



Commodities Position Reporting

Ver 1.4

12 de marzo de 2019

Índice

1. Introducción	3
2. Campos y registros utilizados	4
Campos a facilitar a nivel de cuenta.....	4
Formato del fichero	4
3. Validaciones	9
4. Horario	10
Datos de BME Clearing hacia el miembro.....	10
Datos del miembro hacia MEFF	10
Envíos desde MEFF a la autoridad competente.....	10
5. Comunicaciones	11
Aspectos técnicos de los ficheros de entrada	11
Nomenclatura de los ficheros generados por BME Clearing	11
Nomenclatura de los ficheros de posiciones definitivas enviados por los miembros	11
Nomenclatura de los ficheros de respuesta	12
Registros FI	12
Registros VA.....	13

Modificaciones al documento ver 1.2

- Se añade validación al campo PstnQtyUoM, no puede venir informado con UNIT, tiene que venir informado con OTHER. El campo de descripción PstnQtyUoMDesc tiene que venir informado con MWh. Se añade código de error para la validación.

Modificaciones al documento ver 1.3

- Se añade al campo ReportRefNo la subcuenta para indicar si se trata de una cuenta de especulación o de cobertura, y el indicador de "Reduce Riesgo".

1. Introducción

La Directiva 2014/65/UE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 15 de mayo de 2014, relativo a los mercados de instrumentos financieros, y en particular su artículo 58, punto 1, señala que:

Los Estados miembros se asegurarán de que las empresas de servicios de inversión o los organismos rectores del mercado que gestionen un centro de negociación que negocie derivados sobre materias primas, derechos de emisión o derivados sobre derechos de emisión:

- a) *publican un informe semanal con las posiciones agregadas mantenidas por las distintas categorías de personas respecto de los distintos derivados sobre materias primas o derechos de emisión o derivados de estos negociados en su centro de negociación, en el que se especifiquen el número de posiciones largas y cortas por tales categorías, los cambios al respecto desde el informe anterior, el porcentaje de interés abierto total que representa cada categoría y el número de personas que mantienen posiciones en cada categoría de conformidad con el apartado 4, y comunican dicho informe a la autoridad competente y a la AEVM; la AEVM procederá a la publicación centralizada de la información incluida en tales informes;*
- b) *facilitan a la autoridad competente, al menos diariamente, un desglose completo de las posiciones mantenidas por todas las personas, incluidos los miembros o participantes y sus clientes, en el centro de negociación.*

El Reglamento de Ejecución (UE) 2017/1093 de la Comisión, de 20 de junio de 2017, especifica los datos asociados a cada posición que deben reportarse por los mercados para las posiciones en derivados sobre mercancías mantenidas por personas jurídicas (no por clientes individuales).

Para que MEFF pueda cumplir con esta obligación, se hace necesario que diariamente los miembros pongan a disposición de MEFF la información correspondiente a sus clientes en un formato XML que se ha consensuado a nivel de la asociación EFET.

Con el fin de facilitar esta labor, MEFF ha alcanzado un acuerdo con BME CLEARING para que:

- En los sistemas de BME CLEARING se asocie a cada cuenta de posición la información de contacto requerida, así como cierta información adicional que se utilizará como valores por defecto de ciertos campos.
- BME CLEARING ponga diariamente a disposición de MEFF y de los miembros del segmento de Energía unos ficheros borrador con la información de posiciones en el formato requerido por MEFF.

Estos ficheros así producidos podrán ser recogidos por los miembros de MEFF en el servidor sFTP a partir de las 7:00h de D+1. En caso necesario, podrán ser modificados antes de las 18:00h, momento a partir del cual MEFF elaborará el informe definitivo para su remisión al regulador.

2. Campos y registros utilizados

Campos a facilitar a nivel de cuenta

Los siguientes a nivel de cuenta se utilizarán para cumplimentar el informe borrador:

LEI	C	20		LEI del cliente
EEmail	C	50		Correo electrónico
LEIEntidadMatriz	C	20		LEI de la entidad matriz última
EEmailEntidadMatriz	C	50		Dirección de correo electrónico de la entidad matriz última
SituEntidadMatriz	C	1	S =Si (el titular de la posición es una institución de inversión colectiva que toma decisiones de inversión independientes) N=No (el titular de la posición no es una institución de inversión colectiva que tome decisiones de inversión independientes)	Situación de la matriz de una institución de inversión colectiva: Campo para indicar si el titular de la posición es una institución de inversión colectiva que toma decisiones de inversión de forma independiente de su matriz, según lo establecido en el artículo 4, apartado 2, del Reglamento Delegado (UE) 2017/591 de la Comisión(1).
Operativa reduce riesgo	C	1	S=SI N=NO	Valor por defecto de los registros incluidos en el informe

Formato del fichero

El fichero puede tener dos formatos diferentes. Uno definido por la CNMV y otro definido por la EFET.

Los ficheros que generamos nosotros siempre cumplen el formato de la CNMV.

El fichero XML a intercambiar viene definido por esquemas XSD.

1. El formato de la CNMV es:

- a. La XSD de Campos de Negocio para los estados de posición de derivados sobre materias primas está disponible en



composrpt.v1_9.xsd

b. Para la cabecera



head.001.001.01_ESMAUG_1.0.0.xsd



head.003.001.01.xsd

2. El formato de la EFET es:



composrpt.002.1.0.x
sd

La siguiente tabla detalla los campos que contiene dicho fichero que cumple el formato de la CNMV, es el formato que en el que se generarán siempre los ficheros por parte de MEFF.

#	Campo	Descripción	xPath
	Header		/BizData/Hdr/AppHdr
1	De	Identifica la organización que envía el mensaje. LEI de la entidad que presenta la comunicación	M /Fr/OrgId/Id/OrgId/Othr/Id
2	Para	Identifica la organización que recibe el mensaje. En este caso pondremos: 'ES'	M /To/OrgId/Id/OrgId/Othr/Id
3	Identificador Mensaje de Negocio	Identifica de forma inequívoca el mensaje de negocio al terminal de mensajes. <Sequence No>-<Version>_<Year> del nombre del archivo ZIP a enviar.	M BizMsgIdr
4	Identificador Definición de Mensaje	Identificador del mensaje de conformidad con la CNMV. En este caso pondremos: "composrpt.v1_9"	M MsgDefIdr
5	Fecha de creación	Fecha y hora UTC con formato ISO 8601.: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dddZ Ejemplo: 2016-12-30T20:13:14.123456Z	M CreDt
	Report Body (this element is repeatable)		/BizData/PyId
6	Número de referencia del informe	Identificador único que debe ser reconocido por el emisor y el receptor. El formato del identificador es miembro, cuenta, subcuenta, contrato e indicador de reduce riesgo, juntos y sin ningún tipo de separador entre ellos.	M /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/ReportRefNo
7	Fecha y hora de envío del informe	La fecha y hora en que se envía el informe.	M /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/RptDt
8	Fecha del día de negociación de la posición informada	Fecha en que se tiene la posición informada al cierre del día de negociación en el centro de negociación.	M /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/BusDt
9	ID de entidad que reporta	El identificador de la empresa de inversión que reporta. Debe mostrar el código de identificación de entidad jurídica (LEI) para entidades legales o {NATIONAL_ID} para personas físicas que no tienen un LEI.	M /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/RptEnt/LEI or /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/RptEnt/NationalID/Othr/Id with /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/RptEnt/NationalID/Othr/SchmeNm/Cd or /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/RptEnt/NationalID/Othr/SchmeNm/Prtry
10	ID del titular de la posición	Identificador de la empresa titular de la posición. Campo que debe rellenarse con el código identificador de entidad jurídica (LEI) para entidades legales o {NATIONAL_ID} para personas físicas que no tienen un LEI. (Nota: si la posición se mantiene como una posición propia de la empresa que informa, este campo será idéntico al campo "ID de la entidad emisora" más arriba).	M /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstnHldr/LEI or /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstnHldr/NationalID/Othr/Id

				/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstnHldr/NationalID/Othr/SchmeNm/Cd with /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstnHldr/NationalID/Othr/SchmeNm/Prtry
11	n/a - campo adicional (ver nota 2)	<p>Categoría del titular de la posición, uno de los siguientes:</p> <p>Empresa de inversión o institución de crédito. Fondo de inversión. Otra institución financiera. Empresa comercial. Operadores con obligaciones de cumplimiento en virtud de la Directiva 2003/87 / CE.</p> <p>Esta información es requerida en el "Informe de Compromiso del Comerciante" (ITS4 - Artículo 1). Se ha sugerido que los mercados le pedirán a los miembros estos datos para que puedan incluir el informe semanal del CoT, por lo que incluir este campo ahora será beneficioso para este requisito.</p>	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstinHldrCategory
12	Dirección de correo electrónico del titular de la posición	Dirección de correo electrónico para notificaciones de asuntos relacionados con la posición.	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstinHldrCntctEml
13	Dirección de correo electrónico de la entidad matriz principal	Dirección de correo electrónico para la correspondencia en relación con las posiciones agregadas.	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/ParentPstinHldrCntctEml
14	Estatus de la matriz del plan de inversión colectiva	Campo para informar si el tenedor de posición es un organismo de inversión colectiva que toma decisiones de inversión con independencia de su matriz según lo establecido en el artículo 4 (2) del RTS 21.	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstinHldrIsIdpdtInd
15	ID de entidad principal	<p>El código de identificación de entidad jurídica (LEI) para entidades legales o {NATIONAL_ID} para personas físicas que no tienen un LEI.</p> <p>Nota: este campo puede ser idéntico al campo "ID de entidad informante" y / o "ID de titular de posición" anterior si la entidad matriz final tiene sus propias posiciones, o crea sus propios informes.</p>	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PrntEnt/LEI or /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PrntEnt/NationalID/Othr/Id /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PrntEnt/NationalID/Othr/SchmeNm/Cd with /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PrntEnt/NationalID/Othr/SchmeNm/Prtry
16	Código de identificación del contrato negociado en los centros de negociación	Código de identificación del contrato negociado en los centros de negociación Identificador del derivado de materias primas, derechos de emisión o derivado del mismo. Ver el campo "Identificador de la sede de negociación" a continuación para el tratamiento de los contratos OTC que son económicamente equivalentes a los contratos que se negocian en los lugares de negociación.	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/ISIN
17	Código de producto del mercado de negociación	Un identificador alfanumérico único e inequívoco utilizado por el centro de negociación agrupando diferentes contratos, resultantes de diferentes vencimientos y precios de ejercicio del mismo producto que tienen diferentes ISIN.	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/VenProdCde
18	Identificador del mercado de negociación	El valor en este campo debe ser, ISO 10383, el MIC del segmento para las posiciones informadas con respecto a los contratos en el mercado de negociación. Donde el segmento MIC de segmento no exista, use el MIC operativo. Use el código MIC 'XOFF' 'XXXX' para las posiciones fuera del mercado de negociación en contratos OTC económicamente	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/TrdngVenID

		equivalentes. Utilice el código MIC 'XOFF' para derivados cotizados operados fuera del mercado de negociación. XMPW XOFF Other valid MICs		
19	Tipo de posición	Campo para informar si la posición está en futuros, opciones, derechos de emisión o derivados de los mismos, derivados de materias primas definidos en el punto c) del artículo 4, apartado 1, punto 44, de la Directiva 2014/65 / UE (ej. derivados titulizados) o cualquier otro tipo de contrato (ej. un contrato con arreglo al punto C10 del anexo I de la Directiva 2014/65 / UE). FUTR para futuros OPTN para opciones	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstnTyp
20	Vencimiento de la posición	Campo para informar si el vencimiento del contrato que comprende la posición informada se refiere al mes puntual o a todos los demás meses. Nota: se requieren informes separados para los meses puntuales y para todos los demás meses, de conformidad con el Artículo 57 (1). SPOT para el mes actual OTHR	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstnMtrty
21	Importe de la posición	Campo para informar la cantidad de la posición neta mantenida en el derivado de materias primas, expresado en MWh. Este campo debe ser un número positivo para posiciones largas y un número negativo para posiciones cortas.	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstnQty
22	Símbolo del Importe de la posición	OTHER	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/PstnQtyUoM
23	Indicador de posición que reduce el riesgo en relación con la actividad comercial.	Campo para informar si la posición reduce el riesgo de acuerdo con el Artículo 7 de RTS 21. TRUE FALSE	M	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/<Report Status>/CPRBody/RiskRdcInd

3. Validaciones

Al recibir un fichero de un miembro se realizarán las siguientes comprobaciones:

- Que el fichero valida según los criterios del esquema XML. Esto incluye la validación de los campos cuyo contenido está entre una lista acotada de valores posibles.
La validación del formato XML se hará de la siguiente manera.
 - Pasar esquema de la CNMV o de EFET según esquema indicado en fichero
 - Si usa el esquema de la EFET, actualizar los campos que sobran o faltan
 - Si no cumple ninguno de los dos esquemas, utilizar el fichero generado por SMART y generar un fichero con error para devolvérselo al miembro
- Que el código de miembro que se incluye en el contenido del mensaje coincide con el miembro emisor del fichero.
- Que los contenidos de ciertos campos son válidos:
 - Fecha del fichero coincide con la fecha de la sesión bursátil cuya información contiene el fichero.
 - ISIN correspondiente a un contrato listado por MEFF en el segmento de energía.
 - El campo de "Símbolo del Importe de la posición" (PstnQtyUoM) tiene que venir informado con "OTHER".

En caso de error se procederá a generar un fichero de respuesta con los errores correspondientes

4. Horario

Datos de BME CLEARING hacia el miembro

Después del cierre de la sesión de BME CLEARING, al inicio de los sistemas para la siguiente sesión se generarán los informes borrador de posiciones.

El informe se generará para cada miembro de MEFF, con el detalle de todas sus cuentas, y estará disponible a partir de las 7:00h de D+1.

Datos del miembro hacia MEFF

Los miembros del mercado podrán enviar un fichero que sustituya al generado por BME CLEARING hasta las 18:00h de la fecha D+1.

Los ficheros de validación se generarán al recibirse los ficheros de entrada, mediante un proceso *batch* cuya duración dependerá del tamaño del fichero recibido y de la cola acumulada de entrada.

Envíos desde MEFF a la autoridad competente

A partir de las 18:00h MEFF generará el informe consolidado con la información de todos los clientes de todos los miembros para ser remitido a la autoridad competente.

5. Comunicaciones

Aspectos técnicos de los ficheros de entrada

Deberán aplicarse los criterios estándar para el tratamiento de ficheros XML.

Nomenclatura de los ficheros generados por BME CLEARING

El nombre del fichero XML que contiene el borrador de los registros de una sesión será

OUT_LEI_TIPO_AAAAMMDD_SEQ.EXT_MD5

- OUT(3) → OUTBOUND. Indica que es un fichero de salida.
- LEI(20) → Código LEI del miembro que realiza el envío
- TIPO(4) → Tipo de fichero Position Report Draft: **PRD**
- AAAAMMDD(8) → Fecha de la sesión bursátil cuya información contiene el fichero.
- SEQ(3) → Secuencia de 3 dígitos. Ejemplo: 001
- EXT(3) → Extensión del fichero: **DAT**
- MD5(32) → 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.

Nomenclatura de los ficheros de posiciones definitivas enviados por los miembros

El nombre del fichero que contendrá los registros de información remitidos por los Miembros se deberá componer de la siguiente manera:

INB_LEI_TIPO_AAAAMMDD_SEQ.EXT_MD5

- INB(3) → INBOUND. Indica que es un fichero de entrada.
- LEI(20) → Código LEI del miembro que realiza el envío
- TIPO(4) → Tipo de fichero Position Report Final: **PRF**
- AAAAMMDD(8) → Fecha de la sesión bursátil cuya información contiene el fichero.
- SEQ(3) → Secuencia de 3 dígitos. Ejemplo: 001
- EXT(3) → Extensión del fichero.
- MD5(32) → 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.

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

Cada fichero de Commodities Position Report cargado en el sistema generará un fichero de respuesta en el momento indicando si el fichero fue incorporado satisfactoriamente.

Nomenclatura de los ficheros de respuesta

El nombre del fichero que contiene los registros de respuesta se compondrá de la siguiente manera:

OUT_LEI_TIPO_AAAAMMDD_SEQ.EXT_MD5

- OUT(3) → OUTBOUND. Indica que es un fichero de salida.
- LEI(20) → Código LEI del miembro que realiza el envío
- TIPO(4) → Tipo de fichero Position Report Ack: **PRA**
- AAAAMMDD(8) → Fecha de la sesión bursátil cuya información contiene el 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.

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

1. Resultado de la validación del esquema XML.
2. Resultado de las validaciones realizadas en cuanto al contenido del documento (ver Apartado Validaciones).

Registros FI

Este registro contiene información relativa al GLOBAL del fichero.

Su estructura es la siguiente:

Nº	Campo	Dato	Descripción
1	TypeReg	FI	Tipo de registro
2	Origin		ORK: Sistema ORK BME
3	CreDT		Fecha de envío
4	ExctgPty	LEI Identifier	LEI del Miembro
5	FileName		Nombre del fichero remitido
6	Sts		Estatus (Tabla 1)

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
RJCT	Rejected	Todo el reporte ha sido rechazado.

Registros VA

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

Su estructura es la siguiente:

Nº	Campo	Dato	Descripción
1	TypeReg	VA	Tipo de registro
2	NumeroID		Número de línea en el fichero al que se refiere.
3	ErrorCode		Código de error
4	ErrorTxt		Texto explicativo

Tabla de códigos de error:

ErrorCode	Definición
1003	Campo MIC del mercado en campo TrdnVn incorrecto
1007	Campo Fecha incorrecto
1009	Campo LEI del cliente incorrecto
1022	Campo Notation of the position Quantity incorrecto
1100	Campo ISIN incorrecto