

COMUNICADO 18/17

Fecha: 02 de junio de 2017

Asunto: Servicio de Transaction Reporting de los Mercados de BME

Tal y como se informaba el 6 de abril, BME pone a disposición de los miembros de Mercado el Servicio de Transaction Reporting, adaptándolo a los requisitos de la nueva normativa MIFID.

Se adjunta Documentación del Servicio de Transaction Reporting (en adelante STR) Versión 1.0. Los puntos a destacar son:

- El servicio se ofrece para realizar la comunicación de operaciones a la CNMV u otra Autoridad Competente europea. Así mismo, la comunicación de las operaciones realizadas fuera de mercado (XOFF), pero con origen en operaciones de mercado, también se incluye en el servicio, si bien ésta se comunicará a la Autoridad Competente a través del ARM de BME (Capítulo 1 del documento adjunto).
- Los miembros de mercado deberán proporcionar información adicional al sistema de BME para cumplir con el Servicio TR. El sistema de envío de información adicional necesaria para realizar la comunicación permite utilizar y combinar dos métodos, siempre mediante envío de ficheros de texto plano por SFTP, tal y como se detalla en el Capítulo 2:
 - Método por el que la información adicional se vincula operación a operación a través de un código de transacción.
 - Método que permite al STR recoger datos de la orden y con ellos cumplimentar los campos necesarios para el Transaction Reporting. Este método exige del miembro una información detallada en los ficheros enviados para el Order Record Keeping.
- El programa de STR realizará todas las validaciones propuestas por ESMA y otras adicionales, con el fin de asegurar la calidad del servicio. Se comunicarán al miembro de mercado aquellos registros que no hayan superado las validaciones por falta de información adicional enviada por el miembro o por otro tipo de errores. (Capítulo 3 del documento adjunto)
- STR informará al miembro de los registros enviados correctamente a la Autoridad Competente.

Se informará puntualmente a los Miembros de las tarifas y fechas de pruebas.

Para más información, pueden contactar con Meffmarketservices@grupobme.es