

COMUNICADO 25/17

Fecha: 30 de junio de 2017

Asunto: Order Record Keeping y nuevos campos en las órdenes y códigos cortos

El Reglamento (UE) n. 600/2014 (MiFIR), en 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 especifica los datos asociados a cada orden que deben ser guardados.

En base a estas obligaciones, los nuevos datos necesarios que deben ser comunicados en cada orden y en cada operación acordada, deben ser:

Número y nombre del campo	Descripción
(2) Acceso Electrónico Directo (DEA por sus siglas en inglés)	Informa sobre si la orden procede de una conexión de Acceso Electrónico Directo o no.
(3) Código de identificación del cliente	Código utilizado para identificar al cliente del miembro o participante del centro de negociación. Será: <ul style="list-style-type: none"> • LEI. Si es una entidad jurídica. • National_ID. Si una persona física. • AGGR. Si es una orden agregada. • PNAL. Si es una orden pendiente de asignación.
(4) Decisión de inversión dentro de la empresa	Código utilizado para identificar a la persona o el algoritmo en el miembro o participante del centro de negociación que es responsable de la decisión de inversión.
(5) Ejecución dentro de la empresa	Código utilizado para identificar a la persona o algoritmo en el miembro o participante del centro de negociación que es responsable de la ejecución de la operación derivada de la orden.
(7) Calidad en la que se actúa en la negociación	Indica si la orden es: <ul style="list-style-type: none"> • Con interposición de la cuenta propia (MTCH) • Por cuenta propia (DEAL). • Otros (AOTC).
(8) Actividad de provisión de liquidez	Si es de creador de mercado

Los campos 3, 4 y 5 deber ser comunicados en la orden mediante una clave numérica (Short Code), tal y como se avanzó en el Comunicado 09/17.



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

3. Código de identificación del cliente

- 0 – Orden por cuenta propia.
- 1 – Orden Agregada. Asociada al flag “AGGR”.
- 2 – Orden pendiente de asignar. Asociada al flag “PNAL”.

4. Código de decisor de inversión dentro de la empresa

- 0 – La decisión se toma fuera de la empresa.

5. Código de ejecución dentro de la empresa

- 3 – Cuando la ejecución ha sido realizada directamente por el cliente.

Los códigos predefinidos 4 y 5 (ver documento adjunto) no podrán ser utilizados en MEFF.

Los miembros de mercado enviarán a BME por fuera del sistema de negociación la lista de claves numéricas y su correspondencia con la información necesaria en cada campo. Para este fin, BME pondrá a disposición del mercado un sistema de comunicación de ficheros para el registro de órdenes.

Se adjunta a este comunicado un documento completo donde se detalla el funcionamiento y estructura de las comunicaciones necesarias para facilitar estos ficheros.

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