

COMUNICADO 08/17

Fecha: 06 de abril de 2017

Asunto: Transaction Reporting

De cara a la entrada en vigor de la normativa MiFID II, prevista para el 3 de enero de 2018, BME pone a disposición de los miembros de Mercado el servicio de Comunicación de Operaciones a la Autoridad Competente, adaptándolo a los requisitos de la nueva normativa.

La contratación de este servicio permite a los miembros de Mercado facultar los mercados de BME para generar sus ficheros de operaciones conforme a la normativa, y enviarlos en su nombre a la CNMV u otra Autoridad Competente europea si así correspondiera.

El alcance del servicio se extiende al conjunto de la operativa de mercado realizada en las plataformas de negociación de BME por los miembros de Mercado ya sea por cuenta propia o por cuenta de clientes. Para las operaciones de desglose de órdenes agregadas, las rectoras ofrecerán un servicio de comunicación a través del ARM de BME.

Los Sistemas de Negociación de los mercados de BME disponen de gran parte de la información para la comunicación de operaciones, pero será necesario que los miembros del Mercado la completen.

La información adicional será la siguiente:

- Registro Cliente

Incluye los datos necesarios para la identificación de todos los titulares asociados a un código de cliente. Cada cliente puede tener asociado solo un tomador de decisión y solo un registro de transmisión.

- Registro Decisores Dentro de la Empresa

Identifica a todos aquellos algoritmos o personas físicas que desde dentro de la empresa pueden tomar la decisión de compra o venta de un activo para un tercero o para la cuenta propia del miembro.

- Registro Ejecutores Dentro de la Empresa

Identifica a todos aquellos algoritmos o personas físicas que desde dentro de la empresa, pueden ejecutar la compra o venta de un activo para un tercero o para la cuenta propia del miembro.

- Registro de Tomadores de Decisión

Identifica a la persona, física o jurídica, que toma la decisión de compra o venta de un activo para un tercero (cliente). Está asociado al registro de cliente.

- Registro de Cadenas de Transmisión

Identifica los casos en los que la orden que ha dado lugar a la operación fue transmitida (con arreglo al artículo 4 del RTS 22) de una entidad a otra que finalmente la ejecutó. Está asociado al registro de cliente.

La adhesión al servicio de Comunicación de Operaciones requiere por parte del miembro de Mercado el desarrollo de los formatos necesarios para el envío de la información adicional. Esta información se recogerá a través de las comunicaciones que los miembros ya realizan con los mercados y a través de unos ficheros de texto plano predefinidos.

BME informará al miembro de Mercado el siguiente día laborable al de la fecha de la operación, de todas las operaciones susceptibles de ser comunicadas que no hayan superado los procesos de validación de la CNMV o que estén incompletas. Para cumplir con las obligaciones de comunicación, será responsabilidad del miembro cumplimentar los datos necesarios para que los registros estén completos, añadiendo registros si fuera necesario, y superando los procesos de validación.

BME facilitará más información sobre este servicio, especificaciones técnicas y tarifas, en la primera quincena del mes de mayo.