOS MARIA
14	10,19	Prsn_Nm	GONZALEZ RIOS
15	11,2	Prsn_BirthDt	21-08-1970
16	8,17	CTCtryOfBrnch	

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-EW
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XOFF
5		Número de ejecución	XX20170821XMAD123456789S1234567890123456789
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	P
10	59	Exct_Othr_SchNm	

11	59	Exct_Algo	NIDN
12	59	Exct_Othr_Id	ES1234567C
13	60	Exct_CtryOfBrnch	ES

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-DR
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XOFF
5		Número de ejecución	XX20170821XMAD123456789S1234567890123456789
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	DR
9	40	CmplxTradCmpntId	
10	62	ShrtSellgInd	SESH
11	64	RskRdcgTx	1
12	8,17	CtryOfBrnch	ES
13	63	OTCPstTradInd	SIZE
14		Exento	0

Grupo 3 de registros:

Al tratarse de una operación XOFF los registros TP y complementarios deben ser remitidos por el miembro al STR

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	S
4	CT	ClientID	122
5	DW	DcsnwFirm	222
6	EW	ExctwFirm	333

7		PType	INTC
8	7,16	LEICnpty	
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	XX20170821XMAD123456789S1234567890123456700
11	3	TradPlcMtchgId	XX20170821XMAD123456789S1234567890123456700
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800QN4DV2FYZS9Q98
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T09:56:33.101010Z
17	29	TradgCpcty	AOTC
18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	1000
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	
22	33	TypePric	M
23	33	Pric	10.15
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XOFF
28	37	CtryOfBrnch	ES
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	DE000SG1DQ67
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-CT
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XOFF
5		Número de ejecución	XX20170821XMAD123456789S1234567890123456700
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	CT
9		PType	P
10	7,16	LEI	
11	7,16	Prsn_SchmeNm	NIDN
12	7,16	Prsn_Id	ES87654321A
13	9,18	Prsn_FrstNm	MANUEL
14	10,19	Prsn_Nm	RODRIGUEZ SANZ
15	11,2	Prsn_BirthDt	1965-11-19
16	8,17	CTCtryOfBrnch	

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-EW
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XOFF
5		Número de ejecución	XX20170821XMAD123456789S1234567890123456700
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	P
10	59	Exct_Othr_SchNm	

11	59	Exct_Algo	NIDN
12	59	Exct_Othr_Id	ES1234567C
13	60	Exct_CtryOfBrnch	ES

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-DR
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XOFF
5		Número de ejecución	XX20170821XMAD123456789S1234567890123456700
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	DR
9	40	CmplxTradCmpntId	
10	62	ShrtSellgInd	SESH
11	64	RskRdcgTx	1
12	8,17	CtryOfBrnch	ES
13	63	OTCPstTradInd	ACTX
14		Exento	0

Ejemplo 5.

La persona física F, con poder de representación del cliente C, realiza una operación de compra de 900 acciones en el mercado XBAR en nombre de su cliente. La entidad financiera E2, con sucursal en España, ejecuta la orden recibida mediante un algoritmo.

El registro TP es enviado directamente por BME al STR. No lo remite el miembro

Nº	RTS22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A

3		BuyrSellr	B
4	CT	ClientID	111
5	DW	DcsnwFirm	
6	EW	ExctwFirm	
7		PType	LEI
8	7,16	LEICnpty	5299009QA8BBE2OOB349
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	20170821XBAR123456780B
11	3	TradPlcMtchgId	123456780
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800Z25H6MSXFBBG16
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T09:56:33.101010Z
17	29	TradgCpcty	MTCH
18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	900
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	
22	33	TypePric	M
23	33	Pric	8.92
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XBAR
28	37	CtryOfBrnch	ES
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	ES0115056139

Sensitivity: C2 Internal

33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-CT
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XBAR
5		Número de ejecución	123456780
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	B
8		SubRegistro	CT
9		PType	P
10	7,16	LEI	
11	7,16	Prsn_SchmeNm	NIDN
12	7,16	Prsn_Id	ES12345678A
13	9,18	Prsn_FrstNm	CARLOS MARIA
14	10,19	Prsn_Nm	GONZALEZ RIOS
15	11,2	Prsn_BirthDt	1970-08-21
16	8,17	CTCtryOfBrnch	

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-DT
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XBAR
5		Número de ejecución	123456780
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	B

Sensitivity: C2 Internal

8		SubRegistro	DT
9		Dcsn_typePrsn	P
10	12,21	LEI	
11	12,21	Prsn_SchmeNm	NIDN
12	12,21	Prsn_Id	ES9234569C
13	13,22	Prsn_FrstNm	JOSE
14	14,23	Prsn_Nm	GOMEZ RAMOS
15	15,24	Prsn_BirthDt	1965-03-01

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-EW
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XBAR
5		Número de ejecución	123456780
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	B
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	A
10	59	Exct_Algo	456ALGO
11	59	Exct_Othr_SchNm	
12	59	Exct_Othr_Id	
13	60	Exct_CtryOfBrnch	

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-DR
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XBAR
5		Número de ejecución	123456780

6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	B
8		SubRegistro	DR
9	40	CmplxTradCmpntId	
10	62	ShrtSellgInd	
11	64	RskRdcgTx	
12	8,17	CtryOfBrnch	ES
13	63	OTCPstTradInd	
14		Exento	0

Ejemplo 6.1. Corresponde con ejemplo 70 de Guidelines de ESMA.

(Documento codificado como ESMA/2016/1452).

El cliente 1 Jean Cocteau, es cliente de la firma de inversión X que tiene LEI 549300CM0SIFOD4OTQ89. Una persona, Fabio Luca, actuando bajo poder de representación para el cliente 1, el representante 1, decide vender una cantidad de 500 derivados de materias primas pertenecientes al cliente 1 a un precio no menor de 32,5 euros y manda instrucciones a la sucursal francesa de la firma de inversión X. El trader 1 supervisado por la central del Reino Unido de la firma X, acepta la orden del representante 1 y manda instrucción a la firma de inversión Y. El trader 4 decide aceptar la orden de la firma de inversión X y manda la orden a la firma de inversión Z que tiene LEI 9598001WTPGD8A01N979. La firma de inversión Z es una firma del Reino Unido. El trader 5 decide aceptar la orden de la firma de inversión Y el trader 6, Adam Jones, envía la orden al mercado M.

La orden es parcialmente ejecutada en el libro de órdenes del mercado XMRV a las 13:40:23.4672 el 1 de julio de 2018 por 500 contratos a un precio de 32,50 euros. El mercado asigna el código de identificación de transacción FI1234678901.

Si la entidad Z realiza la operación en Cuenta Propia, con intención de realizar un posterior traspaso al cliente, ¿cómo debería reportar?

Grupo 1 de reporte:

Este registro TP es enviado directamente por BME al STR. No lo remite el miembro.

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	S
4	CT	ClientID	111
5	DW	DcsnwFirm	144
6	EW	ExctwFirm	166
7		PType	LEI
8	7,16	LEICnpty	5299009QA8BBE2OOB349
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	20170821XMRVFI1234678902S
11	3	TradPlcMtchgId	FI1234678902
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800T2W59YXMVKRU25
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T13:40:23.4672Z
17	29	TradgCpcty	DEAL
18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	500
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	
22	33	TypePric	M
23	33	Pric	32.5
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XMRV
28	37	CtryOfBrnch	GB
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	ES0B00033315
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-CT
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
8		ID	111
9		SubRegistro	CT
10		PType	LEI
11	7,16	LEI	9598001WTPGD8A01N979
12	7,16	Prsn_SchmeNm	
13	7,,16	Prsn_Id	
14	9,18	Prsn_FrstNm	
15	10,19	Prsn_Nm	
16	11,2	Prsn_BirthDt	
17	8,17	CTCtryOfBrnch	

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-DW
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	144
8		SubRegistro	DW
9	57	Dcsn_typePrsn	P
10	57	Dcsn_Algo	

11	57	Dcsn_Othr_SchNm	NIDN
12	57	Dcsn_Othr_Id	ES0234560C
13	58	Dcsn_CtryOfBrnch	GB

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-EW
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	166
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	P
10	59	Exct_Algo	
11	59	Exct_Othr_SchNm	CONCAT
12	59	Exct_Othr_Id	HU19800413ADAM#JONES
13	60	Exct_CtryOfBrnch	GB

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-DR
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		Número de ejecución	FI1234678902
6		F_Inicial	2017-08-21
7		F_Final	2017-08-21
8		BuyrSellr	S
9		SubRegistro	DR

10	40	CmplxTradCmpntId	
11	62	ShrtSellgInd	
12	64	RskRdcgTx	0
13	8,17	CtryOfBrnch	
14	63	OTCPstTradInd	
15		Exento	0

Grupo 2 de registros:

Este registro TP se corresponde con un registro XOFF. Lo envía el miembro.

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	S
4	CT	ClientID	122
5	DW	DcsnwFirm	
6	EW	ExctwFirm	166
7		PType	LEI
8	7,16	LEICnpty	9598001WTPGD8A01N979
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	XX20170821XMRVFI1234678902S001
11	3	TradPlcMtchgId	XX20170821XMRVFI1234678902S001
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800QN4DV2FYZS9Q98
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T13:40:23.4672Z
17	29	TradgCpcty	AOTC
18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	500
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	

22	33	TypePric	M
23	33	Pric	32.5
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XOFF
28	37	CtryOfBrnch	
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	ES0B00033315
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-CT
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XOFF
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	122
8		SubRegistro	CT
9		PType	P
10	7,16	LEI	
11	7,16	Prsn_SchmeNm	CONCAT
12	7,16	Prsn_Id	FR19620604JEAN#COCTE
13	9,18	Prsn_FrstNm	JEAN
14	10,19	Prsn_Nm	COCTEAU
15	11,2	Prsn_BirthDt	1962-06-04
16	8, 17	CTCtryOfBrnch	FR

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-DT
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
5	36	TrdnVn	XOFF
6		F_Inicial	2017-08-21
7		F_Final	2017-08-21
8		ID	122
9		SubRegistro	DT
10		Dcsn_typePrsn	P
11	12,21	LEI	
12	12,21	Prsn_SchmeNm	NIDN
13	12,21	Prsn_Id	ITABCDEF1234567890
14	13,22	Prsn_FrstNm	FABIO
15	14,23	Prsn_Nm	LUCA
16	15,24	Prsn_BirthDt	1962-11-10

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-TS
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XOFF
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	122
8		SubRegistro	TS
9	25	TrnsmssnInd	0
10	26,27	Trnsmttg	549300CM0SIFOD4OTQ89

1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XOFF
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	166
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	P
10	59	Exct_Algo	
11	59	Exct_Othr_SchNm	CONCAT
12	59	Exct_Othr_Id	HU19800413ADAM#JONES
13	60	Exct_CtryOfBrnch	GB

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-DR
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XOFF
5		Número de ejecución	XX20170821XMRVFI1234678901S001
6		F_Inicial	2017-08-21
7		F_Final	2017-08-21
8		BuyrSellr	S
9		SubRegistro	DR
10	40	CmplxTradCmpntId	
11	62	ShrtSellgInd	
12	64	RskRdcgTx	1
13	8,17	CtryOfBrnch	

14	63	OTCPstTradInd	
15		Exento	0

Ejemplo 6.2. Corresponde con ejemplo 71 de Guidelines de ESMA.

(Documento codificado como ESMA/2016/1452).

Partiendo de los datos del ejemplo 7.1, si la entidad Z realiza la operación directamente no en cuenta Propia sino en la del cliente, ¿cómo debería reportar?

Grupo 1 de reporte:

Este registro TP es enviado directamente por BME al STR. No lo remite el miembro.

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	S
4	CT	ClientID	122
5	DW	DcsnwFirm	0
6	EW	ExctwFirm	166
7		PType	LEI
8	7,16	LEICnpty	5299009QA8BBE2OOB349
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	20170821XMRVFI1234678999S
11	3	TradPlcMtchgId	FI1234678999
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800T2W59YXMVKRU25
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T13:40:23.4672Z
17	29	TradgCpcty	AOTC
18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	500
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	

22	33	TypePric	M
23	33	Pric	32.5
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XMRV
28	37	CtryOfBrnch	
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	ES0B00033315
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-CT
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	122
8		SubRegistro	CT
9		PType	P
10	7,16	LEI	
11	7,16	Prsn_SchmeNm	CONCAT
12	7,16	Prsn_Id	FR19620604JEAN#COCTE
13	9,18	Prsn_FrstNm	JEAN
14	10,19	Prsn_Nm	COCTEAU
15	11,2	Prsn_BirthDt	1962-06-04
16	8,17	CTCtryOfBrnch	FR

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-DT
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
5	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	122
8		SubRegistro	DT
9		Dcsn_typePrsn	P
10	12,21	LEI	
11	12,21	Prsn_SchmeNm	NIDN
12	12,21	Prsn_Id	ITABCDEF1234567890
13	13,22	Prsn_FrstNm	FABIO
14	14,23	Prsn_Nm	LUCA
15	15,24	Prsn_BirthDt	1962-11-10

No se envía registro RI-DW al no haber decisor dentro de la firma

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-EW
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	166
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	P

10	59	Exct_Algo	
11	59	Exct_Othr_SchNm	CONCAT
12	59	Exct_Othr_Id	HU19800413ADAM#JONES
13	60	Exct_CtryOfBrnch	GB

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-TS
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	2017-08-21
7		ID	122
8		SubRegistro	TS
9	25	TrnsmssnInd	0
10	26,27	Trnsmttg	549300CM0SIFOD4OTQ89

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-DR
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMRV
5		Número de ejecución	FI1234678999
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	S
8		SubRegistro	DR
9	40	CmplxTradCmpntId	
10	62	ShrtSellgInd	
11	64	RskRdcgTx	1
12	8,17	CtryOfBrnch	

13	63	OTCPstTradInd	
14		Exento	0

Ejemplo 7. Operación sobre instrumentos de energía en el mercado de MEFF *Power*

Un operador de una empresa de energía, la Empresa P con LEI 9598001WTPGD8A01N979, miembro del mercado, decide comprar 100 contratos de energía como cobertura en su negocio eléctrico. La transacción es ejecutada por el operador en el mercado con MIC XMPW. La firma está negociando por cuenta propia.

¿Cómo reportará esta entidad?

El registro TP es enviado directamente por BME al STR. No lo remite el miembro

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	B
4	CT	ClientID	0
5	DW	DcsnwFirm	120
6	EW	ExctwFirm	333
7		PType	LEI
8	7,16	LEICnpty	5299009QA8BBE2OOB349
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	20170821XMPWFI1234678901B
11	3	TradPlcMtchgId	FI1234678901
12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800T2W59YXMVKRU25
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T09:55:33.101010Z
17	29	TradgCpcty	DEAL

18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	100
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	
22	33	TypePric	M
23	33	Pric	58.95
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XMPW
28	37	CtryOfBrnch	ES
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	ES0B00033315
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

En este caso, al ser una operación por cuenta propia (DEAL), será el propio mercado quien remita el registro CT al STR

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-CT
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMPW
5		Número de ejecución	FI1234678901
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	B
8		SubRegistro	CT

9		PType	LEI
10	7,16	LEI	9598001WTPGD8A01N979
11	7,16	Prsn_SchmeNm	
12	7,16	Prsn_Id	
13	9,18	Prsn_FrstNm	
14	10,19	Prsn_Nm	
15	11,2	Prsn_BirthDt	
16	8,17	CTCtryOfBrnch	

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-DW
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMPW
5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	9999-12-31
7		ID	120
8		SubRegistro	DW
9	57	Dcsn_typePrsn	P
10	57	Dcsn_Algo	
11	57	Dcsn_Othr_SchNm	NIDN
12	57	Dcsn_Othr_Id	ES0234560C
13	58	Dcsn_CtryOfBrnch	ES

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RI-EW
1		TypeReg	RI
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMPW

5		F_Inicial	2017-08-21
6		F_Final	9999-12-31
7		ID	333
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	P
10	59	Exct_Algo	
11	59	Exct_Othr_SchNm	NIDN
12	59	Exct_Othr_Id	ES0234560C
13	60	Exct_CtryOfBrnch	ES

Ejemplo 8. Operación de una gestora de fondos

Un operador de una gestora de fondos, la Gestora G con LEI 95980079EEM99NR57242, envía una orden de compra a una entidad financiera E con LEI 9598001WTPGD8A01N979 miembro del mercado de quien es cliente. La gestora G decide comprar 100 títulos para uno de sus fondos. La transacción es ejecutada por un operador de la entidad financiera E en el mercado con MIC XMAD. La firma está negociando por cuenta propia.

¿Cómo reportará esta entidad?

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO TP
1		TypeReg	TP
2		Action	A
3		BuyrSellr	B
4	CT	ClientID	0
5	DW	DcsnwFirm	0
6	EW	ExctwFirm	333
7		PType	LEI
8	7,16	LEICnpty	5299009QA8BBE2OOB349
9	7,16	MICCnpty	
10	2	TxId	20170821XMAD147258369B
11	3	TradPlcMtchgId	147258369

12	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
13	5	InvstmtPtyInd	1
14	6	SubmitgPty	959800UYJM40XUGVGG78
15	25	TrnsmssnInd	0
16	28	TradDt	2017-08-21T09:55:33.101010Z
17	29	TradgCpcty	AOTC
18	30	TypeQty	U
19	30	Unit	100
20	30	NnmMntry	
21	31	QtyCurrency	
22	33	TypePric	M
23	33	Pric	58.95
24	33	BsisPts	
25	34	Currency	EUR
26	35	NetAmt	
27	36	TradVn	XMAD
28	37	CtryOfBrnch	ES
29	38	UpFrntPmt	
30	39	UpFrntPmt_courency	
31	40	CmplxTradCmpntId	
32	41	InstrmId	ES0B00033315
33	61	WvrInd	
34	65	SctiesFincgTxInd	0

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-CT
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMAD

5		Número de ejecución	147258369
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	B
8		SubRegistro	CT
9		PType	LEI
10	7,16	LEI	95980079EEM99NR57242
11	7,16	Prsn_SchmeNm	
12	7,16	Prsn_Id	
13	9,18	Prsn_FrstNm	
14	10,19	Prsn_Nm	
15	11,2	Prsn_BirthDt	
16	8,17	CTCtryOfBrnch	

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-EW
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMAD
5		Número de ejecución	147258369
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	B
8		SubRegistro	EW
9	59	Exct_typePrsn	P
10	59	Exct_Algo	
11	59	Exct_Othr_SchNm	NIDN
12	59	Exct_Othr_Id	ES0234560C
13	60	Exct_CtryOfBrnch	ES

Nº	RTS 22	CAMPO	REGISTRO RO-DR
1		TypeReg	RO
2		Action	A
3	4	ExctgPty	9598001WTPGD8A01N979
4	36	TrdnVn	XMAD
5		Número de ejecución	147258369
6		Fecha de ejecución	2017-08-21
7		BuyrSellr	B
8		SubRegistro	EW
9	40	CmplxTradCmpntId	
10	62	ShrtSellgInd	
11	64	RskRdcgTx	
12	8,17	CtryOfBrnch	ES
13	63	OTCPstTradInd	
14		Exento	0

7.1 Ficheros de texto plano de ejmplo

Los siguientes ficheros de texto plano contiene la información a remitir por los miembros para cumplimentar la información del Transaction Reporting según los ejemplos descritos en el apartado 7. Ejemplos".

INB_549300470IY7S220K805_549300470IY7S220K805_TR_20170821_001.DAT_MD5

Fichero de modificación a un registro EW

INB_549300470IY7S220K805_549300470IY7S220K805_TR_20170821_002.DAT_MD5

Anexo 1: Formato de campos

Formato registro TP

Nº	RTS 22	CAMPO	TIPO	LONG	DEC.	DATO
1		TypeReg	Char	2		TP.
2		Action	Char	1		A-Alta/Modificación. B-Baja.
3		BuyrSellr	Char	1		B-Comprador. S-Vendedor.
4	CT	ClientID	Int32			Código corto cliente.
5	DW	DcsnwFirm	Int32			Código corto decisor dentro de la entidad.
6	EW	ExctwFirm	Int32			Código corto ejecutor dentro de la entidad.
7		PType	Char	4		LEI, MIC, INTC . Tipo de identificación de la contrapartida. Se informará INTC para las operaciones agregadas del miembro de mercado con su cliente.
8	7, 16	LEICnpty	Char	20		LEI contrapartida de la operación. Por ejemplo: LEI de la CCP.
9	7, 16	MICCnpty	Char	4		Código MIC en caso de operaciones sin cámara.
10	2	TxId	Char	52		ID del Transaction Reporting.
11	3	TradPlcMtchgId	Char	52		ID de la ejecución de mercado. En caso de ser una operación XOFF se compone el ID de la transacción para poder consolidar, pero no se envía a ESMA.

Sensitivity: C2 Internal

12	4	ExctgPty	Char	20		Código LEI de la entidad que ejecuta la transacción.
13	5	InvstmtPtyInd	Char	1		0-False / 1-True.
14	6	SubmitgPty	Char	20		Código LEI del mercado que remite el TR. Será el LEI correspondiente al MIC donde se ejecuta la operación.
15	25	TrnsmssnInd	Char	1		0 – falso. Indicador de transmisión de la orden.
16	28	TradDt	Datetime	27		YYYY-MM-DDThh:mm:ss.ffffffZ. Fecha y hora de la ejecución en formato UTC.
17	29	TradgCpcty	Char	4		MTCH, DEAL, AOTC. Indicador de capacidad.
18	30	TypeQty	Char	1		U-Unit. N-Nominal value.
19	30	Unit	Decimal	18	17	TypeQty = 'U'.
20	30	NnmMntry	Decimal	18	5	TypeQty = 'N'. Valor nominal.
21	31	QtyCurrency	Char	3		Divisa del valor nominal.
22	33	TypePric	Char	1		typePric = ('M','B').
23	33	Pric	Decimal	18	13	Precio si typePric = 'M'.
24	33	BsisPts	Decimal	18	17	Precio en puntos básicos, si typePric = 'B'.
25	34	Currency	Char	3		Divisa del precio de la transacción. Solo si el precio es expresado en unidades monetarias.
26	35	NetAmt	Decimal	18	5	Importe neto de la transacción.
27	36	TradVn	Char	4		Código MIC del mercado donde se ha ejecutado la transacción.

Sensitivity: C2 Internal

28	37	CtryOfBrnch	Char	2		País de la sucursal del miembro.
29	38	UpFrntPmt	Decimal	18	5	Importe del pago up-front.
30	39	UpFrntPmt_courency	Char	3		Divisa del pago up-front.
31	40	CmplxTradCmpntId	Char	35		Código que relaciona distintas ejecuciones como parte de un package.
32	41	InstrmId	Char	12		Código ISIN del instrumento financiero.
33	61	WvrInd	Char	4		Indicador de tipo de waiver .OILQ, NLIQ, PRIC, ILQD,RFPT,SIZE.
34	65	SctiesFincgTxInd	Char	1		0-False / 1-True.

Sensitivity: C2 Internal

Prefijos

Formato registro RO. Registro por operación

Nº	RTS 22	CAMPO	TIPO	LONG	DATO
1		TypeReg	Char	2	RO.
2		Action	Char	1	A-Alta/Modificación . B-Baja.
3	4	ExctgPty	Char	20	Código LEI de la entidad que ejecuta la operación.
4	36	TrdnVn	Char	4	Código MIC del Mercado para el que se crea el registro.
5		Número de ejecución	Char	52	Número de la operación para la que se facilitan datos.
6		Fecha de ejecución	Date	10	Fecha de la ejecución con el formato: YYYY-MM-DD .
7		BuyrSellr	Char	1	B-Comprador. S-Vendedor.
8		SubRegistro	Char	2	Indica el tipo de registro al que esta cabecera antecede CT, DT, TS, DW, EW o DR.

Sensitivity: C2 Internal

Formato registro RI. Registro por identificador

Nº	RTS 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	36	TrdnVn	Char	4	Código MIC del Mercado para el que se crea el registro.
5		F_Inicial	Date	10	Fecha inicial de validez del registro en formato: YYYY-MM-DD .
6		F_Final	Date	10	Fecha final de validez del registro. Fecha en formato YYYY-MM-DD.
7		Id	Int32		ClientID cuando el subregistro es DR, CL, DT o TS (RF y DER). 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, DT, TS, DR, DW o EW.

Sensitivity: C2 Internal

Subregistros

Los Subregistros siempre se usan en combinación con un registro del tipo RI o RO

Formato SubRegistro CT de clientes

Nº	RTS 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.
6	9,18	Prsn_FrstNm	Char	140	Si PType=P. Nombre del cliente.
7	10,19	Prsn_Nm	Char	140	Si PType=P. Apellidos del cliente
8	11,20	Prsn_BirthDt	Date	10	Si PType=P. Fecha de nacimiento del cliente. YYYY-MM-DD.
9	8,17	CTCtryOfBrnch	Char	2	Código país del Cliente.

Sensitivity: C2 Internal

Formato Subregistro DT de Decisores de un cliente

Nº	RTS 22	CAMPO	TIPO	LONG	DATO
1		SubRegistro	Char	2	DT.
2		Dcsn_typePrsn	Char	4	Indica si el decisor es persona física o jurídica. P, LEI.
3	12,21	LEI	Char	20	Si PType=LEI. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación. LEI del decisor .
4	12,21	Prsn_SchmeNm	Char	6	NIDN, CCPT, CONCAT.
5	12,21	Prsn_Id	Char	35	Si PType=P. Solo se rellena si el decisor actúa bajo poder de representación. National ID del decisor.
6	13,22	Prsn_FrstNm	Char	140	Nombre.
7	14,23	Prsn_Nm	Char	140	Apellidos.
8	15,24	Prsn_BirthDt	Date	10	Fecha de nacimiento del decisor. YYYY-MM-DD.

Sensitivity: C2 Internal

Formato SubRegistro DW de decisores *Within 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.
6	58	Dcsn_CtryOfBrnch	Char	2	Si Dcsn_typePrsn='P'. País donde se encuentra el responsable de la decisión de la operación dentro de la entidad. Si la decisión la toma un algoritmo se deja vacío.

Sensitivity: C2 Internal

Formato SubRegistro EW de ejecutores *Within Firm*

Nº	RTS 22	CAMPO	TIPO	LONG	DATO
1		SubRegistro	Char	2	EW.
2	59	Exct_typePrsn	Char	1	P-Person. A-Algoritm. 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.
7	60	Exct_CtryOfBrnch	Char	2	Si Dcsn_typePrsn='P'. País de la sucursal que supervisa a la persona responsable de la ejecución. Solo se cumplimenta si no es un algoritmo.

Sensitivity: C2 Internal

Formato subregistro DR de otros datos

Nº	RTS 22	CAMPO	TIPO	LONG	DATO
1		TypeReg	Char	2	DR.
2	40	CmplxTradCmpntId	Char	35	Código de identificación único para las ejecuciones que componen una cesta o una estrategia de contratos.
3	62	ShrtSellgInd	Char	4	Indicador de venta en corto. Se cumplimenta en las operaciones de venta, tanto para cuenta propia como para clientes. Si es una orden agregada se deja en blanco. SESH, SELL, SSEX, UNDI
4	64	RskRdcgTx	Char	1	0-False / 1-True.
5	8,17	CtryOfBrnch	Char	2	Este campo debe indicar el país de la sucursal que haya recibido la orden del cliente.
6	63	OTCPstTradInd	Char	4	Indicador de post-trade OTC. Solo aplicable a la pata de la transacción del Miembro con su cliente, es decir, al XOFF (del miembro a sus clientes). ENC,ACTX,LRGS,ILQD,SIZE,CANC,AMND,SDIV,RPRI,DUPL,TNCP.
7	29	TradgCpcty	Char	4	MTCH, DEAL, AOTC. Indicador de capacidad.
8		Exento	Char	1	0-False / 1-True.

Sensitivity: C2 Internal

Formato SubRegistro TS de transmisión

Nº	RTS 22	CAMPO	TIPO	LONG	DATO
1		TypeReg	Char	2	TS.
2	25	TrnsmssnInd	Char	1	0-False / 1-True. Indica si hay transmisión de la orden de una entidad a otra.
3	26,27	Trnsmttg	Char	20	Código LEI de otra entidad que transmite la orden al Miembro de Mercado, cuando se cumplen las condiciones de transmisión.

Sensitivity: C2 Internal

Anexo 2: Verificaciones de ESMA

RULE ID	FIELD NO	FIELD	CONTENT TO BE REPORTED	FORMAT AND STANDARDS TO BE USED FOR REPORTING	VALIDATION RULE	ERROR CODE	ERROR TEXT
001	1	Report status.	Indication as to whether the transaction report is new or a cancellation.	'NEWT' - New 'CANC' - Cancellation	It should be specified whether the report is a new report or a cancellation, this is implemented as part of the structure of the XML message and is mandatory for all transaction reports.	N/A	Generated by the XML parser
268	1	Report status.			Fields 2, 4, 6 should be populated for cancellation reports and other should be left not populated	N/A	Generated by the XML parser
002	2	Transaction Reference Number.	Identification number that is unique to the executing firm for each transaction report . Where, pursuant to Article 26(5) of Regulation (EU) 600/2014, a trading venue submits a transaction report on behalf of a firm that is not subject to Regulation (EU) 600/2014, the trading venue shall populate this field with a number that has been internally generated by the trading venue and that is unique for each transaction report submitted by the trading venue.	{ALPHANUM-52}	Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A	Generated by the XML parser
003	2	Transaction Reference Number.			Field is mandatory for all cancellation reports	N/A	Generated by the XML parser
004	2	Transaction Reference Number.			Field should be a text string of no more than 52 characters consisting of capital Latin letters (A-Z) and numbers.	N/A	Generated by the XML parser

Sensitivity: C2 Internal

005	2	Transaction Reference Number.			If the report is a new transaction, the transaction reference number shall pertain to a single transaction per the executing entity, i.e. the same transaction reference number has not been used before or pertains to a transaction that has been cancelled (the last accepted report with this transaction reference number was a cancellation report).	CON-023	Transaction report with the same transaction reference number has already been sent for the firm and not cancelled.
006	2	Transaction Reference Number.			If the report is a cancellation report, a transaction with the same transaction reference number should have been reported by the executing entity before.	CON-024	Transaction for cancellation cannot be found.
007	2	Transaction Reference Number.			If the report is a cancellation report, this transaction should be an active transaction (there was no cancellation report following the last accepted new transaction report for this transaction reference number).	CON-025	Transaction has already been cancelled.
008	3	Trading venue transaction identification code.	This is a number generated by trading venues and disseminated to both the buying and the selling parties in accordance with Article 12 of [RTS 24 on the maintenance of relevant data relating to orders in financial instruments under Article 25 of Regulation 600/2014 EU]. This field is only required for the market side of a transaction executed on a trading venue.	{ALPHANUM-52}	Field should be a text string of no more than 52 characters consisting of capital Latin letters (A-Z) and numbers.	N/A	Generated by the XML parser.
010	3	Trading venue transaction identification code.			This field must not be populated where field 36 is populated with a non-EEA Trading Venue or 'XXXX' or 'XOFF'	CON-030	Trading venue transaction identification code is inconsistent with the trading venue.
011	4	Executing entity identification code.	Code used to identify the entity executing the transaction.	{LEI}	Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A	Generated by the XML parser.
012	4	Executing entity identification code.			Field is mandatory for all cancellation reports	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

013	4	Executing entity identification code.			The value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers.	N/A	Generated by the XML parser.
014	4	Executing entity identification code.			Where field 5 is populated with 'true', 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", "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.	CON-040	The executing entity LEI is not valid.
266	4	Executing entity identification code.			Where field 5 is populated with 'false', 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", "Pending transfer" "Pending archival" or "Lapsed". 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.	CON-041	The executing entity LEI is not valid.
017	5	Investment Firm covered by Directive 2014/65/EU.	Indicates whether the entity identified in field 4 is an investment firm covered by Article 4.1(1) of Directive 2014/65/EU.	'true'- yes 'false'- no	Only 'true' or 'false' values allowed.	N/A	Generated by the XML parser.
018	5	Investment Firm covered by Directive 2014/65/EU.			Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A	Generated by the XML parser.
019	6	Submitting entity identification code.	Code used to identify the entity submitting the transaction report to the competent authority in accordance with Article 26(7) of Regulation (EU) 600/2014.	{LEI}	Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

			Where the report is submitted by the executing firm directly to the competent authority, it shall be populated with the LEI of the executing firm (where the executing firm is a legal entity). Where the report is submitted by a trading venue, it shall be populated with the LEI of the operator of the trading venue. Where the report is submitted by an ARM, it shall be populated with the LEI of the ARM.		
210	6	Submitting entity identification code.		Field is mandatory for all cancellation reports.	N/A
.020	6	Submitting entity identification code.		The value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers.	N/A
021	6	Submitting entity identification code.		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.	CON

Sensitivity: C2 Internal

Buyer details For joint accounts fields 7-11 shall be repeated for each buyer. Where the transaction is for a transmitted order that has met the conditions for transmission set out in Article 4, the information in fields 7-15 shall be populated by the receiving firm in the receiving firm's report with the information received from the transmitting firm. Where the transmission is for a transmitted order that has not met the conditions for transmission set out in Article 4 the receiving firm shall treat the transmitting firm as the buyer.							
025	7	Buyer identification code.	Code used to identify the acquirer of the financial instrument. Where the acquirer is a legal entity, the LEI code of the acquirer shall be used. Where the acquirer is a non-legal entity, the identifier specified in Article 6 shall be used. Where the transaction was executed on a trading venue or on an organised trading platform outside of the Union that utilises a central counterparty (CCP) and where the identity of the acquirer is not disclosed, the LEI code of the CCP shall be used. Where the transaction was executed on a trading venue or on an organised trading platform outside of the Union that does not utilise a CCP and where the identity of the acquirer is not disclosed, the MIC code of the trading venue or of the organised trading platform outside of the Union shall be used. Where the acquirer is an investment firm acting as a systematic internaliser (SI), the LEI code of the SI shall be used. 'INTC' shall be used to designate an aggregate client account within the investment firm in order to report a transfer into or out of that account with an associated allocation to the individual client(s) out of or into that account respectively. In case of options and swaptions, the buyer shall be the counterparty that holds the right to exercise the option and the seller shall be the counterparty that sells the option and receives a premium.	{LEI} {MIC} {NATIONAL_ID} 'INTC'	Field is mandatory for all new transaction reports. More than one value can be reported by copying this field as many times as necessary.	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

	In case of futures and forwards other than futures and forwards relating to currencies, the buyer shall be the counterparty buying the instrument and the seller the counterparty selling the instrument. In the case of swaps relating to securities, the buyer shall be the counterparty that gets the risk of price movement of the underlying security and receives the security amount. The seller shall be the counterparty paying the security amount. In the case of swaps related to interest rates or inflation indices, the buyer shall be the counterparty paying the fixed rate. The seller shall be the counterparty receiving the fixed rate. In case of basis swaps (float-to-float interest rate swaps), the buyer shall be the counterparty that pays the spread and the seller the counterparty that receives the spread. In the case of swaps and forwards related to currencies and of cross currency swaps, the buyer shall be the counterparty receiving the currency which is first when sorted alphabetically by ISO 4217 standard and the seller shall be the counterparty delivering this currency. In the case of swap related to dividends, the buyer shall be the counterparty receiving the equivalent actual dividend payments. The seller is the counterparty paying the dividend and receiving the fixed rate. In the case of derivative instruments for the transfer of credit risk except options and swaptions, the buyer shall be the counterparty buying the protection. The seller is the counterparty selling the protection. In case of derivative contract related to commodities, the buyer shall be the counterparty that receives the commodity specified in the report and the seller the	

			counterparty delivering this commodity. In case of forward rate agreements, the buyer shall be the counterparty paying the fixed rate and the seller the counterparty receiving the fixed rate. For an increase in notional, the buyer shall be the same as the acquirer of the financial instrument in the original transaction and the seller shall be the same as the disposer of the financial instrument in the original transaction. For a decrease in notional the buyer shall be the same as the disposer of the financial instrument in the original transaction and the seller shall be the same as the acquirer of the financial instrument in the original transaction.			
026	7	Buyer identification code.		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.	N/A	Generated by the XML parser.
027	7	Buyer identification code.		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.	CON-070	Buyer LEI XXX is not valid.

028	7	Buyer identification code.	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).	N/A	Generated by the XML parser.
029	7	Buyer identification code.	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.	CON-071	Buyer national identification code XXX does not include valid country code.
030	7	Buyer identification code.	If MIC code is used, it should be a valid ISO 10383 MIC code indicating a trading venue that was active at the trading date, excluding special MIC codes 'XXXX' and 'XOFF'.	CON-072	Buyer MIC XXX is not valid for the trade date.
211	7	Buyer identification code.	In case the CONCAT code is used, the following characters are only allowed: Capital Latin letters, Numbers, #. It should be a string of exactly 20 characters where first two characters are letters, the next 8 characters are numbers and the remaining characters are letters or #, where 11th and 16th character are letters. In case national identification number or passport number is used, the following characters are only allowed: Capital Latin letters, Numbers. It can be a string of 3 to 35 characters, where first two characters are letters.	CON-074	The format of the buyer identification code is incorrect.
240	7	Buyer identification code.	If the CONCAT code is used, the birthdate in the CONCAT code should be the same as the birthdate populated in field 11.	CON-073	The CONCAT code is incorrect.

Additional details. Field 8-15 are only applicable if the buyer is a client. Fields 9-11 are only applicable if the buyer is a natural person.							
032	8	Country of the branch for the buyer	Where the acquirer is a client, this field should identify the country of the branch that received the order from the client or made an investment decision for a client in accordance with a discretionary mandate given to it by the client as required by Article 14.3. Where this activity was not conducted by a branch this should be populated with the country code of the home Member State of the investment firm or the country code of the country where the investment firm has established its head office or registered office (in the case of third country firms). Where the transaction is for a transmitted order that has met the conditions for transmission set out in Article 4, this field shall be populated using the information received from the transmitting firm.	{COUNTRYCODE_2}	If populated, it should be a text string consisting of 2 capital letters	N/A	Generated by the XML parser.
033	8	Country of the branch for the buyer.			If populated, it should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date.	CON-080	Country code XXX is not valid for the trade date.
035	9	Buyer - first name(s).	Full first name(s) of the buyer. In case of more than one first name, all names shall be included in this field separated by a comma.	{ALPHANUM-140}	Field should be a text string of no more than 140 characters. The following characters are only allowed: capital letters from EEA European alphabets, i.e. Latin alphabet (A-Z), Cyrillic alphabet (A-Я), Greek alphabet (A-Ω), diacritical characters (ÄÀÁÂÃÅĂĄĂÆÇĆĈČĎĐÐÈÉÊËĚĘĜĢĞĤÌÍÎÏĴĶĹĻŁĽÑŃŇ ÖÒÓÔÕŐØŒŔŘßŚŜŞŠŞŤŢÞŢÜÙÚÛŰŨŲŮŴÝŸŶŹŽŻ) and the following non-alphanumerical characters: comma ",", space " ", apostrophe "'", minus "-", dash "–".	N/A	Generated by the XML parser.
036	9	Buyer - first name(s).			Field is mandatory where national ID was populated in field 7 (is repeated for each national ID). Otherwise is not populated.	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

037	10	Buyer - surname(s).	Full surname(s) of the buyer. In case of more than one surname, all surnames shall be included in this field separated by a comma.	{ALPHANUM-140}	Field should be a text string of no more than 140 characters. The following characters are only allowed: capital letters from EEA European alphabets, i.e. Latin alphabet (A-Z), Cyrillic alphabet (A-Я), Greek alphabet (A-Ω), diacritical characters (ÄÀÁÂÃÅĂĄĂÆÇĆĈČĎĐÐÈÉÊËĚĘĜĢĞĤÌÍÎÏĴĶĹĻŁĽÑŃŇ ÖÒÓÔÕŐØŒŔŘßŚŜŞŠŞŤŢÞŢÜÙÚÛŰŨŲŮŴÝŸŶŹŽŻ) and the following non-alphanumerical characters: comma ",", space " ", apostrophe "'", minus "-", dash "–".	N/A	Generated by the XML parser.
038	10	Buyer - surname(s).			Field is mandatory where national ID was populated in field 7 (is repeated for each national ID). Otherwise is not populated.	N/A	Generated by the XML parser.
039	11	Buyer - date of birth	Date of birth of the buyer.	{DATEFORMAT}	Field must be populated with a valid date in the following format: YYYY-MM-DD	N/A	Generated by the XML parser.
040	11	Buyer - date of birth.			Field is mandatory where national ID was populated in field 7 (is repeated for each national ID). Otherwise is not populated.	N/A	Generated by the XML parser.
Buyer decision maker Fields 12-15 are only applicable if the decision maker acts under a power of representation							
042	12	Buyer decision maker code.	Code used to identify the person who makes the decision to acquire the financial instrument. Where the decision is made by an investment firm, this field shall be populated with the identity of the investment firm rather than the individual making the investment decision. Where the decision maker is a legal entity, the LEI code of the decision maker shall be used. Where the decision maker is a non-legal entity, the identifier specified in Article 6 shall be used.	{LEI} {NATIONAL_ID}	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.	N/A	Generated by the XML parser.
043	12	Buyer decision maker code.			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",	CON-120	Buyer decision maker LEI XXX is not valid.

			"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.		
044	12	Buyer decision maker code.	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).	N/A	Generated by the XML parser
045	12	Buyer decision maker code.	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	CON-121	Buyer decision maker identification code XXX does n include valid country code.
212	12	Buyer decision maker code.	In case the CONCAT code is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters, Numbers, #. It should be a string of exactly 20 characters where first two characters are letters, the next 8 characters are numbers and the remaining characters are letters or #, where 11th and 16th character are letters In case national identification number or passport number is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters, Numbers. It can be a string of 3 to 35 characters, where first two characters are letters.	CON-123	The format of the buyer decis maker code is incorrect.
241	12	Buyer decision maker code.	If the CONCAT code is used, the birthdate in the CONCAT code should be the same as the birthdate populated in field 15.	CON-122	The CONCAT code is incorrect

Sensitivity: C2 Internal

Buyer decision maker details Fields 13-15 are only applicable if the decision maker is a natural person							
047	13	Buy decision maker - First Name(s).	Full first name(s) of the decision maker for the buyer. In case of more than one first name, all names shall be included in this field separated by a comma.	{ALPHANUM-140}	Field should be a text string of no more than 140 characters. The following characters are only allowed: capital letters from EEA European alphabets, i.e. Latin alphabet (A-Z), Cyrillic alphabet (A-Я), Greek alphabet (A-Ω), diacritical characters (ÄÀÁÂÃÅĂĄĂÆÇĆĈČĎĐÐÈÉÊËĚĘĜĢĞĤÌÍÎÏĴĶĹĻŁĽÑŃŇ ÖÒÓÔÕŐØŒŔŘßŚŜŞŠŞŤŢÞŢÜÙÚÛŰŨŲŮŴÝŸŶŹŽŻ) and the following non-alphanumerical characters: comma ",", space " ", apostrophe "'", minus "-", dash "–".	N/A	Generated by the XML parser.
048	13	Buy decision maker - First Name(s).			Field is mandatory where national ID was populated in field 12. Otherwise is not populated.	N/A	Generated by the XML parser.
049	14	Buy decision maker – Surname(s)	Full surname(s) of the decision maker for the buyer. In case of more than one surname, all surnames shall be included in this field separated by a comma.	{ALPHANUM-140}	Field should be a text string of no more than 140 characters. The following characters are only allowed: capital letters from EEA European alphabets, i.e. Latin alphabet (A-Z), Cyrillic alphabet (A-Я), Greek alphabet (A-Ω), diacritical characters (ÄÀÁÂÃÅĂĄĂÆÇĆĈČĎĐÐÈÉÊËĚĘĜĢĞĤÌÍÎÏĴĶĹĻŁĽÑŃŇ ÖÒÓÔÕŐØŒŔŘßŚŜŞŠŞŤŢÞŢÜÙÚÛŰŨŲŮŴÝŸŶŹŽŻ) and the following non-alphanumerical characters: comma ",", space " ", apostrophe "'", minus "-", dash "–".	N/A	Generated by the XML parser.
050	14	Buy decision maker – Surname(s).			Field is mandatory where national ID was populated in field 12. Otherwise is not populated.	N/A	Generated by the XML parser.
051	15	Buy decision maker - Date of birth.	Date of birth of the decision maker for the buyer.	{DATEFORMAT}	Field must be populated with a valid date in the following format: YYYY-MM-DD.	N/A	Generated by the XML parser.
052	15	Buy decision maker - Date of birth.			Field is mandatory where national ID was populated in field 12. Otherwise is not populated.	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

Seller details and decision maker
For joint accounts fields 16-20 shall be repeated for each seller.
Where the transaction for a seller is for a transmitted order that has met the conditions for transmission set out in Article 4, the information in fields 16-24 shall be populated by the receiving firm in the receiving firm's report from the information received from the transmitting firm.
Where the transmission is for a transmitted order that has not met the conditions for transmission set out in Article 5, the receiving firm shall treat the transmitting firm as the seller.

054	16	Seller identification code.	Code used to identify the disposer of the financial instrument. Where the disposer is a legal entity, the LEI code of the disposer shall be used. Where the disposer is a non-legal entity, the identifier specified in Article 7 shall be used. Where the transaction was executed on a trading venue or on an organised trading platform outside of the Union that utilises a CCP and where the identity of the disposer is not disclosed, the LEI code of the CCP shall be used. Where the transaction was executed on a trading venue or on an organised trading platform outside of the Union that does not utilise a CCP and where the identity of the disposer is not disclosed, the MIC code of the trading venue or of the organised trading platform outside of the Union shall be used. Where the disposer is an investment firm acting as a SI, the LEI code of the SI shall be used 'INTC' shall be used to designate an aggregate client account within the investment firm in order to report a transfer into or out of that account with an associated allocation to the individual client(s) out of or into that account respectively. In case of options and swaptions, the buyer shall be the counterparty that holds the right to exercise the option and the seller shall be the counterparty that sells the option and	{LEI} {MIC} {NATIONAL_ID} 'INTC'	Field is mandatory for all new transaction reports. More than one value can be reported by copying this field as many times as necessary.	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

receives a premium.
In case of futures and forwards other than futures and forwards relating to currencies, the buyer shall be the counterparty buying the instrument and the seller the counterparty selling the instrument.
In the case of swaps relating to securities, the buyer shall be the counterparty that gets the risk of price movement of the underlying security and receives the security amount. The seller shall be the counterparty paying the security amount.
In the case of swaps related to interest rates or inflation indices, the buyer shall be the counterparty paying the fixed rate. The seller shall be the counterparty receiving the fixed rate. In case of basis swaps (float-to-float interest rate swaps), the buyer shall be the counterparty that pays the spread and the seller the counterparty that receives the spread.
In the case of swaps and forwards related to currencies and of cross currency swaps, the buyer shall be the counterparty receiving the currency which is first when sorted alphabetically by ISO 4217 standard and the seller shall be the counterparty delivering this currency.
In the case of swap related to dividends, the buyer shall be the counterparty receiving the equivalent actual dividend payments. The seller is the counterparty paying the dividend and receiving the fixed rate.
In the case of derivative instruments for the transfer of credit risk except options and swaptions, the buyer shall be the counterparty buying the protection. The seller is the counterparty selling the protection.
In case of derivative contracts related to commodities, the buyer shall be the counterparty that receives the commodity

Sensitivity: C2 Internal

			specified in the report and the seller the counterparty delivering this commodity. In case of forward rate agreements, the buyer shall be the counterparty paying the fixed rate and the seller the counterparty receiving the fixed rate. For an increase in notional, the seller shall be the same as the disposer in the original transaction. For a decrease in notional the seller shall be the same as the acquirer of the financial instrument in the original transaction.		
055	16	Seller identification code.	Code used to identify the disposer of the financial instrument. Where the disposer is a legal entity, the LEI code of the disposer shall be used. Where the disposer is a non-legal entity, the identifier specified in Article 7 shall be used. Where the transaction was executed on a trading venue or on an organised trading platform outside of the Union that utilises a CCP and where the identity of the disposer is not disclosed, the LEI code of the CCP shall be used. Where the transaction was executed on a trading venue or on an organised trading platform outside of the Union that does not utilise a CCP and where the identity of the disposer is not disclosed, the MIC code of the trading venue or of the organised trading platform outside of the Union shall be used. Where the disposer is an investment firm acting as a SI, the LEI code of the SI shall be used 'INTC' shall be used to designate an aggregate client account within the investment firm in order to report a transfer into or out of that account with an associated	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

allocation to the individual client(s) out of or into that account respectively.

In case of options and swaptions, the buyer shall be the counterparty that holds the right to exercise the option and the seller shall be the counterparty that sells the option and receives a premium.
In case of futures and forwards other than futures and forwards relating to currencies, the buyer shall be the counterparty buying the instrument and the seller the counterparty selling the instrument.
In the case of swaps relating to securities, the buyer shall be the counterparty that gets the risk of price movement of the underlying security and receives the security amount. The seller shall be the counterparty paying the security amount.
In the case of swaps related to interest rates or inflation indices, the buyer shall be the counterparty paying the fixed rate. The seller shall be the counterparty receiving the fixed rate. In case of basis swaps (float-to-float interest rate swaps), the buyer shall be the counterparty that pays the spread and the seller the counterparty that receives the spread.
In the case of swaps and forwards related to currencies and of cross currency swaps, the buyer shall be the counterparty receiving the currency which is first when sorted alphabetically by ISO 4217 standard and the seller shall be the counterparty delivering this currency.
In the case of swap related to dividends, the buyer shall be the counterparty receiving the equivalent actual dividend payments. The seller is the counterparty paying the dividend and receiving the fixed rate.
In the case of derivative instruments for the

Sensitivity: C2 Internal

			transfer of credit risk except options and swaptions, the buyer shall be the counterparty buying the protection. The seller is the counterparty selling the protection. In case of derivative contracts related to commodities, the buyer shall be the counterparty that receives the commodity specified in the report and the seller the counterparty delivering this commodity. In case of forward rate agreements the buyer shall be the counterparty paying the fixed rate and the seller the counterparty receiving the fixed rate. For an increase in notional, the seller shall be the same as the disposer in the original transaction. For a decrease in notional the seller shall be the same as the acquirer of the financial instrument in the original transaction.			
056	16	Seller identification code.		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.	CON-160	Seller LEI XXX is not valid.
057	16	Seller identification code.		(use of code NIDN in the SchmeNm/Cd tag) or CONCAT (use of proprietary with value CONCAT in the SchmeNm/Prtry tag).	N/A	Generated by the XML parser.

058	16	Seller identification code.			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.	CON-161	Seller national identification code XXX does not include valid country code.
059	16	Seller identification code.			If MIC code is used, it should be a valid ISO 10383 MIC code indicating a trading venue that was active at the trading date, excluding special MIC codes 'XXXX' and 'XOFF'.	CON-162	Seller MIC XXX is not valid for the trade date.
213	16	Seller identification code.			In case the CONCAT code is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters, numbers, #. It should be a string of exactly 20 characters where first two characters are letters, the next 8 characters are numbers and the remaining characters are letters or #, where 11th and 16th character are letters. In case national identification number or passport number is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters, numbers. It can be a string of 3 to 35 characters, where first two characters are letters.	CON-164	The format of the seller code is incorrect.
242	16	Seller identification code.			If the CONCAT code is used, the birthdate in the CONCAT code should be the same as the birthdate populated in field 20.	CON-163	The CONCAT code is incorrect.
Additional details - Field 17-21 are only applicable if the seller is a client - Fields 18-20 are only applicable if the seller is a natural person							
061	17	Country of the branch for the seller	Where the seller is a client, this field should identify the country of the branch that received the order from the client or made an investment decision for a client in accordance with a discretionary mandate given to it by the client as required by Article 14.3. Where this activity was not conducted by a branch this should be populated with the country code of the home Member State of the investment firm or the country code of the country where the investment firm has established its head office or registered office (in the case of third country firms).	{COUNTRYCODE_2}	If populated, it should be a text string consisting of 2 capital letters	N/A	Generated by the XML parser.

			Where the transaction is for a transmitted order that has met the conditions for transmission set out in Article 4, this field shall be populated using the information received from the transmitting firm.				
062	17	Country of the branch for the seller.			If populated, it should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date.		CON
064	18	Seller - first name(s) .	Full first name(s) of the seller. In case of more than one first name, all names shall be included in this field separated by a comma.	{ALPHANUM-140}	Field should be a text string of no more than 140 characters. The following characters are only allowed: capital letters from EEA European alphabets, i.e. Latin alphabet (A-Z), Cyrillic alphabet (A-Я), Greek alphabet (A-Ω), diacritical characters (ÄÀÁÂÃÅĂĄĂÆÇĆĈČĎĐÐÈÉÊËĔĘĜĢĞĤÌÍÎÏĴĶĹĻŁĽÑŃŇ ÖÒÓÔÕŐØŒŔŘßŚŜŞŠŞŤŢÞŢÜÙÚÛŰŨŲŮŴÝŸŶŹŽŻ) and the following non-alphanumerical characters: comma ",", space " ", apostrophe "'", minus "-", dash "–".		N/A
065	18	Seller - first name(s) .			Field is mandatory where national ID was populated in field 16 (is repeated for each national ID). Otherwise is not populated.		N/A
066	19	Seller - surname(s).	Full surname(s) of the seller In case of more than one surname, all surnames shall be included in this field separated by a comma.	{ALPHANUM-140}	Field should be a text string of no more than 140 characters. The following characters are only allowed: capital letters from EEA European alphabets, i.e. Latin alphabet (A-Z), Cyrillic alphabet (A-Я), Greek alphabet (A-Ω), diacritical characters (ÄÀÁÂÃÅĂĄĂÆÇĆĈČĎĐÐÈÉÊËĔĘĜĢĞĤÌÍÎÏĴĶĹĻŁĽÑŃŇ ÖÒÓÔÕŐØŒŔŘßŚŜŞŠŞŤŢÞŢÜÙÚÛŰŨŲŮŴÝŸŶŹŽŻ) and the following non-alphanumerical characters: comma ",", space " ", apostrophe "'", minus "-", dash "–".		N/A
067	19	Seller - surname(s).			Field is mandatory where national ID was populated in field 16 (is repeated for each national ID). Otherwise is not populated.		N/A
068	20	Seller - date of birth.	Date of birth of the seller	{DATEFORMAT}	Field must be populated with a valid date in the following format: YYYY-MM-DD.		N/A
069	20	Seller - date of birth.			Field is mandatory where national ID was populated in field 16 (is repeated for each national ID). Otherwise is not populated.		N/A

Sensitivity: C2 Internal

Seller decision maker details - Fields 21-24 are only applicable if the decision maker acts under a power of representation.							
071	21	Seller decision maker code.	Code used to identify the person who makes the decision to sell the financial instrument. Where the decision is made by an investment firm, this field shall be populated with the identity of the investment firm rather than the individual making the investment decision. Where the decision maker is a legal entity, the LEI code of the decision maker shall be used. Where the decision maker is a non-legal entity, the identifier specified in Article 6 shall be used.	{LEI} {NATIONAL_ID}	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.	N/A	Generated by the XML parser.
072	21	Seller decision maker code.			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.	CON-210	Seller decision maker LEI XXX is not valid.
073	21	Seller decision maker code.			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).	N/A	Generated by the XML parser.
074	21	Seller decision maker code.			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	CON-211	Seller decision maker identification code XXX does not include valid country code.
243	21	Seller decision maker code.			In case the CONCAT code is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters, numbers, #. It should be a string of exactly 20 characters where first two characters are letters, the next 8	CON-213	The format of the seller decision maker code is incorrect.

Sensitivity: C2 Internal

					characters are numbers and the remaining characters are letters or # where 11th and 16th character are letters. In case national identification number or passport number is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters, numbers. It can be a string of 3 to 35 characters, where first two characters are letters.		
244	21	Seller decision maker code.			If the CONCAT code is used, the birthdate in the CONCAT code should be the same as the birthdate populated in field 24.	CON-212	The CONCAT code is incorrect.
Seller decision maker details - Fields 22-24 are only applicable if the decision maker is a natural person							
076	22	Sell decision maker - First Name(s).	Full first name(s) of the decision maker for the seller. In case of more than one first name, all names shall be included in this field separated by a comma.	{ALPHANUM-140}	Field should be a text string of no more than 140 characters. The following characters are only allowed: capital letters from EEA European alphabets, i.e. Latin alphabet (A-Z), Cyrillic alphabet (A-Я), Greek alphabet (A-Ω), diacritical characters (ÄÀÁÂÃÅĂĄĂÆÇĆĈČĎĐÐÈÉÊËĚĘĜĢĞĤÌÍÎÏĴĶĹĻŁĽÑŃŇ ÖÒÓÔÕŐØŒŔŘßŚŜŞŠŞŤŢÞŢÜÙÚÛŰŨŲŮŴÝŸŶŹŽŻ) and the following non-alphanumerical characters: comma ",", space " ", apostrophe "'", minus "-", dash "–".	N/A	Generated by the XML parser.
077	22	Sell decision maker - First Name(s).			Field is mandatory where national ID was populated in field 21. Otherwise is not populated.	N/A	Generated by the XML parser.
078	23	Sell decision maker – Surname(s).	Full surname(s) of the decision maker for the seller. In case of more than one surname, all surnames shall be included in this field separated by a comma.	{ALPHANUM-140}	Field should be a text string of no more than 140 characters. The following characters are only allowed: capital letters from EEA European alphabets, i.e. Latin alphabet (A-Z), Cyrillic alphabet (A-Я), Greek alphabet (A-Ω), diacritical characters (ÄÀÁÂÃÅĂĄĂÆÇĆĈČĎĐÐÈÉÊËĚĘĜĢĞĤÌÍÎÏĴĶĹĻŁĽÑŃŇ ÖÒÓÔÕŐØŒŔŘßŚŜŞŠŞŤŢÞŢÜÙÚÛŰŨŲŮŴÝŸŶŹŽŻ) and the following non-alphanumerical characters: comma ",", space " ", apostrophe "'", minus "-", dash "–".	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

079	23	Sell decision maker – Surname(s).			Field is mandatory where national ID was populated in field 21. Otherwise is not populated.	N/A	Generated by the XML parser.
080	24	Sell decision maker - Date of birth.	Date of birth of the decision maker for the seller.	{DATEFORMAT}	Field must be populated with a valid date in the following format: YYYY-MM-DD.	N/A	Generated by the XML parser.
081	24	Sell decision maker - Date of birth.			Field is mandatory where national ID was populated in field 21. Otherwise is not populated.	N/A	Generated by the XML parser.
Transmission details - Fields 26 and 27 shall only be populated for transaction reports by a receiving firm where all the conditions for transmission in Article 4 have been met. - Where a firm acts both as a receiving firm and a transmitting firm it shall populate field 25 to indicate that it is a transmitting firm and shall populate fields 26 and 27 from its perspective as a receiving firm.							
083	25	Transmission of order indicator.	'true' shall be populated by the transmitting firm within the transmitting firm's report where the conditions for transmission specified in Article 4 were not satisfied 'false' – in all other circumstances.	'true' 'false'	Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A	Generated by the XML parser.
084	25	Transmission of order indicator.			Only 'true' or 'false' values allowed.	N/A	Generated by the XML parser.
215	25	Transmission of order indicator.			When the executing entity is dealing on its own account or matched principal basis (value 'DEAL' or 'MTCH' populated in field 29) this field must be populated with 'false'.	CON-251	Transmission of order indicator is incorrect.
085	26	Transmitting firm identification code for the buyer.	Code used to identify the firm transmitting the order This shall be populated by the receiving firm within the receiving firm's report with the identification code provided by the transmitting firm.	{LEI}	The value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers.	N/A	Generated by the XML parser.
086	26	Transmitting firm identification code for the buyer.			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.	CON-260	Firm transmitting identification code for the buyer LEI is not valid.

Sensitivity: C2 Internal

					3. The EntityStatus shall be Active or if the EntityStatus is Inactive, the LastUpdateDate shall be equal or after the trading date.		
089	27	Transmitting firm identification code for the seller.	Code used to identify the firm transmitting the order. This shall be populated by the receiving firm within the receiving firm's report with the identification code provided by the transmitting firm.	{LEI}	The value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers.	N/A	Generated by the XML parser.
090	27	Transmitting firm identification code for the seller.			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.	CON-270	Firm transmitting identification code for the seller LEI is not valid.
Transaction details							
094	28	Trading date time	Date and time when the transaction was executed. For transactions executed on a trading venue, the level of granularity shall be in accordance with the requirements set out in Article 3 [RTS 25 on clock synchronization under article 50 of Directive 2014/65/EU]. For transactions not executed on a trading venue, the date and time shall be when the parties agree the content of the following fields: quantity, price, currencies in fields 31, 34 and 44, instrument identification code, instrument classification and underlying instrument code, where applicable. For transactions not executed on a trading venue the time reported shall be at least to the nearest second. Where the transaction results from an order	{DATE_TIME_FORMAT}	Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

			transmitted by the executing firm on behalf of a client to a third party where the conditions for transmission set out in Article 4 were not satisfied, this shall be the date and time of the transaction rather than the time of the order transmission.			
095	28	Trading date time.			Field must be populated with a valid date and time in the following format: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.ssssssZ. The minimum precision is seconds.	N/A
096	28	Trading date time.			Trading date time must be the same or before the system date time.	CON
269	28	Trading date time.			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
097	29	Trading capacity.	Indication of whether the transaction results from the executing firm carrying out matched principal trading under Article 4(38) of Directive 2014/65/EU or dealing on own account under Article 4(6) of Directive 2014/65/EU. Where the transaction does not result from the executing firm carrying out matched principal trading or dealing on own account, the field shall indicate that the transaction was carried out under any other capacity.	'DEAL' - Dealing on own account. 'MTCH' - Matched principal. 'AOTC' - Any other capacity.	Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A
098	29	Trading capacity.			Only one of the following values can be populated: 'DEAL', 'MTCH', 'AOTC'.	N/A
216	29	Trading capacity.			When using 'DEAL' Buyer Identification or Seller Identification or both of them should be identical with the executing entity identification code.	CON
099	30	Quantity.	The number of units of the financial instrument, or the number of derivative contracts in the transaction. The nominal or monetary value of the financial instrument.	{DECIMAL-18/17} in case the quantity is expressed as number of units {DECIMAL-18/5} in case the quantity is expressed	Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A

Sensitivity: C2 Internal

			For spread bets, the quantity shall be the monetary value wagered per point movement in the underlying financial instrument. For credit default swaps, the quantity shall be the notional amount for which the protection is acquired or disposed of. For increase or decrease in notional amount derivative contracts, the number shall reflect the absolute value of the change and shall be expressed as a positive number. The information reported in this field shall be consistent with the values provided in fields 33 and 46.	as monetary or nominal value.			
100	30	Quantity .			The format should be one of the following: - decimal number of max 18 digits out of which max 5 are fraction digits in case of monetary or nominal value - decimal number of max 18 digits out of which max 17 are fraction digits in case of number of units The quantity can be only a positive number.	N/A	Generated by the XML parser.
102	31	Quantity currency.	Currency in which the quantity is expressed. Only applicable if quantity is expressed as nominal or monetary value.	{CURRENCYCODE_3}	Field is mandatory where monetary or nominal value was used in field 30.	N/A	Generated by the XML parser.
103	31	Quantity currency.			Reported value should be a text string consisting of 3 capital letters.	N/A	Generated by the XML parser.
104	31	Quantity currency.			A valid ISO 4217 currency code that was active at the trading date or is a pre-EURO currency should be populated. The following special currency codes are not allowed: XAG, XAU, XBA, XBB XBC, XBD, XDR, XEU, XFU, XPD, XPT, XXX.	CON-310	Currency code is not valid for the trade date.
105	32	Derivative notional increase / decrease.	Indication as to whether the transaction is an increase or decrease of notional of a derivative contract. Field only applies when there is change in notional for a derivative contract.	'INCR' - Increase 'DECR' - Decrease	Only one of the following values can be populated: 'INCR', 'DECR'.	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

106	33	Price .	Traded price of the transaction excluding, where applicable, commission and accrued interest. In the case of option contracts, it shall be the premium of the derivative contract per underlying or index point. In the case of spread bets it shall be the reference price of the underlying instrument. For credit default swaps (CDS) it shall be the coupon in basis points. Where price is reported in monetary terms, it shall be provided in the major currency unit. Where price is currently not available but pending, the value shall be 'PNDG' Where price is not applicable, the value shall be 'NOAP' . The information reported in this field shall be consistent with the values provided in fields 30 and 46.	{DECIMAL-18/13} in case the price is expressed as monetary value {DECIMAL-11/10} in case the price is expressed as percentage or yield {DECIMAL-18/17} in case the price is expressed as basis points 'PNDG' in case the price is not available 'NOAP' in case the price is not applicable.	Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A	Generated by the XML parser.
107	33	Price.			The format of the reported value should be one of the following: - decimal number of max 18 digits out of which max 13 are fraction digits in case of monetary value - decimal number of max 18 digits out of which max 5 are fraction digits in case of basis points - decimal number of max 11 digits out of which max 10 are fraction digits in case of number of percentage or yield - code 'PNDG' (pending price) or 'NOAP' (price not applicable) - price can be positive, negative or 0, amounts should be reported using PlusOrMinusIndicator	N/A	Generated by the XML parser.
260	33	Price.			In case the CFI code is reported in field 43 (transaction in a financial instrument that is not admitted to trading): For debt instruments, i.e. CFI reported in field 43 is D*****, where the quantity is reported in unit terms, the reported price shall not be in percentage terms.	CON-330	Price notation is incorrect.

Sensitivity: C2 Internal

261	33	Price.			In case the CFI code is available in the instrument reference data (transaction in an instruments admitted to trading): For debt instruments, i.e. where CFI of the instrument in the reference data is D*****, where the quantity is reported in unit terms, the reported price shall not be in percentage terms.	CON-331	Price notation is incorrect.
108	34	Price Currency.	Currency in which the price is expressed (applicable if the price is expressed as monetary value).	{CURRENCYCODE_3}	Field is mandatory where monetary value was used in field 33	N/A	Generated by the XML parser.
109	34	Price Currency.			Reported value should be a text string consisting of 3 capital letters	N/A	Generated by the XML parser.
110	34	Price Currency.			A valid ISO 4217 currency code that was active at the trading date should be populated. The following special currency codes are not allowed: XAG, XAU, XBA, XBB, XBC, XBD, XDR, XEU, XFU, XPD, XPT, XXX.	CON-340	Currency code is not valid for the trade date.
111	35	Net amount.	The net amount of the transaction means the cash amount which is paid by the buyer of the debt instrument upon the settlement of the transaction. This cash amount equals to: (clean price * nominal value)+any accrued coupons. As a result, the net amount of the transaction excludes any commission or other fees charged to the buyer of the debt instrument. Field only applies when the financial instrument is debt.	{DECIMAL-18/5}	In case the CFI code is reported in field 43 (transaction in a financial instrument that is not admitted to trading): The field is mandatory for debt instruments, i.e. CFI reported in field 43 is DB**** (Bonds)	CON-350	Net amount is missing.
262	35	Net amount.			In case the CFI code is available in the instrument reference data (transaction in an instruments admitted to trading): The field is mandatory for debt instruments, i.e. CFI of the instrument in the reference data is DB**** (Bonds).	CON-351	Net amount is missing.
113	35	Net amount.			The format of the reported value should be decimal number of max 18 digits out of which max 5 are fraction digits. It can be a non-negative number (including 0).	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

114	36	Venue.	Identification of the venue where the transaction was executed. Use the ISO 10383 segment MIC for transactions executed on a trading venue, Systematic Internaliser (SI) or organised trading platform outside of the Union. Where the segment MIC does not exist, use the operating MIC. Use MIC code 'XOFF' for financial instruments admitted to trading, or traded on a trading venue or for which a request for admission was made, where the transaction on that financial instrument is not executed on a trading venue, SI or organised trading platform outside of the Union, or where an investment firm does not know it is trading with another investment firm acting as an SI. Use MIC code 'XXXX' for financial instruments that are not admitted to trading or traded on a trading venue or for which no request for admission has been made and that are not traded on an organised trading platform outside of the Union but where the underlying is admitted to trading or traded on a trading venue.	{MIC}	Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A	Generated by the XML parser.
115	36	Venue.			The reported value should be a string of 4 characters (letters or numbers).	N/A	Generated by the XML parser.
116	36	Venue.			The reported code should be a valid ISO 10383 MIC code that was active at the trading date	CON-360	Venue MIC is not valid for the trade date.
270	36	Venue.			If the instrument reported in field 41 is present in reference data, 'XXXX' cannot be reported in field 36.	CON-361	The reported MIC code is incorrect.
117	37	Country of the branch membership.	Code used to identify the country of a branch of the investment firm whose market membership was used to execute the transaction. Where a branch's market membership was not used, this field shall be populated with the country code of the home Member State of the investment firm or the country code of	{COUNTRYCODE_2}	This field is mandatory where: Field 36 is an EEA trading venue or trading platform outside the Union.	CON-370	Country of branch membership is missing.

Sensitivity: C2 Internal

			the country where the firm has established its head office or registered office (in the case of third country firms). This field shall only be populated for the market side of a transaction executed on a trading venue or on an organised trading platform outside of the Union.			
118	37	Country of the branch membership.			Reported value should be a text string consisting of 2 capital letters.	N/A
119	37	Country of the branch membership.			If populated, it should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date.	CON
120	38	Up-front payment.	Monetary value of any up-front payment received or paid by the seller. Where the seller receives the up-front payment, the value populated is positive. Where the seller pays the up-front payment, the value populated is negative.	{DECIMAL-18/5}	In case the CFI code is reported in field 43 (transaction in a derivative instrument that is not admitted to trading): Field is mandatory where the CFI reported in field 43 is SC**** (CDS) .	CON
263	38	Up-front payment.			In case the CFI code is available in the instrument reference data (transaction in an instruments admitted to trading): Field is mandatory where the CFI of the instrument in the reference data is SC**** (CDS) .	CON
121	38	Up-front payment.			The format of the reported value should be decimal number of max 18 digits out of which max 5 are fraction digits in case of monetary or nominal value Up-front payment can be positive, negative or 0, amounts should be reported using PlusOrMinusIndicator.	N/A
122	39	Up-front payment currency.	Currency of the up-front payment.	{CURRENCYCODE_3}	Field is mandatory where field 38 was populated.	N/A
123	39	Up-front payment currency.			Reported value should be a text string consisting of 3 capital letters.	N/A

Sensitivity: C2 Internal

124	39	Up-front payment currency.			A valid ISO 4217 currency code that was active at the trading date should be populated. The following special currency codes are not allowed: XAG, XAU, XBA, XBB, XBC, XBD, XDR, XEU, XFU, XPD, XPT, XXX.	CON-390	Currency code is not valid for the trade date
125	40	Complex trade component id.	Identifier, internal to the reporting firm to identify all the reports related to the same execution of a combination of financial instruments in accordance with Article 12. The code must be unique at the level of the firm for the group of reports related to the execution. Field only applies when the conditions specified in Article 12 apply.	{ALPHANUM-35}	The reported value should be a text string of no more than 35 characters consisting of capital Latin letters (A-Z) and numbers.	N/A	Generated by the XML parser
Instrument details							
219		A general explanation of the instrument related fields is provided in the 'Instrument Validation' tab.					
127	41	Instrument identification code.	Code used to identify the financial instrument This field applies to financial instruments for which a request for admission to trading has been made, that are admitted to trading or traded on a trading venue or on a systematic internaliser. It also applies to financial instruments which have an ISIN and are traded on organised trading platform outside of the Union where the underlying is a financial instrument traded on a trading venue.	{ISIN}	Field is: 1. mandatory for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA 2. optional for transactions in instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA	N/A	Generated by the XML parser.
129	41	Instrument identification code.			The reported value should be a string of 12 characters (letters or numbers).	N/A	Generated by the XML parser.
130	41	Instrument identification code.			The check digit of the ISIN code should be valid according to the algorithm of ISIN validation, as defined in the ISO 6166:2013 standard, Annex C Formula for computing the modulus 10 double-add-double" check digit.	CON-410	The ISIN code is invalid.

Sensitivity: C2 Internal

220	41	Instrument identification code.			The instrument should be present in reference data for the trading date for the following transactions: 1. The transaction is executed on a trading venue within EEA (MIC code in field 36 belongs to a trading venue within the EEA); 2. The transaction is an OTC transaction in instrument admitted to trading (field 36 populated with 'XOFF') and field 47 and 48 are not populated; 3. The transaction is executed on a SI or an organised trading platform outside EEA and field 47 and 48 are not populated. In the case of transactions on EEA venues (point 1 above), the instrument should be valid on the particular trading venue where the transaction was executed. In the case of the other transactions (point 2 and 3), the instrument should be valid on any (at least one) EEA trading venue or SI.	CON-411	If no more than 7 days has passed after the transaction submission (i.e. it is the 7th day or before) the transaction shall be pending with the following message: Pending instrument validation.
						CON-412	If at least 7 days has passed after the transaction submission (i.e. it is the 8th day after the submission) the transaction shall be rejected with the following error message: Instrument is not valid in reference data on transaction date.
Fields 42-56 are not applicable where: transactions are executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI; or field 41 is populated with an ISIN that exists on the reference data list from ESMA.							
132	42	Instrument full name.	Full name of the financial instrument	{ALPHANUM-350}	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA (if populated, it is ignored but the transaction is not rejected) 2. mandatory for transactions in instruments that do not	N/A	Generated by the XML parser.

					exist on the reference data list fror executed OTC or on organised trac EEA		
133	42	Instrument full name.			Field should be a text string of no r characters where the following cha allowed: Latin capital letter (A-Z), n percentage "%", question mark "?' space " ", plus "+", slash "/".	N/A	Generated by the XML parser.
134	43	Instrument classification.	Taxonomy used to classify the financial instrument A complete and accurate CFI code shall be provided.	{CFI_CODE}	Field is: 1. not applicable for transactions e venue or with an investment firm a transactions in instruments that ex data list from ESMA (if populated, i transaction is not rejected) 2. mandatory for transactions in in exist on the reference data list fror executed OTC or on organised trac EEA	N/A	Generated by the XML parser.
135	43	Instrument classification.			The reported value should be a str	N/A	Generated by the XML parser.
222	43	Instrument classification.			The reported CFI should be an allo the ISO 10962:2015.	CON-430	Instrument classification identifier is incorrect.
136	43	Instrument classification.			The instrument classification shoul option style (field 53): 1. If field 53 = EURO, then one of tl should be used: O*E***, H**A**, 2. If field 53 = AMER, then one of tl should be used: O*A***, H**B**, 3. If field 53 = BERM, then one of tl should be used: O*B***, H**C**,	CON-431	CFI code is inconsistent with option exercise style.
223	44	Notional currency 1.	Currency in which the notional is denominated. In the case of an interest rate or currency derivative contract, this will be the notional currency of leg 1 or the currency 1 of the pair. In the case of swaptions where the underlying swap is single-currency, this will	{CURRENCYCODE_3}	Field is: 1. not applicable for transactions e venue or with an investment firm a transactions in instruments that ex data list from ESMA (if populated, i transaction is not rejected) 2. optional for transactions in instr	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

			be the notional currency of the underlying swap. For swaptions where the underlying is multi-currency, this will be the notional currency of leg 1 of the swap.		exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA.		
139	44	Notional currency 1.			A valid ISO 4217 currency code that was active at the trading date or is a pre-EURO currency should be populated. The following special currency codes are not allowed: XAG, XAU, XBA, XBB, XBC, XBD, XDR, XEU, XFU, XPD, XPT, XXX.	CON-440	Currency code is not valid for the trade date.
137	44	Notional currency 1.			Field is mandatory where Field 43 is populated with: 1. Other instruments with the following CFI attributes: O*****, S*****, C*****, R*****, F*****, E*****, D*****, H*****, J*****	CON-441	Notional Currency 1 is missing.
138	44	Notional currency 1.			Reported value should be a text string consisting of 3 capital letters	N/A	Generated by the XML parser.
224	45	Notional currency 2.	In the case of multi-currency or cross-currency swaps the currency in which leg 2 of the contract is denominated. For swaptions where the underlying swap is multi-currency, the currency in which leg 2 of the swap is denominated.	{CURRENCYCODE_3}	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA (if populated, it is ignored but the transaction is not rejected) 2. optional for transactions in instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA	N/A	Generated by the XML parser.
245	45	Notional currency 2.			Field can be only populated when field 44 was also populated	CON-450	Notional currency 2 was populated but Notional currency 1 is missing.
142	45	Notional currency 2.			A valid ISO 4217 currency code that was active at the trading date or is a pre-EURO currency should be populated. The following special currency codes are not allowed: XAG, XAU, XBA, XBB, XBC, XBD, XDR, XEU, XFU, XPD, XPT, XXX.	CON-451	Currency code is not valid for the trade date

Sensitivity: C2 Internal

140	45	Notional currency 2.			This field is mandatory where field 43 is populated with: 1. Swaps with the following CFI attributes : SF**** 2. Futures with the following CFI attributes: FFC***	CON-452	Notional Currency 2 is missing.
250	45	Notional currency 2.			This field should not be populated where field 43 is populated with: 1. Options with the following CFI attributes: O**S**, O**D**, O**T**, O**N** 2. Futures with the following CFI attributes: FFS***, FFD***, FFN***, FFV***, FC**** 3. Swaps with the following CFI attributes: ST**** 4. Complex options with the following CFI attributes: HT****, HE****, HF**** 5. Other classes of instruments with the following CFI attributes: R*****, E*****, C*****, D*****, J*****	CON-453	Notional currency 2 is not applicable for the given instrument.
141	45	Notional currency 2.			Reported value should be a text string consisting of 3 capital letters	N/A	Generated by the XML parser.
143	46	Price multiplier.	Number of units of the underlying instrument represented by a single derivative contract. Monetary value covered by a single swap contract where the quantity field indicates the number of swap contracts in the transaction. For a future or option on an index, the amount per index point. For spreadbets the movement in the price of the underlying instrument on which the spreadbet is based. The information reported in this field shall be consistent with the values provided in fields 30 and 33.	{DECIMAL-18/17}	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA (if populated, it is ignored but the transaction is not rejected) 2. mandatory for transactions in instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA.	N/A	Generated by the XML parser.
144	46	Price multiplier.			The format of the reported value should be a decimal number of max 18 digits out of which max 17 are fraction digits.	N/A	Generated by the XML parser.
145	46	Price multiplier.			Price multiplier should be always a positive number (excluding 0).	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

146	47	Underlying instrument code.	ISIN code of the underlying instrument. For ADRs, GDRs and similar instruments, the ISIN code of the financial instrument on which those instruments are based. For convertible bonds, the ISIN code of the instrument in which the bond can be converted. For derivatives or other instruments which have an underlying, the underlying instrument ISIN code, when the underlying is admitted to trading, or traded on a trading venue. Where the underlying is a stock dividend, then ISIN code of the related share entitling the underlying dividend. For Credit Default Swaps, the ISIN of the reference obligation shall be provided. In case the underlying is an Index and has an ISIN, the ISIN code for that index. Where the underlying is a basket, include the ISIN of each constituent of the basket that is admitted to trading or is traded on a trading venue. Field 47 shall be reported as many times as necessary to list all reportable instruments in the basket.	{ISIN}	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA (if populated, it is ignored but the transaction is not rejected) 2. mandatory for transactions in instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA 3. optional for index derivatives	N/A	Generated by the XML parser.
148	47	Underlying instrument code.			The underlying instrument should be present in reference data for the trading date for the following transactions: 1. The transaction is an OTC transaction: a) field 36 is populated with 'XXXX'; and b) the underlying instrument is not an index; 2. The transaction was executed on a non-EEA organised trading platform: a) field 36 is populated with a non-EEA MIC code or 'XOFF'; and b) the instrument (field 41) is not populated or populated with an instrument that is not present in the reference data; and c) the underlying instrument is not an index; In the case of baskets, if more than one basket constituent is populated, all of them should be present in	CON-471	If no more than 7 days has passed after the transaction submission (i.e. it is the 7th day or before) the transaction shall be pending with the following message: Pending underlying instrument validation.

Sensitivity: C2 Internal

					the instrument reference data. Where the submitting entity populates not only the reportable components but also non-reportable ones, the report is pended and, after the 7 calendar days, rejected (unless the non-reportable components become reportable within that 7 calendar day period).		
						CON-472	If at least 7 days has passed after the transaction submiss (i.e. it is the 8th day after the submission) the transaction s be rejected with the following error message: Underlying instrument XXX is not valid in reference data or transaction date.
149	47	Underlying instrument code.			The reported value should be a string of 12 characters (letters or numbers).	N/A	Generated by the XML parser
150	47	Underlying instrument code.			The check digit of the ISIN code should be valid according to the algorithm of ISIN validation, as defined in the ISO 6166:2013 standard, Annex C Formula for computing the modulus 10 double-add-double check digit.	CON-470	The ISIN code is invalid.
226	47	Underlying instrument code.			More than one value can be reported by copying this field as many times as required.	N/A	Generated by the XML parser
271	48	Underlying index name.	When the underlying is an index, the name of the Index.	{INDEX} Or {ALPHANUM-25} - if the index name is not included in the {INDEX} list.	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA (if populated, it is ignored but the transaction is not rejected) 2. optional for transactions in instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA.	N/A	Generated by the XML parser

Sensitivity: C2 Internal

246	48	Underlying index name.			In case of transactions in instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA, either field 47 or field 48 must be populated.	N/A	Generated by the XML parser.
154	48	Underlying index name.			This field is mandatory where field 43 is populated with 1. Options with the following CFI attributes : O**I**, O**N**, 2. Futures with the following CFI attributes : FFI***, FFN***	CON-480	Direct underlying index name is missing.
264	48	Underlying index name.			This field should not be populated where field 43 is populated with: 1. Debt instruments with the following CFI attributes: DB****, DT****, DY**** 2. Other instruments with the following CFI attributes: E*****	CON-481	Underlying index name is not applicable for the given instrument.
155	48	Underlying index name.			Field should be a text string of no more than 25 characters where the following characters are only allowed: Latin capital letter (A-Z), numbers (0-9), percentage "%", question mark "?", number sign "#", space " ", plus "+", slash "/". or one of the following values: EONA', 'EONS', 'EURI', 'EUUS', 'EUCH', 'GCFR', 'ISDA', 'LIBI', 'LIBO', 'MAAA', 'PFAN', 'TIBO', 'STBO', 'BBSW', 'JIBA', 'BUBO', 'CDOR', 'CIBO', 'MOSP', 'NIBO', 'PRBO', 'TLBO', 'WIBO', 'TREA', 'SWAP', 'FUSW'.	N/A	Generated by the XML parser..
272	49	Term of the underlying index	In case the underlying is an index, the term of the index.	{INTEGER-3}+'DAYS' - days {INTEGER-3}+'WEEK' - weeks {INTEGER-3}+'MNTH' - months {INTEGER-3}+'YEAR' - years	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA (if populated, it is ignored but the transaction is not rejected) 2. optional for transactions in instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA.	N/A	Generated by the XML parser

Sensitivity: C2 Internal

247	49	Term of the underlying index.			This field is not applicable if field 48 was not populated.	N/A	Generated by the XML parser.
156	49	Term of the underlying index.			This field consists of two elements: 1. Unit - a code where one of the following values should be populated: 'DAYS', 'WEEK', 'MNTH', 'YEAR' 2. Value - an integer number of up to 3 numerical digits.	N/A	Generated by the XML parser.
157	49	Term of the underlying index.			This field is mandatory where field 43 is populated with 1. Options with the following CFI attributes : O**N** 2. Futures with the following CFI attributes : FFN***	CON-490	Term of the underlying index is missing.
273	50	Option type.	Indication as to whether the derivative contract is a call (right to purchase a specific underlying asset) or a put (right to sell a specific underlying asset) or whether it cannot be determined whether it is a call or a put at the time of execution. In case of swaptions it shall be: - 'PUTO', in case of receiver swaption, in which the buyer has the right to enter into a swap as a fixed-rate receiver. -'Call', in case of payer swaption, in which the buyer has the right to enter into a swap as a fixed-rate payer. In case of Caps and Floors it shall be: -'PUTO', in case of a Floor. -'Call', in case of a Cap. Field only applies to derivatives that are options or warrants.	'PUTO' - Put 'CALL' - Call 'OTHR' - where it cannot be determined whether it is a call or a put.	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA (if populated, it is ignored but the transaction is not rejected) 2. optional for transactions in instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA.	N/A	Generated by the XML parser.
158	50	Option type.			Field is mandatory where field 43 is populated with: 1. Options with the following CFI attributes: O***** or H***** 2. Warrants with the following CFI attributes: RW****	CON-500	Option type is missing.
251	50	Option type.			This field should not be populated where field 43 is populated with: 1. Instruments with the following CFI attributes: F*****, S*****, E*****, C*****, D*****, J*****	CON-501	Option type is not applicable for the given instrument.

Sensitivity: C2 Internal

159	50	Option type.			If CFI code is 1. 'OC****', 'H**A**', 'H**B**', 'RW**C*' or 'H**C**', then option type should be 'CALL' 2. 'OP****', 'H**D**', 'H**E**', 'RW**P*' or 'H**F**', then option type should be 'PUTO' 3. 'OM****', 'H**G**', 'H**H**', 'RW**B*' or 'H**I**', then option type should be 'OTHR'.	CON-502	Option type does not match instrument classification.
160	50	Option type.			Only one of the following values can be populated: 'PUTO', 'CALL', 'OTHR'	N/A	Generated by the XML parser
274	51	Strike price.	Pre-determined price at which the holder will have to buy or sell the underlying instrument, or an indication that the price cannot be determined at the time of execution. Field only applies to an option or warrant where strike price can be determined at the time of execution. Where price is currently not available but pending, the value shall be 'PNDG' Where strike price is not applicable the field shall not be populated.	{DECIMAL-18/13} in case the price is expressed as monetary value {DECIMAL-11/10} in case the price is expressed as percentage or yield {DECIMAL-18/17} in case the price is expressed as basis points 'PNDG' in case the price is not available.	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA (if populated, it is ignored but the transaction is not rejected) 2. optional for transactions in instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA.	N/A	Generated by the XML parser.
161	51	Strike price.			Field is mandatory where field 43 is populated with: 1. Options with the following CFI attributes: O***** or H***** 2. Warrants with the following CFI attributes: RW****	CON-510	Strike Price is missing.
252	51	Strike price.			This field should not be populated where field 43 is populated with: 1. Instruments with the following CFI attributes: F*****, S*****, E*****, C*****, D*****, J*****	CON-511	Strike price is not applicable for the given instrument.
162	51	Strike price .			The format of the reported value should be one of the following: - decimal number of max 18 digits out of which max 13 are fraction digits in case of monetary value - decimal number of max 18 digits out of which max 17 are fraction digits in case of basis points - decimal number of max 11 digits out of which max 10 are fraction digits in case of number of percentage or yield	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

					- code 'PNDG' - strike price can be positive, negative or 0, amounts should be reported using PlusOrMinusIndicator		
163	52	Strike price currency.	Currency of the strike price.	{CURRENCYCODE_3}	Field is mandatory where monetary value was used in field 51.	N/A	Generated by the XML parser.
164	52	Strike price currency.			Reported value should be a text string consisting of 3 capital letters	N/A	Generated by the XML parser.
165	52	Strike price currency.			A valid ISO 4217 currency code that was active at the trading date should be populated. The following special currency codes are not allowed: XAG, XAU, XBA, XBB, XBC, XBD, XDR, XEU, XFU, XPD, XPT, XXX.	CON-520	Currency code is not valid for t trade date.
275	53	Option exercise style.	Indication as to whether the option may be exercised only at a fixed date (European, and Asian style), a series of pre-specified dates (Bermudan) or at any time during the life of the contract (American style). This field is only applicable for options, warrants and entitlement certificates.	'EURO' - European 'AMER' - American 'ASIA' - Asian 'BERM' - Bermudan 'OTHR' - Any other type	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA (if populated, it is ignored but the transaction is not rejected) 2. optional for transactions in instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA	N/A	Generated by the XML parser.
166	53	Option exercise style.			Field is mandatory where field 43 is populated with: 1. Options with the following CFI attributes: O***** or H***** 2. Warrants with the following CFI attributes: RW****	CON-530	Option exercise style is missin
253	53	Option exercise style.			This field should not be populated where field 43 is populated with: 1. Instruments with the following CFI attributes: F*****, S*****, E*****, C*****, D*****, J*****	CON-531	Option exercise style is not applicable for the given instrument
167	53	Option exercise style.			Only one of the following values can be populated: 'EURO', 'AMER', 'ASIA', 'BERM', 'OTHR'	N/A	Generated by the XML parser
276	54	Maturity date.	Date of maturity of the financial instrument. Field only applies to debt instruments with defined maturity.	{DATEFORMAT}	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an investment firm acting as a SI or	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

					transactions in instruments that ex data list from ESMA (if populated, i transaction is not rejected) 2. optional for transactions in instr exist on the reference data list fror executed OTC or on organised trac EEA		
168	54	Maturity date.			This field is mandatory where field 1. D*****	CON-540	Maturity date is missing.
169	54	Maturity date.			Field must be populated with a val format: YYYY-MM-DD	N/A	Generated by the XML parser.
170	54	Maturity date.			The maturity date should be equal trading day (field 28).	CON-541	Maturity date is incorrect.
254	54	Maturity date.			This field should not be populated populated with: 1. Instruments with the following C O*****, F*****, S*****, E*****, J*****	CON-542	Maturity date is not applicable for the given instrument.
277	55	Expiry date.	Expiry date of the financial instrument. Field only applies to derivatives with a defined expiry date.	{DATEFORMAT}	Field is: 1. not applicable for transactions e venue or with an investment firm a transactions in instruments that ex data list from ESMA (if populated, i transaction is not rejected) 2. optional for transactions in instr exist on the reference data list fror executed OTC or on organised trac EEA	N/A	Generated by the XML parser.
171	55	Expiry date.			Field is mandatory where field 43 is 1. Options with the following CFI a 2. Futures with the following CFI at 3. Forwards with the following CFI	CON-550	Expiry date is missing.
255	55	Expiry date.			This field is should not be populate populated with: 1. Instruments with the following C C*****, D*****	CON-551	Expiry date is not applicable for the given instrument.

Sensitivity: C2 Internal

172	55	Expiry date.			Field must be populated with a valid date in the following format: YYYY-MM-DD	N/A	Generated by the XML parser.
173	55	Expiry date.	.		The expiry date should be equal or later than the trading day (field 28).	CON-552	Expiry date is incorrect.
174	56	Delivery type.	Indication as to whether the transaction is settled physically or in cash. Where delivery type cannot be determined at time of execution, the value shall be 'OPTL' The field is only applicable for derivatives.	'PHYS' - Physically settled 'CASH' - Cash settled 'OPTL' - Optional for counterparty or when determined by a third party.	Field is: 1. not applicable for transactions executed on a trading venue or with an derivative investment firm acting as a SI or transactions in instruments that exist on the reference data list from ESMA (if populated, it is ignored but the transaction is not rejected) 2. mandatory for transactions in derivate instruments that do not exist on the reference data list from ESMA that are executed OTC or on organised trading platforms outside EEA.	N/A	Generated by the XML parser
175	56	Delivery type.			Only one of the following values can be populated: 'PHYS', 'CASH', 'OPTL'.	N/A	Generated by the XML parser.
227	56	Delivery type.			Where field 43 is populated with CFI one of the following codes: OC**P*, OP**P*, FF*P**, FC*P**, SR***P, ST***P, SE***P, SC***P, SF***P, SM***P, HR***P, HT***P, HE***P, HC***P, HF***P, HM***P, IF***P, JE***P, JF***P, JC***P, JR***P, JT***P, LL***P, this field should be populated with 'PHYS'. Where field 43 is populated with CFI one of the following codes: OC**C*, OP**C, FF*C**, FC*C**, SR***C, ST***C, SE***C, SC***C, SM***C, HR***C, HT***E, HE***C, HC***C, HF***C, HM***C, JE***C, JF***C, JC***C, JR***C, JT***C, LL***C, this field should be populated with 'CASH'.	CON-560	Delivery type is incorrect.
Trader, algorithms, waivers and indicators.							
177	57	Investment decision within firm.	Code used to identify the person or algorithm within the investment firm who is responsible for the investment decision. For natural persons, the identifier specified in Article 6 shall be used	{NATIONAL_ID} - Natural persons {ALPHANUM-50} - Algorithms	Field must be always populated where the entity deals on own account (i.e. value 'DEAL' populated in field 29) and the firm does not act as a receiving firm (fields 26 or 27 are not populated).	CON-570	Investment decision identifier is missing.

Sensitivity: C2 Internal

			If the investment decision was made by an algorithm, the field shall be populated as set out in Article 8. Field only applies for investment decision within the firm. Where the transaction is for a transmitted order that has met the conditions for transmission set out in Article 4, this field shall be populated by the receiving firm within the receiving firm's report using the information received from the transmitting firm.			
228	57	Investment decision within firm.		Field should not be populated in reports where the transmitting firm identification code is not populated for the buyer or seller (fields 26 and 27) and the firm deals on a matched principal capacity (i.e. value 'MTCH' populated in field 29) or an any other capacity (i.e. value 'AOTC' populated in field 29) unless the decision maker field is populated with the LEI of the executing entity.		CON-571
178	57	Investment decision within firm.		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.		N/A
179	57	Investment decision within firm.		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).		N/A
180	57	Investment decision within firm.		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.		CON-573
229	57	Investment decision within firm.		In case the CONCAT code is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters (A-Z), numbers (0-9), number sign "#". It should be a string of		CON-574

Sensitivity: C2 Internal

					exactly 20 characters where first two characters are letters, the next 8 characters are numbers and the remaining characters are letters or # where 11th and 16th character are letters. In case national identification number or passport number is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters (A-Z), numbers (0-9). It can be a string of 3 to 35 characters, where first two characters are letters.		
278	57	Investment decision within firm.			In case an algorithm identifier is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters (A-Z), numbers (0-9).	N/A	Generated by the XML parser
267	57	Investment decision within firm.			Investment decision identifier should not be populated in reports where the firm deals on a matched principal capacity (i.e. value 'MTCH' populated in field 29) or an any other capacity (i.e. value 'AOTC' populated in field 29) and the transmitting firm identification code is populated for the buyer and/or seller unless the decision maker field is populated with the LEI of the transmitting firm.	CON-572	Investment decision identifier should not be populated in reports where the firm deals a matched principal capacity an any other capacity and the transmitting firm identificatio code is populated for the buy and/or seller unless the decis maker field is populated with LEI of the transmitting firm.
181	58	Country of the branch responsible for the person making the investment decision.	Code used to identify the country of the branch of the investment firm for the person responsible for the investment decision, as set out in Article 14.3(b). Where the person responsible for the investment decision was not supervised by a branch, this field shall be populated with the country code of the home Member State of the investment firm or the country code of the country where the firm has established its head office or registered office (in the case of third country firms). Where the transaction is for a	{COUNTRYCODE_2}	Field should be a text string consisting of 2 capital letters.	N/A	Generated by the XML parser

Sensitivity: C2 Internal

			transmitted order that has met the conditions for transmission set out in Article 4, this field shall be populated by the receiving firm within the receiving firm's report using the information received from the transmitting firm. This field is not applicable when the investment decision was made by an algorithm.				
182	58	Country of the branch responsible for the person making the investment decision.			If populated, it should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date.		CON-580
230	58	Country of the branch responsible for the person making the investment decision.			This field is mandatory where a person is responsible for the investment decision, i.e. a national ID of a person was populated in field 57. The field is not applicable in case an algo ID was populated in field 57.		N/A
183	59	Execution within firm.	Code used to identify the person or algorithm within the investment firm who is responsible for the execution. For natural persons, the identifier specified in Article 7 shall be used If the execution was made by an algorithm, the field shall be populated as set out in Article 9.	{NATIONAL_ID} - Natural persons {ALPHANUM-50} - Algorithms CLIENT - Client	Field is mandatory for all new transaction reports.		N/A
184	59	Execution within firm.			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.		N/A
185	59	Execution within firm.			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		N/A

Sensitivity: C2 Internal

					(use of proprietary with value CON SchmeNm/Prtry tag).		
186	59	Execution within firm.			If national identifier is used, the fir national identification code should country code that was valid at the	CON-590	The national identification code does not include valid country code.
231	59	Execution within firm.			In case the CONCAT code is used, t characters are only allowed: capita numbers (0-9), number sign "#". It exactly 20 characters where first tv letters, the next 8 characters are nu remaining characters are letters or 16th character are letters. In case national identification num number is used, the following char allowed: capital Latin letters (A-Z), be a string of 3 to 35 characters, w characters are letters.	CON-591	The format of the executing person code is incorrect.
279	59	Execution within firm.			In case an algorithm identifier is us characters are only allowed: capita numbers (0-9).	N/A	Generated by the XML parser.
187	60	Country of the branch supervising the person responsible for the execution.	Code used to identify the country of the branch of the investment firm for the person responsible for the execution of the transaction, as set out in Article 14.3(c). Where the person responsible was not supervised by a branch, this field shall be populated with the country code of the home Member State of the investment firm, or the country code of the country where the firm has established its head office or registered office (in the case of third country firms). This field is not applicable when the execution was made by an algorithm.	{COUNTRYCODE_2}	Field should be a text string consis	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

188	60	Country of the branch supervising the person responsible for the execution.			If populated, it should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date.	CON-600	Country code is not valid for the trade date.
232	60	Country of the branch supervising the person responsible for the execution.			This field is mandatory where a person is responsible for the investment decision, i.e. a national ID of a person was populated in field 59. The field is not applicable in case an algo ID was populated in field 59.	N/A	Generated by the XML parser.
189	61	Waiver indicator .	Indication as to whether the transaction was executed under a pre-trade waiver in accordance with Articles 4 and 9 of Regulation (EU) 600/2014. For equity instruments: 'RFPT' = Reference price transaction 'NLIQ' = Negotiated transactions in liquid financial instruments 'OILQ' = Negotiated transactions in illiquid financial instruments 'PRIC' = Negotiated transactions subject to conditions other than the current market price of that equity financial instrument. For non-equity instruments: 'SIZE' = Above specific size transaction 'ILQD' = Illiquid instrument transaction This field shall only be populated for the market side of a transaction executed under a waiver on a trading venue.	Populate one or more of the following flags: 'RFPT' - Reference price 'NLIQ' - Negotiated (liquid) 'OILQ' - Negotiated (illiquid) 'PRIC' - Negotiated (conditions) 'SIZE' - Above specified size 'ILQD' - Illiquid instrument.	This field should NOT be populated where: 1. Field 36 is 'XOFF', 'XXXX' or a non-EEA venue.	CON-610	Waiver indicator is inconsistent with trading venue.
190	61	Waiver indicator .			If populated, one or more of the following values can be populated: 'RFPT', 'NLIQ', 'OILQ', 'PRIC', 'SIZE', 'ILQD'.	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

192	62	Short selling indicator.	A short sale concluded by an investment firm on its own behalf or on behalf of a client, as described in Article 11. When an investment firm executes a transaction on behalf of a client who is selling and the investment firm, acting on a best effort basis, cannot determine whether it is a short sale transaction, this field shall be populated with 'UNDI' Where the transaction is for a transmitted order that has met the conditions for transmission set out in Article 4 of this Regulation, this field shall be populated by the receiving firm in the receiving firm's reports using the information received from the transmitting firm. This field is only applicable when, the instrument is covered by Regulation (EU) 236/2012, and the seller is the investment firm or a client of the investment firm.	'SESH' - Short sale with no exemption 'SSEX' - Short sale with exemption 'SELL' - No short sale 'UNDI' – Information not available.	If populated, only one of the following values can be populated: 'SESH', 'SSEX', 'SELL', 'UNDI'.	N/A	Generated by the XML parser.
194	63	OTC post-trade indicator	Indicator as to the type of transaction in accordance with Articles 20(3)(a) and 21(5)(a) of Regulation (EU) 600/2014. For all instruments: 'BENC' = Benchmark transactions 'ACTX' = Agency cross transactions 'LRGS' = Post-trade large-in-scale transactions 'ILQD' = Illiquid instrument transaction 'SIZE' = Above specific size transaction 'CANC' = Cancellations	Populate one or more of the following flags: 'BENC' – Benchmark 'ACTX' – Agency cross 'LRGS' - Large in scale 'ILQD' - Illiquid instrument 'SIZE' - Above specified size 'CANC' - Cancellations 'AMND' - Amendments 'SDIV' – Special dividend 'RPRI' – Price improvement 'DUPL' – Duplicative 'TNCP – Not contributing	If populated, one or more of the following values can be populated: 'BENC', 'ACTX', 'LRGS', 'ILQD', 'SIZE', 'CANC', 'AMND', 'SDIV', 'RPRI', 'DUPL', 'TNCP', 'TPAC', 'XFPH'. More than one value can be reported by copying this field as many times as required.	N/A	Generated by the XML parser.

Sensitivity: C2 Internal

			'AMND' = Amendments For equity instruments: 'SDIV' = Special dividend transactions 'RPRI' = Transactions which have received price improvement 'DUPL'= Duplicative trade reports 'TNCP' = Transactions not contributing to the price discovery process for the purposes of Article 23 of Regulation (EU) No 600/2014 For non-equity instruments: 'TPAC' = Package transaction 'XFPH' = Exchange for Physical transaction.	to the price discovery process 'TPAC' - Package 'XFPH' – Exchange for Physical.				
195	64	Commodity derivative indicator.	Indication as to whether the transaction reduces risk in an objectively measurable way in accordance with Article 57 of Directive 2014/65/EU. Where the transaction is for a transmitted order that has met the conditions for transmission set out in Article 4, this field shall be populated by the receiving firm in the receiving firm's reports using the information received from the transmitting firm. This field is only applicable for commodity derivative transactions.	'true' - yes 'false'- no	If populated, only 'true' or 'false' values allowed		N/A	Generated by the XML parser.
233	64	Commodity derivative indicator.			Field is mandatory for commodity derivative transaction where the instrument reported in field 41 is classified in instrument reference data as commodity derivative (i.e. field 4 in instrument reference data is populated with 'true').		CON-640	Commodity derivative indicator is missing.

196	65	Securities financing transaction indicator.	‘true’ shall be populated where the transaction falls within the scope of activity but is exempted from reporting under [Securities Financing Transactions Regulation] ‘false’ otherwise.	true - yes false- no	Field is mandatory for all new transaction reports.	N/A	Generated by the XML parser.
197	65	Securities financing transaction indicator.			Only 'true' or 'false' values allowed.	N/A	Generated by the XML parser.

This material has been prepared by Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. (BME), its subsidiaries, affiliates and/or their branches (together, "BME") for the exclusive use of the persons to whom BME delivers this material. This material or any of its content is not to be construed as a binding agreement, recommendation, investment advice, solicitation, invitation or offer to buy or sell financial information, products, solutions or services. The information does not reflect the firm positions (proprietary or third party) of the entities involved in the Spanish Securities Market. BME is under no obligation to update, revise or keep current the content of this material, and is subject to change without notice at any time. No representation, warranty, guarantee or undertaking – express or implied – is or will be given by BME as to the accuracy, completeness, sufficiency, suitability or reliability of the content of this material.

The opinions presented are theoretical and, therefore, the content hereof is intended for informational purposes only and should not be used for portfolio or asset valuations, or as the basis for any investment recommendations. Neither contributing Entities, nor Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S.A.(BME) nor any of its subsidiaries, accept responsibility for any financial loss or decision made based on the information contained in this material. In general, neither Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. (BME) nor any of its subsidiaries, nor the contributing Entities, their directors, representatives, associates, subsidiaries, managers, partners, employees or advisors accept any responsibility for this information or unauthorised use of the same.

This material is property of BME and may not be printed, copied, reproduced, published, passed on, disclosed or distributed in any form without the express prior written consent of BME.

2023 Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. All rights reserved.

BME
Plaza de la Lealtad,1
Palacio de la Bolsa
28014 Madrid

www.bolsasymercados.es

Sensitivity: C2 Internal