



Order Record Keeping

Versión 1.1.2

10 de mayo de 2018

Índice

| | |
|--|-----------|
| 1. Introducción | 3 |
| Datos en la orden..... | 5 |
| Short codes o uso de Códigos de identificación | 6 |
| 2. Tipos de registro | 9 |
| Registro CT – Cliente..... | 9 |
| Registro DW – Decisión de inversión dentro de la empresa..... | 10 |
| Registro EW – Ejecución dentro de la empresa | 11 |
| Registro RC – Número de orden | 11 |
| 3. Validaciones | 14 |
| 4. Horario | 16 |
| Datos del Miembro hacia BME | 16 |
| Datos de BME hacia el miembro | 16 |
| 5. Comunicaciones | 17 |
| Aspectos técnicos de los ficheros de entrada | 17 |
| Nomenclatura de los ficheros enviados por los Miembros..... | 17 |
| Nomenclatura y formato de los ficheros del ORK hacia los Miembros | 18 |
| Registros FI | 18 |
| Registros VA..... | 19 |
| Registros VB..... | 23 |
| 6. Correcciones | 25 |
| Campos susceptibles de ser modificados en una corrección | 25 |
| Modalidad 1. Corrección masiva | 25 |
| Modalidad 2. Corrección individual..... | 26 |
| 7. Ejemplos | 27 |
| Ejemplo 1. Se corresponde con el ejemplo 43 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452 | 27 |
| Ejemplo 2. Se corresponde con el ejemplo 82 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452 | 28 |
| Ejemplo 3. Se corresponde con el ejemplo 65 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452 | 29 |
| Ejemplo 4. Orden de renta variable agregada informando de referencia titular. | 30 |
| Ejemplo 5. Informar una operación individualmente mediante el registro RC..... | 31 |
| ANEXO 1: Formato de Campos | 33 |
| Formato registro RI. Registro por Identificador..... | 33 |
| Formato SubRegistro CT de Clientes..... | 33 |
| Formato SubRegistro DW de decisores “within the firm” | 35 |
| Formato SubRegistro EW de ejecutores “within the firm” | 36 |
| Formato Registro RC – Número de orden..... | 37 |
| Formato Registro DA – Registro de modificación de datos adicionales..... | 38 |

Modificaciones al documento versión 1

- Se informa de los códigos 4 y 5 para los registros de titularidad, decisor y ejecutor son solo aplicables a los mercados de renta variable.
- Sustitución del campo "Fecha" en el registro RI por los campos "F_Inicial" y "F_Final".
- Detalle del funcionamiento del rango de fechas del registro RI.
- Ampliación de los detalles del funcionamiento del registro CT.
- Ampliación de los detalles del funcionamiento del registro RC.
- Eliminación de la limitación horaria para la recepción de los ficheros por el servidor SFPT.
- Ampliación de los detalles del funcionamiento de la corrección individual de órdenes.
- Incorporación de rango de fechas y campo Action en los ejemplos.

Modificaciones al documento versión 1.1

- Validaciones: ya no se requiere que la orden sea DEA cuando el cliente es ejecutor.
- En el horario, se modifica la hora de validación de los identificadores en D+1 de 20:00h a 23:30h.
- Se añaden 5 códigos de error nuevos en los registros VA.
- Se ha añadido el Anexo 1: Formato de los campos.

Modificaciones al documento versión 1.1.1

- El valor "A" del campo Action también significa modificación, Capítulo 2.
- Modificación de las validaciones, Capítulo 3.
- Nuevo formato de los ficheros de salida del sistema VA y VB, Capítulo 5.
- El hash MD5 ha de tener 32 caracteres, Capítulo 5.
- El 2º Campo MIC eliminado en ejemplos del registro CT (errata).
- Se corrige código CONCAT del Ejemplo 1.
- Introducción del valor "N" en los registros tipo RC para indicar la ausencia de Cliente, Decisor y/o Ejecutor dentro de la empresa.
- Se modifica la explicación de los campos del Registro RC, Capítulo 2.

1. Introducción

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

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

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

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

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

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

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

Datos en la orden

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

| Número de campo | Descripción |
|---|---|
| Identificación de las partes pertinentes | |
| 1 | Identificación del Miembro que introdujo la orden |
| 2 | Direct Electronic Access (DEA) |
| 3 | Código de identificación del cliente |
| 4 | Código de decisión de inversión dentro del miembro |
| 5 | Código de ejecución dentro del miembro |
| 6 | Intermediario no ejecutor |
| Calidad en la que se actúa en la negociación y provisión de liquidez | |
| 7 | Calidad en la que se actúa en la negociación |
| 8 | Actividad de provisión de liquidez |
| Período de validez y restricciones de las órdenes | |
| 10 | Período de validez |
| 11 | Restricciones de las órdenes |
| Identificación de la orden | |
| 17 | Código de libro de órdenes |
| Eventos que afectan a la orden | |
| 21 | Nueva orden, modificación de orden, cancelación de orden, rechazo de orden, ejecución parcial o total |
| Tipo de orden | |
| 22 | Tipo de orden |
| Precios | |
| 24 | Precio límite |
| 25 | Precio límite adicional |
| 26 | Precio de stop |
| Instrucciones de las órdenes | |
| 32 | Indicador de compra / venta |
| 36 | Cantidad inicial |
| 38 | Cantidad mostrada |
| 40 | Cantidad mínima aceptable |
| 41 | Volumen mínimo ejecutable |
| 45 | Prevención de auto ejecución |
| 46 | Identificación de orden vinculada a una estrategia |

Short codes o uso de Códigos de identificación

Los campos 3, 4 y 5 funcionarán de forma codificada. Deben ser cumplimentados en los mercados de renta fija y MEFF para que la orden no sea rechazada por el mercado, siendo opcional en el mercado de renta variable, tal y como está definido en las especificaciones técnicas del protocolo FIX y SAPI para el mercado SENAF.

Estos campos serán remitidos en la orden utilizando 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.

Los siguientes códigos de identificación, al estar predefinidos, no será necesario remitir información complementaria que explique su significado (archivos RI o RC explicados más adelante). Van a quedar fijados para todos los usuarios con los siguientes valores:

Campo 3, Código de identificación del cliente:

- 0 – No hay cliente en la orden (es una orden de cuenta propia). En este caso no es necesario remitir información posterior de identificación.
- 1 – Orden Agregada: asociado al flag “AGGR”.
- 2 – Orden con cliente pendiente de asignar: asociado al flag “PNAL”.
- 4 – Identificación del cliente dentro de la entidad mediante la “Referencia Cliente”, informado en la orden. Cuando se informe este valor se utilizará el campo de “Referencia Cliente” informado en la orden como vínculo con el registro RI-CT. Este código **solo aplica al mercado de renta variable**.
- 5 – El cliente será informado por el miembro de mercado posteriormente mediante un registro RC. Este código **solo aplica al mercado de renta variable**.

*Estos valores predefinidos no aplican a SENAF.

Campo 4, Código de decisión de la inversión dentro de la empresa:

- 0 – No hay decisor dentro de la entidad (la decisión se ha tomado fuera de la empresa)
- 4 – Identificación del decisor dentro de la entidad mediante “Referencia Cliente” informado en la orden. Cuando se informe este valor se utilizará el campo de “Referencia Cliente” informado en la orden como vínculo con el registro RI-DW. Este código **solo aplica al mercado de renta variable**.
- 5 – El decisor de la entidad será informado por el miembro de mercado posteriormente, mediante un registro RC. Este código **solo aplica al mercado de renta variable**.

Campo 5. Código de ejecución dentro de la empresa

- 3 – Cliente, utilizable cuando la ejecución ha sido realizada directamente por el cliente. En este caso no es necesario remitir información posterior de identificación.
- 4 – Identificación del ejecutor dentro de la entidad mediante la “Referencia Cliente” informado en la orden. Cuando se informe este valor se utilizará el campo de

“Referencia Cliente” informado en la orden como vínculo con el registro RI-EW. Este código **solo aplica al mercado de renta variable**.

- 5 – El ejecutor de la entidad será informado por el miembro de mercado posteriormente mediante un registro RC. Este código **solo aplica al mercado de renta variable**.

Los miembros del mercado para completar y modificar la información correspondiente a sus órdenes registradas en el sistema de BME lo harán mediante los siguientes 4 tipos de registros:

1. Registro tipo CT – Cliente
2. Registro tipo DW – Decisor
3. Registro tipo EW – Ejecutor
4. Registro tipo DA – Datos adicionales
5. Registro tipo RC – Número de orden

Y contarán con dos modalidades de comunicación:

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

Registro tipo CT– Cliente
Registro tipo DW – Decisor
Registro tipo EW – Ejecutor
Registro tipo DA – Datos adicionales

- b) Vinculando la comunicación a una orden específica. Para ello, usarán el registro:

Registro RC – Número de orden

En el caso de que la información de las órdenes se quiera comunicar mediante los registros de códigos identificadores (CT, DW y EW), el miembro de mercado podrá realizarlo de tres formas utilizando las fechas de validez de los registros:

- Enviando los registros diariamente y BME se encargará de gestionar la información necesaria para completar la información de cada orden, 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 de ser iguales, indicando la fecha de las órdenes a las que se va a vincular esta información.
- Una única vez, en este caso se indica una fecha inicial, y una 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 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 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.

Las fechas de validez permiten definir la vigencia de la información que acompaña al registro Identificador (RI):

- Es obligatorio que se informe la fecha de validez inicial y final.
- Si la información comunicada es solamente para las operaciones de un día en concreto, 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, BME la mantendrá hasta la fecha de vigencia o hasta que se envíe otro registro RI que sustituya al anterior.
- 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 este registro.

2. Tipos de registro

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.

Registro CT – Cliente

El registro tipo CT está asociado al código corto del cliente, informado en el registro RI de cabecera, y permitirá informar masivamente del LEI o National ID del cliente en todas las ordenes con un determinado código de cliente para las fechas indicadas en el registro RI.

Tendrán la siguiente estructura:

| Nº | Campo | Dato | Descripción |
|----|---------------|-----------------------------------|--|
| 1 | TypeReg | RI | Tipo de registro de Código de Identificador. |
| 2 | Action | A- Alta/Modificación B-Baja | Indica la finalidad que tiene el registro RI. |
| 3 | ExctgPty | Identificador LEI | Código LEI de la entidad que introduce la orden |
| 4 | 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 | | Código corto o Referencia de Cliente informado en la orden para el cliente. |
| 8 | SubRegistro | CT | Indica que el tipo de registro es de CT. |
| 9 | PType | LEI, P | Tipo de identificación del cliente. |
| 10 | LEI | Identificador LEI | Si PType=LEI. Código LEI del cliente. |
| 11 | Prsn_SchmeNm | NIDN,CCPT, CONCAT | Si PType=Prsn. Tipo de identificación de la persona física. NIDN = National ID CCPT = número de pasaporte CONCAT = código CONCAT |
| 12 | Prsn_Id | National_ID | Si PType=Prsn. Código de identificación del cliente. |

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 o número de orden existan varios clientes (cotitularidad), deberán enviarse varios registros RI (uno para cada cotitular) en líneas separadas usando el mismo código identificador (si se utiliza RI). Cada registro RI-CT con el campo Action=A añade un cliente nuevo.

Para modificar la titularidad de todas las órdenes asociadas a un código corto será necesario enviar un registro CT con el campo Action=B, indicando la fecha de las ordenes que se van a ver afectadas y, posteriormente, un alta con la nueva información asociada a ese código corto cliente.

Si se envía un registro de “Baja” en un registro CT para el que se hubiera mandado cotitulares, BME dará de baja todos los cotitulares asociados a ese registro RI-CT para las fechas indicadas, 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.

Este registro no aplica a SENAF.

Registro DW – Decisión de inversión dentro de la empresa

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

Tiene la siguiente estructura:

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

| | | | |
|----|--------------|-------------|--|
| 12 | Dcsn_Othr_Id | National_ID | Si Dcsn_typePrsn='P'. National_ID de la persona que toma la decisión de la operación dentro del miembro. |
|----|--------------|-------------|--|

Registro EW – Ejecución dentro de la empresa

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

Tiene la siguiente estructura:

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

Registro RC – Número de orden

Este registro RC permite vincular la información por número de orden y contiene datos del cliente, decisor y ejecutor dentro del miembro, indicador DEA, capacidad de negociación e identificación de provisión de liquidez.

Este registro tiene prioridad sobre los registros RI, es decir, sobre escribe la información de una orden comunicada en un registro RI, pero un registro de

identificador RI no podrá reemplazar la información que ha sido comunicada en un registro RC.

| | Campo | Dato | Descripción | |
|--------------------------------|--------------------|---|--|---|
| Datos operación | 1 TypeReg | RC | Tipo de registro asociado a la corrección de una orden específica | |
| | 2 Action | A-Alta/Modificación B-Baja | Indica la finalidad que tiene el registro RC | |
| | 3 ExctPty | Identificador LEI | Código LEI de la entidad que introduce la orden | |
| | 4 TrdnVn | MIC | Código MIC del Segmento de Mercado donde se crea el registro | |
| | 5 TipoOrden | | ORD – Orden simple | Tipo de orden. Condiciona la validación del campo IdOrden |
| | | | QUO – Orden Quote | |
| | | | BLO – Operación a precio convenido | |
| | | | RFQ – Solicitud de volumen | |
| 6 IdOrden | | PLV – Posiciones a valor liquidativo | Número de la orden | |
| | | FON – Operativa de fondos | | |
| 7 Fecha | YYYY-MM-DD | Fecha de introducción de la orden | | |
| 8 BuySell | B-Buy S-Sell | Indicador de compra o venta | | |
| Titular de la operación | 9 PType | LEI, P, PNAL, AGGR, N | Tipo de identificación del comprador o vendedor: - LEI - P: Persona física - PNAL: Se desconoce el cliente de la orden - AGGR: Orden agregada - N: No hay cliente | |
| | 10 LEI | Identificador LEI | Si PType=LEI. Código LEI del cliente | |
| | 11 Prsn_SchmeNm | NIDN, CONCAT, CCPT | Si PType=Prsn. Tipo de identificación de la persona física | |
| | 12 Prsn_Id | National_ID | Si PType=Prsn. Código de identificación del cliente | |
| Decisor | 13 Dcsn_typePrsn | P-Person A-Algoritmo N-No existe decisor dentro de la empresa | Tipo de decisor | |
| | 14 Dcsn_Algo | Código del algoritmo | Si Dcsn_typePrsn='A'. Código del algoritmo que toma la decisión de la operación dentro del miembro | |
| | 15 Dcsn_Othr_SchNm | NIDN, CONCAT | Si Dcsn_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID | |
| | 16 Dcsn_Othr_Id | National_ID | Si Dcsn_typePrsn='P'. National_ID de la persona que toma la decisión de la operación dentro del miembro | |
| Ejecutor | 17 Exct_typePrsn | P-Person A-Algoritmo N- No existe ejecutor | Tipo de ejecutor de la operación dentro de la entidad | |

| | | | |
|--------------------------|--------------------|----------------------|--|
| | | dentro de la empresa | |
| | 18 Exct_Algo | Código del algoritmo | Si Exct_typePrsn='A'. Código del algoritmo que envía la orden al mercado dentro del miembro |
| | 19 Exct_Othr_SchNm | NIDN, CCPT, CONCAT | Si Exct_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID |
| | 20 Exct_Othr_Id | National_ID | Si Exct_typePrsn='P'. National_ID de la persona que envía la orden al mercado dentro del miembro |
| Datos adicionales | 21 DEA | 1/0 (True/False) | Indicador de acceso electrónico directo |
| | 22 TradCap | DEAL, MTCH, AOTC | Identificador de capacidad de negociación |
| | 23 LiqProvAct | 1/0 (True/False) | Indicador de actividad de provisión de liquidez |

Cuando se quiere utilizar el registro RC para informar de los clientes de una orden, existiendo cotitularidad en una orden, el miembro enviará tantos RC como clientes tenga la orden, con el campo Action=A, sin necesidad de volver a enviar los campos de ejecutor y decisor.

Si una vez mandados uno o varios titulares para una orden, se remitiese un registro RC marcando "N" en el campo (9) PType del cliente, se eliminarán todos los titulares remitidos hasta ese momento, quedando el dato de titular de la orden marcado con "N" (no hay cliente, es una operación de cuenta propia)

En el caso de que sea necesario modificar el decisor o el ejecutor de la orden, comunicado anteriormente, el miembro tendría que enviar un registro RC de alta informando del decisor y/o ejecutor que se quiere modificar, sin necesidad de completar los datos que se quieran mantener.

Si el decisor y ejecutor de la orden es el cliente (no hay decisor ni ejecutor dentro de la entidad) no se deben dejar estos campos vacíos, sino que se informará con un código "N" en los campos "Dcsn_typePrsn" y "Exct_typePrsn" (tipo de decisor y tipo de ejecutor) para indicar explícitamente que no existe decisor ni ejecutor dentro de la entidad. De esta manera, si los campos DecisorID y EjecutorID fueron informados con un 5 en la orden, el ORK no mostrará un mensaje de error pidiendo la información del decisor y ejecutor.

Los campos DEA, TradCap y LiqProvAct permiten modificar los campos Indicador DEA, la capacidad de negociación y el indicador de actividad de provisión de liquidez de la orden. En este caso no es necesario completar los campos de cliente, decisor y ejecutor. Solo se enviaría en el registro RC los datos identificativos de la operación y el dato que se va a modificar.

Sólo se pueden modificar mediante un registro RC aquellas órdenes que ya no están en el mercado.

El envío de un registro RC de baja causa la baja toda la información comunicada para esa operación. Por lo tanto, será necesario enviar un RC con toda la información de la operación de nuevo (titularidad, decisor y ejecutor).

Este registro no aplica a SENAF.

3. Validaciones

Tal y como se explicaba en la introducción del documento, los siguientes identificadores están predefinidos y fijados:

Campo 3, Código de identificación del cliente:

- 0 – No hay cliente en esta orden (es una orden de cuenta propia)
- 1 – Orden Agregada: asociado al flag “AGGR”.
- 2 – Orden pendiente de asignar: asociado al flag “PNAL”.
- 4 – Identificación del cliente mediante referencia cliente. **Solo aplica al mercado de renta variable.**
- 5 – El cliente se informará posteriormente mediante un registro RC. **Solo aplica al mercado de renta variable.**

Campo 4, Decisión de inversión dentro de la empresa:

- 0 – No hay decisión dentro de la empresa (la decisión se ha tomado fuera de la empresa).
- 4 – Identificación del decisor mediante referencia cliente. **Solo aplica al mercado de renta variable.**
- 5 – El decisor se informará posteriormente mediante un registro RC. **Solo aplica al mercado de renta variable.**

Campo 5. Código de ejecución dentro de la empresa

- 3 – Cliente, utilizable cuando la ejecución ha sido realizada directamente por el cliente.
- 4 – Identificación del ejecutor mediante referencia cliente. **Solo aplica al mercado de renta variable.**
- 5 – El ejecutor se informará posteriormente mediante un registro RC. **Solo aplica al mercado de renta variable.**

Los identificadores establecidos en los campos 3, 4 y 5 no son aplicables a SENAF que utilizará las especificaciones de su SAPI.

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

- (2) Direct Electronic Access (DEA)
- (3) Código de identificación del cliente
- (4) Código de decisión de inversión dentro de la empresa
- (5) Código de ejecución dentro de la empresa
- (7) Calidad en la que se actúa en la negociación
- (8) Actividad de provisión de liquidez

- › **Si la orden NO tiene cliente**, (el código corto del cliente es 0, la orden no tiene el cliente asociado al código corto, no se ha enviado un registro RC con el cliente o se ha enviado un registro RC con cliente "N"), entonces:
 - ✓ la orden debe tener un decisor: se ha enviado un DW asociado al código corto decisor o un RC informando con el decisor de la orden,
 - ✓ la (7) Calidad en la que se actúa en la negociación deberá ser DEAL o MTCH. En SENAF siempre será DEAL.

- › **Si la orden tiene cliente**, (se ha enviado un registro CT asociado al código corto de la orden o un RC con los datos del cliente distinto de "N"):
 - ✓ la capacidad de negociación (7) tiene que ser AOTC o MATCH.

- › Si la orden ha sido marcada como verdadero en (2) **Direct Electronic Access (DEA)**, entonces:
 - ✓ la orden tiene que tener cliente: se ha enviado un registro CT asociado al código corto de la orden o un RC con los datos del cliente distinto de "N",
 - ✓ la orden no puede tener decisor: el código corto del decisor es 0, la orden no tiene el decisor asociado al código corto, no se ha enviado un RC con el decisor o se ha enviado un RC con el decisor "N", y
 - ✓ la capacidad de negociación es AOTC o MTCH.

- › **Si la orden NO tiene ejecutor dentro de la entidad**, (la orden la ejecuta el cliente), es decir, el código corto del ejecutor es 3, la orden no tiene el ejecutor asociado al código corto, no se ha enviado un RC con el ejecutor o se ha enviado un RC con ejecutor "N"), entonces:
 - ✓ la orden tiene que tener cliente: se ha enviado un registro CT asociado al código corto de la orden o un RC con los datos del cliente distinto de "N",
 - ✓ la orden no puede tener decisor dentro de la entidad: el código corto del decisor es 0, la orden no tiene el decisor asociado al código corto, no se ha enviado un RC con el decisor o se ha enviado un RC con el decisor "N" y
 - ✓ la capacidad de negociación es AOTC.

4. Horario

Datos del Miembro hacia BME

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

A efectos de envío de ficheros, el proceso de consolidación de la información considerará que cada fichero enviado a partir de las 23:30h ha sido enviado al día siguiente.

Datos de BME hacia el miembro

1. Validación del fichero de entrada INB

Los miembros del mercado recibirán un fichero OUT con la contestación de cada fichero enviado, y el resultado de las validaciones que correspondan a él. El estado del fichero se indicará en un registro FI cuyos estados se describen en la Tabla 1 (pág. 19).

2. Primer fichero ORVB. Consolidación diaria:

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

3. Segundo fichero ORVB. Consolidación histórica:

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

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

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

5. Comunicaciones

Aspectos técnicos de los ficheros de entrada

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

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

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

Decimal Son campos numéricos donde se usa el carácter “.” (punto) para separar los decimales.
Para cifras negativas se incluye el signo ‘-’ a la izquierda del primer dígito significativo. No se puede sobrepasar los dígitos significativos especificados.

Date Son campos para informar fechas y tienen el formato YYYY-MM-DD

Datetime Se usan para expresar fechas y hora, seguirán el formato ISO 8601 YYYY-MM-DDThh:mm:ss.ffffffZ

Char Son campos texto que deben informarse con el número de caracteres especificados, rellenado con blancos a la derecha en caso de tener menos caracteres.

Varchar Son campos texto que pueden informarse con los caracteres que sean necesarios sin sobrepasar el máximo especificado.

Nomenclatura de los ficheros enviados por los Miembros

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

INB_LEI1_LEI2_TIPO_AAAAMMDD_SEQ.EXT_MD5

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

Este fichero contendrá los registros de los distintos tipos que se definen en este documento. El fichero estará comprimido.

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

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

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

Nomenclatura y formato de los ficheros del ORK hacia los Miembros

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

OUT_LEI1_LEI2_TIPO_AAAAMMDD_SEQ.EXT_MD5

- OUT (3) → OUTBOUND. Indica que es un fichero de salida.
- LEI1(20) → Código LEI del Miembro de mercado que realiza el envío.
- LEI2 (20) → Código LEI del Miembro de mercado por el que realiza el envío. Puede ser el mismo que el LEI1 en caso de que coincida.
- TIPO(4) → Tipo de fichero: **ORK y ORVB.**
- AAAAMMDD (8) → Fecha de generación del fichero.
- SEQ (3) → Secuencia de 3 dígitos. Ejemplo: 001
- EXT (3) → Extensión del fichero de texto plano .DAT que será comprimido en un fichero. ZIP
- MD5 (32) → Se incluirá el hash MD5 del fichero de 32 caracteres a continuación de la extensión para poder validar que el fichero es el mismo en origen y destino.

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

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

Registros FI

Este registro contiene información relativa al GLOBAL del fichero.

Su estructura es la siguiente:

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

| | | |
|----|---------------------|--------------------------------|
| 7 | TtINbOfRcrds | Número total de registros |
| 8 | stACTP | Número de registros aceptados |
| 9 | stPDNG | Número de registros pendientes |
| 10 | stRJCT | Número de registros rechazados |
| 11 | stRCVD | Número de registros recibidos |

Tabla 1:

| Estado | Nombre | Descripción |
|--------|--------------------|---|
| 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. |
| MISS | Missing records | El reporte ha sido aceptado, pero faltan registros. |

Registros VA

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

Los errores de tipo 200X solo se recibirán tras la consolidación de la información realizada a las 23:30h.

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

Su estructura es la siguiente:

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

Tabla de códigos de error:

| CODIGO | DEFINICION |
|-----------------|--|
| 2001 | Orders with this short code has not its associated information for this date |
| 2002 | This order has code 5 in Client field, but its information has not been submitted in a RC record. |
| 2003 | This order has code 5 in Decision field, but its information has not been submitted in a RC record. |
| 2004 | This order has code 5 in Executor field, but its information has not been submitted in a RC record. |
| 2011 | Order has no client, there has to be decision within the firm and capacity cannot be AOTC |
| 2012 | The order has a Client, capacity cannot be DEAL |
| 2013 | DEA order. There must be a Client, there is no Decision within the firm and capacity will have to be AOTC |
| 2014 | If Client executes the order, the holder cannot be the market member, there is not decision within firm and capacity has to be AOTC |
| 2015 | Client short code cannot be a number below 100 |
| 2016 | Decision maker short code cannot be a number below 100 |
| 2017 | Executor short code cannot be a number below 100 |
| 2101 | RC record cannot be associated to any order |
| 2102 | RC record has additional data fields that cannot amend an order that is still in the market and must be amended through the GUI |
| 2103 | DA record cannot be associated to any order |
| 2104 | DA record has additional data fields that cannot amend an order that is still in the market and must be amended through the GUI |
| 2105 | RI record cannot be associated to any order |
| 2106 | RI record has additional data fields that cannot amend an order that is still in the market and must be amended through the GUI |
| 2107 | RC record has found an order and has been consolidated correctly |
| 2108 | DA record has found orders and has been consolidated correctly |
| 2109 | RI record has found orders and has been consolidated correctly |
| ACPT | All orders information has been consolidated correctly |
| NOORDERS | No order has been submitted to the market |
| CON-048 | The value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers. |
| CON-074 | The format of the buyer identification code is incorrect |
| CON-077 | If person national identifier is used, only one of the following values can be populated: 'NIDN', 'CCPT', 'CONCAT' |
| CON-164 | The format of the seller code is incorrect |
| CON-168 | If LEI is used, the value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers. / If national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If MIC is used, the value should be a string of 4 characters (letters or numbers). / For internal, the 'INTC' code should be reported. |
| CON-297 | Only one of the following values can be populated: 'DEAL', 'MTCH', 'AOTC'. |
| CON-368 | The reported value should be a string of 4 characters (letters or numbers). / |
| CON-573 | If person national identifier is used, the first 2 characters of the national identification code should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date |
| CON-574 | The format of the executing person code is incorrect |
| CON-577 | If person national identifier is used, only one of the following values can be populated: 'NIDN', 'CCPT', 'CONCAT' |
| CON-578 | In case an algorithm identifier is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters (A- |

| | |
|----------------|--|
| | Z), numbers (0-9). |
| CON-590 | The national identification code does not include valid country code |
| CON-591 | The format of the executing person code is incorrect |
| CON-597 | If person national identifier is used, only one of the following values can be populated: 'NIDN', 'CCPT', 'CONCAT' |
| CON-598 | In case an algorithm identifier is used, the following characters are only allowed: capital Latin letters (A-Z), numbers (0-9). |
| CON-807 | Only 'B' or 'S' values allowed (Buy/Sell) |
| CON-857 | Only one of the following values can be populated: 'LEI', 'MIC', 'P', 'INTC' |
| CON-867 | Only one of the following values can be populated: 'LEI', 'P' |
| CON-897 | Data should be one of the following: P=Person; A=Algorithm |
| CON-907 | The format should be one of the following: P=Person; A=Algorithm |
| CON-917 | Only 'A' or 'B' values allowed (A-Registration/B-Deregistration) |
| CON-927 | Only one of the following values can be populated: 'LEI', 'P', 'PNAL', 'AGGR', 'N' |
| CON-937 | Only one of the following values can be populated: 'ORD', 'QUO', 'BLO', 'RFQ', 'PLV', 'FON' |
| CON-950 | Date time must be the same or before the system date time. |
| CON-951 | Trading date cannot be earlier than the agreed date of the first trading date to be reported under MiFIR or earlier than 5 years before the current date. |
| CON-967 | Only 'True' or 'False' values allowed |
| CON-977 | Only 'True' or 'False' values allowed |
| CON-987 | Only 'CT', 'DW' or 'EW' values allowed |
| CTR-046 | Submitting / Executing LEI not allowed by BME. Please check registration |
| CTR-070 | LEI XXX is not valid |
| CTR-071 | If person national identifier is used, the first 2 characters of the national identification code should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date |
| CTR-160 | If LEI is used, this field shall be populated with a LEI accurately formatted and in the LEI database included in the GLEIF database maintained by the Central Operating Unit. / 1. The status of the LEI shall be "Issued", "Lapsed", "Pending transfer" or "Pending archival". / 2. The InitialRegistrationDate of the LEI shall be equal or before the trading date. / 3. The EntityStatus shall be Active or if the EntityStatus is Inactive, the LastUpdateDate shall be equal or after the trading date. |
| CTR-161 | If national identifier is used, the first 2 characters of the national identification code should be an ISO 3166 country code that was valid at the trading date |
| CTR-701 | Deregistration Action. No Registration record was found or it was rejected |
| CTR-869 | This client has already been submitted |
| CTR-955 | Date must be a trading date |
| CTR-956 | Initial date can not be after Final Date |
| STA-001 | File containing the report has an incorrect filename. |
| STA-002 | File containing the report is corrupted. |
| STA-004 | Error Parser CSV. Comprobar que los delimitadores y que el fichero está codificado como UTF8 |
| STA-005 | Error in the de-encryption. Check you have used the BME public key. |
| STA-006 | File containing the report has an incorrect filename. LEI of the member sending the file |
| STA-007 | File containing the report has an incorrect filename. LEI of the member on behalf of which the file is being sent |
| STA-008 | File containing the report has an incorrect filename. File type |
| STA-009 | File containing the report has an incorrect filename. File communication date |
| STA-010 | File containing the report has an incorrect filename. Sequence |
| STA-011 | File containing the report has an incorrect filename. File extension DAT / XML |

| | |
|----------------|--|
| STA-012 | File containing the report has an incorrect filename. File extension gpg |
| STA-013 | File containing the report has an incorrect filename. MD5 |
| STA-014 | File containing the report has an incorrect filename. INBOUND |
| STA-015 | File containing the report has an incorrect filename. Content zip file |
| STA-016 | File containing the report has an incorrect filename. File extension zip |
| STA-045 | ExctgPty no coincide con el nombre del fichero |
| STA-971 | Wrong register type. |
| STA-990 | Record type does not exist |
| STA-991 | Number of fields in your register do not match with the requested. |
| STR-925 | RC record with no information added |
| STX-040 | ExctgPty. Field is mandatory |
| STX-042 | Field should be a text string of no more than 20 characters |
| STX-070 | Client identification. Field is mandatory |
| STX-072 | If LEI is used, the value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers. / If national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If MIC is used, the value should be a string of 4 characters (letters or numbers). / For internal, the 'INTC' code should be reported. |
| STX-073 | Field should be a text string of no more than 6 character |
| STX-160 | Client identification. Field is mandatory. |
| STX-162 | If LEI is used, the value should be a string of 20 characters where first 18 characters are capital letters or numbers and 2 last characters are numbers. / If national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If MIC is used, the value should be a string of 4 characters (letters or numbers). / For internal, the 'INTC' code should be reported. |
| STX-163 | Field should be a text string of no more than 6 character |
| STX-292 | Field should be a text string of no more than 4 characters |
| STX-360 | MIC code. Field is mandatory. |
| STX-362 | Field should be a text string of no more than 4 characters |
| STX-572 | If national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If algorithm identifier is used, the value should be a string of no more than 50 characters. |
| STX-573 | If person national identifier is used, it should be restricted to a passport number (use of code CCPT in the SchmeNm/Cd tag), other national identifier as defined in RTS Annex 2 (use of code NIDN in the SchmeNm/Cd tag) or CONCAT (use of proprietary with value CONCAT in the SchmeNm/Prtry tag). |
| STX-592 | If person national identifier is used, the value should be a string of no more than 35 characters. / If algorithm identifier is used, the value should be a string of no more than 50 characters. |
| STX-593 | If national identifier is used, it should be restricted to a passport number (use of code CCPT in the SchmeNm/Cd tag), other national identifier as defined in RTS Annex 2 (use of code NIDN in the SchmeNm/Cd tag) or CONCAT (use of proprietary with value CONCAT in the SchmeNm/Prtry tag). / |
| STX-760 | Shortcode. Field is mandatory. |
| STX-762 | The reported value should be a string of 20 characters |
| STX-800 | BuySell. Field is mandatory. |
| STX-802 | Field should be a text string of no more than 1 characters |
| STX-850 | Action. Field is mandatory. |
| STX-852 | Field should be a text string of no more than 4 characters |
| STX-862 | Field should be a text string of no more than 4 characters |
| STX-892 | Field should be a text string of no more than 1 characters |
| STX-900 | Decision maker type. Field is mandatory. |
| STX-902 | Field should be a text string of no more than 1 characters |

| | |
|----------------|---|
| STX-922 | Field should be a text string of no more than 1 characters |
| STX-930 | Order type. Field is mandatory. |
| STX-932 | Field should be a text string of no more than 3 character |
| STX-940 | OrderID. Field is mandatory. |
| STX-942 | Field should be a text string of no more than 12 character |
| STX-950 | Date. Field is mandatory. |
| STX-952 | Field must be populated with a valid date in the following format: YYYY-MM-DD |
| STX-962 | Field should be a text string of no more than 1 character |
| STX-972 | Field should be a text string of no more than 1 character |
| STX-980 | Shortcode type. Field is mandatory. |
| STX-982 | Field should be a text string of no more than 2 characters |

Registros VB

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

Su estructura es la siguiente:

| Nº | Campo | Dato | Descripción |
|----|-----------------|------------------------------|--|
| 1 | TypeReg | VB | Tipo de registro |
| 2 | Fecha | YYYY-MM-DD | Fecha de la orden cuya información está incompleta. |
| 3 | Tipo_Err | RI,RC | Indica si está incompleta por: <ul style="list-style-type: none"> • RI: se ha utilizado un identificador para el que no se han facilitado datos posteriores. • RC: se ha utilizado el código 5 predefinido y no se ha remitido posteriormente información de la orden. |
| 4 | Tipo_RI | CT, DW, EW | Si Tipo_Err='RI', informará sobre el tipo de identificador que es necesario remitir y no ha sido remitido |
| 5 | Tipo_Ord | ORD, QUO, BLO, RFQ, PLV, FON | Si Tipo_Err='RC' informará sobre el tipo de orden para la que no se ha remitido la información necesaria. |

| | | | |
|---|-------------------|-----------------|--|
| 6 | BuySell | B-Buy S-Sell | Si Tipo_Err='RC' informará sobre el sentido de la orden para la que no se ha remitido la información necesaria. (Solo si es RC). |
| 7 | Id | | Número de orden si es RC y código corto del registro si es RI. |
| 8 | ErrCd | | Código de Error |
| 9 | ErrDscrptn | | Descripción del error |

6. Correcciones

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

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

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

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

Campos susceptibles de ser modificados en una corrección

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

| Número de campo ORK | Descripción |
|---------------------|--|
| 2 | Direct Electronic Access (DEA) |
| 3 | Código de identificación del cliente |
| 4 | Decisión de inversión dentro de la empresa |
| 5 | Ejecución dentro de la empresa |
| 7 | Capacidad de negociación |
| 8 | Actividad de provisión de liquidez |

Los campos de DEA, identificación del cliente y capacidad de negociación no son modificables en el mercado SENAF.

Modalidad 1. Corrección masiva

Esta modalidad permite modificar masivamente todos los datos asociados a un código de identificación de cliente, decisor de inversión dentro de la empresa o ejecutor, para todas las órdenes en las que aquellos hayan estado implicados.

Para ello, será necesario que el miembro reenvíe el registro RI-DW o RI-EW con los datos pertinentes debidamente actualizados.

Este nuevo registro RI-DW o RI-EW con el mismo identificador y nueva descripción del decisor y/o ejecutor asociado, pasará a sustituir al anterior que se desea modificar.

En el caso del registro RI-CT, al poder existir cotitularidad en las órdenes, enviar un nuevo registro CT implica añadir un titular más en lugar de reemplazar el anterior, de manera que, sería necesario enviar un registro RI-CT de baja y otro de alta para modificar la anterior titularidad de la orden.

Adicionalmente, también será posible realizar una corrección masiva de los campos (2) Direct Electronic Access, (7) Capacidad de negociación y (8) Actividad de provisión de liquidez (en el caso de SENAF sólo se podrá modificar el campo 8). Para ello, se utilizará el formato de registro DA, vinculando un identificador de cliente (CT), decisor de inversión dentro de la entidad (DW) o Ejecución dentro de la entidad (EW). Esta vinculación producirá que todas las órdenes que utilicen el identificador escogido cambien sus valores para los campos 2, 7 y 8 antes mencionados, a los valores señalados en el registro DA.

Este registro, al estar destinado únicamente a realizar correcciones, no puede tener fechas futuras, en este caso sería rechazado.

Estructura del registro DA:

| Nº | Campo | Dato | Descripción |
|----|--------------------|-------------------|---|
| 1 | TypeReg | DA | Tipo de registro |
| 2 | ExctgPty | Identificador LEI | Código LEI de la entidad que introdujo las órdenes. |
| 3 | TrdnVn | MIC | Código MIC del Segmento de Mercado donde se crea el registro. Podrá utilizarse el carácter "*" (asterisco) para informar que el registro es válido para todos los MICs. |
| 4 | 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 |
| 5 | 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 |
| 5 | Type_Id_Ref | CT, DW, EW | Indica el tipo de identificador de referencia que se utilizará. |
| 6 | Id_Ref | | Número de identificador de referencia que se utilizará |
| 7 | DEA | 1,0 (True/False) | Indicador de acceso electrónico directo |
| 8 | TradCap | DEAL, MTCH, AOTC | Identificador de capacidad de negociación |
| 9 | LiqProvAct | 1,0 (True/False) | Indicador de actividad de provisión de liquidez. |

Modalidad 2. Corrección individual

Para corregir individualmente cualquiera de los datos susceptibles de ser modificados en una orden, el miembro deberá enviar un registro de alta de RC de una orden, para el decisor y ejecutor y los datos adicionales, y una baja y alta de RC para modificar la titularidad. Para más información del funcionamiento del registro RC ver capítulo 2.

7. Ejemplos

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

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

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

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

| Nº | Campo | REGISTRO RI-DW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300ASTRCPTXGNEI40 |
| 4 | MIC | XMRV |
| 5 | F_Inicial | 2018-04-01 |
| 6 | F_Final | 2018-04-01 |
| 7 | Identificador | 120 |
| 8 | SubRegistro | DW |
| 9 | Dcsn_typePrsn | P |
| 10 | Dcsn_Algo | |
| 11 | Dcsn_Othr_SchNm | CONCAT |
| 12 | Dcsn_Othr_Id | US19770912JONH#DEWIT |

| Nº | Campo | REGISTRO RI-EW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300ASTRCPTXGNEI40 |
| 4 | MIC | XMRV |
| 5 | F_Inicial | 2018-04-01 |
| 6 | F_Final | 2018-04-01 |
| 7 | Identificador | 125 |
| 8 | SubRegistro | EW |
| 9 | Exct_typePrsn | P |
| 10 | Exct_Algo | |
| 11 | Exct_Othr_SchNm | CONCAT |

| | | |
|-----------|--------------|----------------------|
| 12 | Exct_Othr_Id | HU19800413ADAM#JONES |
|-----------|--------------|----------------------|

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

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

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

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

| Nº | Campo | REGISTRO RI-CT |
|----|---------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300P0EH641RMF7T94 |
| 4 | MIC | XMRV |
| 5 | F_Inicial | 2018-08-01 |
| 6 | F_Final | 2018-08-01 |
| 7 | Identificador | 122 |
| 8 | SubRegistro | CT |
| 9 | PType | P |
| 10 | LEI | |
| 11 | Prsn_SchmeNm | CONCAT |
| 12 | Prsn_Id | FR19620604JEAN#COCTE |

| Nº | Campo | REGISTRO RI-EW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300P0EH641RMF7T94 |
| 4 | MIC | XMRV |
| 5 | F_Inicial | 2018-08-01 |
| 6 | F_Final | 2018-08-01 |
| 7 | Identificador | 159 |
| 8 | SubRegistro | EW |
| 9 | Exct_typePrsn | A |
| 10 | Exct_Algo | 123456789 |
| 11 | Exct_Othr_SchNm | |
| 12 | Exct_Othr_Id | |

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

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

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

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

| Nº | Campo | REGISTRO RI-CT |
|----|---------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 5493007EY8MYC8PNZP26 |
| 4 | MIC | XMRV |
| 5 | F_Inicial | 2018-04-01 |
| 6 | F_Final | 2018-04-01 |
| 7 | Identificador | 188 |
| 8 | SubRegistro | CT |
| 9 | PType | LEI |
| 10 | LEI | 123456123456123 |
| 11 | Prsn_SchmeNm | |
| 12 | Prsn_Id | |

| Nº | Campo | REGISTRO RI-DW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 5493007EY8MYC8PNZP26 |
| 4 | MIC | XMRV |
| 5 | F_Inicial | 2018-04-01 |
| 6 | F_Final | 2018-04-01 |
| 7 | Identificador | 114 |
| 8 | SubRegistro | DW |
| 9 | Dcsn_typePrsn | P |
| 10 | Dcsn_Algo | |
| 11 | Dcsn_Othr_SchNm | CONCAT |
| 12 | Dcsn_Othr_Id | ES12345678TRADER#UNO |
| Nº | Campo | REGISTRO RI-EW |

| | | |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 5493007EY8MYC8PNZP26 |
| 4 | MIC | XMRV |
| 5 | F_Inicial | 2018-04-01 |
| 6 | F_Final | 2018-04-01 |
| 7 | Identificador | 127 |
| 8 | SubRegistro | EW |
| 9 | Exct_typePrsn | A |
| 10 | Exct_Algo | ALGO12345 |
| 11 | Exct_Othr_SchNm | |
| 12 | Exct_Othr_Id | |

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

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

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

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

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

| Nº | Campo | REGISTRO RI-DW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300470IY7S220K805 |
| 4 | MIC | XMAD |
| 5 | F_Inicial | 2017-05-18 |
| 6 | F_Final | 2017-05-18 |
| 7 | Identificador | 222 |
| 8 | SubRegistro | DW |
| 9 | Dcsn_typePrsn | A |
| 10 | Dcsn_Algo | 1234ALGO |
| 11 | Dcsn_Othr_SchNm | |
| 12 | Dcsn_Othr_Id | |

| Nº | Campo | REGISTRO RI-EW |
|----|-----------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RI |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctgPty | 549300470IY7S220K805 |
| 4 | MIC | XMAD |
| 5 | F_Inicial | 2017-05-18 |
| 6 | F_Final | 2017-05-18 |
| 7 | Identificador | 333 |
| 8 | SubRegistro | EW |
| 9 | Exct_typePrsn | A |
| 10 | Exct_Algo | 456ALGO |
| 11 | Exct_Othr_SchNm | |
| 12 | Exct_Othr_Id | |

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

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

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

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

Posteriormente, la entidad X remite el siguiente registro RC.

| Nº | Campo | REGISTRO RC |
|----|---------------|----------------------|
| 1 | TypeReg | RC |
| 2 | Action | A |
| 3 | ExctPty | 5493007EY8MYC8PNZP26 |
| 4 | MIC | XMAD |
| 5 | TipoOrden | ORD |
| 6 | IdOrden | 12377412 |
| 7 | Fecha | 2018-02-01 |
| 8 | BuySell | B |
| 9 | PType | P |
| 10 | LEI | |
| 11 | Prsn_SchmeNm | NIDN |
| 12 | Prsn_Id | ES456789V |
| 13 | Dcsn_typePrsn | N |
| 14 | Dcsn_Algo | |

| | | |
|----|-----------------|-----------|
| 15 | Dcsn_Othr_SchNm | |
| 16 | Dcsn_Othr_Id | |
| 17 | Exct_typePrsn | A |
| 18 | Exct_Algo | ALGO12345 |
| 19 | Exct_Othr_SchNm | |
| 20 | Exct_Othr_Id | |
| 21 | DEA | |
| 22 | TradCap | |
| 23 | LiqProvAct | MTCH |

ANEXO 1: Formato de Campos

Formato registro RI. Registro por Identificador

| Nº | RTS 22 | Campo | Tipo | Long | Dato |
|----|--------|-------------|-------|------|---|
| 1 | | TypeReg | Char | 2 | RI |
| 2 | | Action | Char | 1 | A- Alta/Modifica ción B-Baja |
| 3 | 4 | ExctgPty | Char | 20 | Código LEI de la entidad que ejecuta la operación. |
| 4 | 36 | MIC | 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 CT DcsnwFirm cuando el subregistro es de tipo DW (todos) ExctwFirm cuando el subregistro es de tipo EW (todos) |
| 8 | | SubRegistro | Char | 2 | Indica el tipo de registro que esta cabecera antecede CT, DW o EW |

Formato SubRegistro CT de Clientes

| Nº | 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_Schme Nm | Char | 6 | Si PType=P. Tipo de identificación de la persona física. NIDN,CCPT, CONCAT |
| 5 | 7,16 | Prsn_Id | Char | 35 | Si PType=P. Código de identificación del cliente. DNI para España |

Formato SubRegistro DW de decisores "within the firm"

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

s a
n r
-
C
t
h
r
-
l
d

Formato SubRegistro EW de ejecutores "within the firm"

| Nº | RTS 22 | Campo | T L i o p n o g | Dato |
|----|--------|-----------------|----------------------------|--|
| 1 | | SubRegistro | C h a r 2 | EW |
| 2 | 59 | Exct_typePrsn | C h a r 1 | P-Person A-Algoritmo C-Client |
| 3 | 57 | Exct_Algo | C h a r 5 | Si Exct_typePrsn='A'. Código del algoritmo que ejecuta la operación dentro de la entidad. |
| 4 | 59 | Exct_Othr_SchNm | C h a r 6 | Si Dcsn_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID |
| 6 | 59 | Exct_Othr_Id | C h a r 3 5 | Si Dcsn_typePrsn='P'. National_ID de la persona que envía la orden al mercado dentro del miembro ejecutor. |

Formato Registro RC – Número de orden

| | Campo | Tipo | Long | Dato |
|--------------------------------|--------------------|-------------|-------------|--|
| Datos operación | 1 TypeReg | Char | 2 | RC |
| | 2 Action | Char | 1 | A-Alta/Modificación B-Baja |
| | 3 ExctPty | Char | 20 | Identificador LEI |
| | 4 TrdnVn | Char | 4 | MIC |
| | 5 TipoOrden | Char | 3 | ORD – Orden simple QUO – Orden Quote BLO – Operación a precio convenido RFQ – Solicitud de volumen PLV – Posiciones a valor liquidativo FON – Operativa de fondos |
| | 6 IdOrden | Char | 52 | |
| | 7 Fecha | Char | 10 | YYYY-MM-DD |
| | 8 BuySell | Char | 1 | B-Buy S-Sell |
| Titular de la operación | 9 PType | Char | 4 | LEI, P, PNAL, AGGR, N |
| | 10 LEI | Char | 20 | Identificador LEI |
| | 11 Prsn_SchmeNm | Char | 6 | NIDN, CONCAT, CCPT |
| | 12 Prsn_Id | Char | 35 | National_ID |
| Decisor | 13 Dcsn_typePrsn | Char | 1 | P-Person A-Algoritmo N-No existe decisor dentro de la empresa |
| | 14 Dcsn_Algo | Char | 50 | Código del algoritmo |
| | 15 Dcsn_Othr_SchNm | Char | 6 | NIDN, CONCAT |
| | 16 Dcsn_Othr_Id | Char | 35 | National_ID |
| Ejecutor | 17 Exct_typePrsn | Char | 1 | P-Person A-Algoritmo N-No existe ejecutor dentro de la empresa |
| | 18 Exct_Algo | Char | 50 | Código del algoritmo |
| | 19 Exct_Othr_SchNm | Char | 6 | NIDN, CCPT, CONCAT |
| | 20 Exct_Othr_Id | Char | 35 | National_ID |
| Datos adicionales | 21 DEA | Char | 1 | 1/0 (True/False) |
| | 22 TradCap | Char | 4 | DEAL, MTCH, AOTC |
| | 23 LiqProvAct | Char | 1 | 1/0 (True/False) |

Formato Registro DA – Registro de modificación de datos adicionales

| Nº | Campo | Tipo | Long | Dato |
|-----------|--------------|-------------|-------------|-------------------|
| 1 | TypeReg | Char | 2 | DA |
| 2 | ExctgPty | Char | 20 | Identificador LEI |
| 3 | TrdnVn | Char | 4 | Código MIC |
| 4 | F_Inicial | Char | 10 | YYYY-MM-DD |
| 5 | F_Final | Char | 10 | YYYY-MM-DD |
| 6 | Type_Id_Ref | Char | 2 | CT / DW / EW |
| 7 | Id_Ref | Int32 | | Shortcode |
| 8 | DEA | Char | 2 | 1,0 (True/False) |
| 9 | TradCap | Char | 4 | DEAL, MTCH, AOTC |
| 10 | LiqProvAct | Char | 20 | 1,0 (True/False) |