



Order Record Keeping

Versión 2.0

10 de enero de 2020

Índice

1. Introducción	3
Datos en la orden.....	5
Short codes o uso de Códigos de identificación.....	6
Gestión histórica de la Base de Datos ORK.....	7
2. Tipos de registro	10
Cambios en los registros CT, DW y EW respecto a la versión anterior.....	10
Registro CT – Cliente.....	10
Registro DW – Decisión de inversión dentro de la empresa.....	12
Registro EW – Ejecución dentro de la empresa.....	13
Registro RC – Número de orden.....	14
3. Validaciones	17
4. Horario	19
Datos del Miembro hacia BME.....	19
Datos de BME hacia el miembro.....	19
5. Comunicaciones	20
Aspectos técnicos de los ficheros de entrada.....	20
Nomenclatura de los ficheros enviados por los Miembros.....	20
Nomenclatura y formato de los ficheros del ORK hacia los Miembros.....	21
Limite en el tamaño de los ficheros de respuesta ORK y ORVB:.....	21
Registros FI.....	22
Registros VA.....	22
Registros VB.....	27
Ficheros SHCD.....	28
6. Correcciones	30
Campos susceptibles de ser modificados en una corrección.....	30
Método de actuación.....	30
7. Ejemplos	32
Ejemplo 1. Se corresponde con el ejemplo 43 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452.....	32
Ejemplo 2. Se corresponde con el ejemplo 82 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452.....	33
Ejemplo 3. Se corresponde con el ejemplo 65 de los Guidelines de ESMA. Documento codificado como ESMA/2016/1452.....	34
Ejemplo 4. Orden de renta variable agregada informando de referencia titular.....	35
Ejemplo 5. Informar una operación individualmente mediante el registro RC.....	36
ANEXO 1: Formato de Campos	38
Formato registro RI. Registro por Identificador.....	38
Formato SubRegistro CT de Clientes.....	38
Formato SubRegistro DW de decisores “within the firm”.....	39
Formato SubRegistro EW de ejecutores “within the firm”.....	39
Formato Registro RC – Número de orden.....	40

Modificaciones al documento versión 2.0

- Las ordenes ya no pueden ser modificadas con un registro DA (pág. 8)
- Se elimina la funcionalidad de las fechas y MIC de los registros RI (pág. 7). Los registros CT, DW y EW ya no necesitan tener los campos "F_inicio", "F_Fin" ni "TrdnVn" informados (pág. 9 y 10)
- Modificaciones en las altas y bajas de información con registros RI. (pág. 10, 11 y 12)
- Gestión histórica de datos: Area histórica e Histórico ORK. Registros que están admitidos y cuales son rechazados (pág. 10)
- Ficheros SHCD: códigos cortos enviados al área histórica (pág. 28)
- Límite de número de mensajes en los ficheros de respuesta (pág. 21).

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
Capacidad 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, 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
Capacidad en la que se actúa en la negociación y provisión de liquidez	
7	Capacidad 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.

Estos campos serán remitidos en la orden utilizando números enteros entre 100 y 4.294.967.295 ($2^{32}-1$) (ambos inclusive). 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 tener un significado predefinido, no será necesario remitir información complementaria que explique su significado (archivos RI o RC explicados más adelante).

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**.

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 RC – Número de orden

Estos registros se agrupan en dos modalidades de comunicación:

- a) Mediante la utilización de los códigos de cliente, decisor y/ o 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

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

Registro RC – Número de orden

Gestión histórica de la Base de Datos ORK

La gestión histórica de los datos del ORK consiste en una separación de la base de datos, cuya finalidad es lograr una mayor eficiencia y racionalización de la información recibida desde los miembros del mercado que, además, redunde en el proceso de consolidación diario de las órdenes introducidas en los mercados, así como en el proceso de consolidación de datos históricos.

La base de datos del ORK está dividida en dos áreas:

- **Área de trabajo:**
 - Órdenes del mes en curso y el mes anterior, independientemente de que estén completas o no.
 - Órdenes vivas de cualquier período, estén completas o no.
 - Órdenes de cualquier fecha que aún no estén completamente informadas.
- **Histórico ORK:**
 - Órdenes anteriores al día 1 del mes pasado correctamente informadas y que no están vivas.

A fin de realizar esta división, cada fin de mes se va a realizar un movimiento de órdenes y códigos cortos al Histórico ORK:

- **Órdenes:** se moverán al Histórico ORK todas aquellas órdenes anteriores al día 1 del mes anterior, que hayan quedado correctamente informadas y no estén vivas.

- **Códigos cortos:** se moverán al Histórico ORK todos los códigos cortos utilizados en alguna orden enviada al Histórico ORK. Se va a informar mediante un fichero de tipo SHCD

A continuación, se muestran ejemplos del movimiento de órdenes que se realizaría el 31 de julio de 2019:

1. Orden posterior al día 1 del mes previo, que no está completa.

NUM. ORDEN	FECHA ORDEN	VIVA	CORRECTA	HISTÓRICO
100000001	25/06/2019	NO	NO	NO

La orden 100000001 tanto por ser posterior al día 1 del mes previo como por no estar completamente informada **no se enviará al área histórica, sino que se mantendrá en el área de trabajo.**

2. Orden anterior al día 1 del mes previo, que no está completa

NUM. ORDEN	FECHA ORDEN	VIVA	CORRECTA	HISTÓRICO
100000002	10/05/2019	NO	NO	NO

La orden 100000002 aunque es anterior al mes en curso, no está completa, por lo tanto, **no se puede enviar al área histórica y se mantendrá en el área de trabajo.**

3. Orden del mes en curso que ya ha sido informada

NUM. ORDEN	FECHA ORDEN	VIVA	CORRECTA	HISTÓRICO
100000003	25/07/2019	NO	SI	NO

La orden 100000003 aunque ya está completa, al ser posterior al día 1 del mes previo, **no se envía al área histórica y se mantendrá en el área de trabajo.**

4. Orden anterior al día 1 del mes previo, que ya ha sido informada y no está viva.

NUM. ORDEN	FECHA ORDEN	VIVA	CORRECTA	HISTÓRICO
100000004	17/03/2019	NO	SI	SI

La orden 100000004, que ya está completa, y al no ser del mes previo ni actual, ni estar viva, **se envía al área histórica.**

5. Orden anterior al mes en previo, que está informada y, además está **VIVA en el mercado.**

NUM. ORDEN	FECHA ORDEN	VIVA	CORRECTA	HISTÓRICO
100000005	10/01/2018	SI	SI	NO

La orden 100000005, aunque es anterior al día 1 del mes previo y ya está informada, al estar viva en el mercado, **no se envía al área histórica y se mantendrá en el área de trabajo.**

6. Orden anterior al mes previo, que no está completa y además está **VIVA en el mercado**.

NUM. ORDEN	FECHA ORDEN	VIVA	CORRECTA	HISTÓRICO
100000006	21/05/2019	SI	NO	NO

La orden 100000005, aunque es anterior al día 1 del mes previo, tanto por no estar informada como por estar viva en el mercado, **no se envía al área histórica y se mantendrá en el área de trabajo**.

2. Tipos de registro

Cambios en los registros CT, DW y EW respecto a la versión anterior

En el caso de que la información de las órdenes se quiera comunicar mediante los registros de códigos cortos (CT, DW y EW), el miembro de mercado deberá tener en cuenta el nuevo funcionamiento de los registros RI, el cual supone una simplificación respecto de la versión anterior:

- **Se ha eliminado la funcionalidad de los campos de fecha** “F_Inicial” y “F_Final”, suponiendo una mayor simplicidad en el envío y gestión de la información. No obstante, la estructura del fichero queda sin modificar, por lo que esos campos deberán ir vacíos (en caso de contener información no será utilizada).

La eliminación de la funcionalidad de las fechas implica que la información de los códigos cortos enviada mediante los registros CT, DW y EW **tendrá una vigencia permanente**.

- **El campo “TrdnVn”** (código MIC del mercado) **dejará de tener funcionalidad**. Por tanto, la información asociada a los códigos cortos enviada en los registros CT, DW y EW se aplicará a todos los mercados (teniendo el mismo efecto que cuando se informaba este campo con un asterisco “*” en la versión anterior). La estructura del fichero queda sin modificar, por lo que este campo deberá ir vacío (en caso de contener información no será utilizada).

En consecuencia, la información enviada mediante registros CT, DW y EW implica dar de **alta la información para todos los mercados de BME**.

- La información se podrá dar de baja tal y como se hace actualmente para los registros del Área de Trabajo, enviando el correspondiente registro CT, DW o EW de baja. La baja implica eliminar la información asociada al código corto, dejándolo vacío sin información.

Solo se podrán realizar bajas de información de un código corto (CT, DW y EW) no utilizado en órdenes ubicadas en el Histórico ORK. Las solicitudes de baja de registros RI utilizados en el Histórico ORK serán rechazadas.

- Se informará de que códigos se han movido al Histórico ORK mediante los ficheros de tipo SHCD.
- **Eliminación de registros innecesarios:** Cada fin de mes se eliminarán aquellos registros RI que, enviados en los últimos dos meses, que no se hayan utilizado nunca en ninguna orden.

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.

Tendrán la siguiente estructura:

Nº	Campo	Dato	Descripción
1	TypeReg	RI	Tipo de registro de Código de Identificador.
2	Action	A-Alta/ añadir titular B-Baja	Indica la finalidad que tiene el registro RI.
3	ExctgPty	Identificador LEI	Código LEI de la entidad que introduce la orden
4	Vacío		
5	Vacío		
6	Vacío		
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_Schme Nm	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 primer envío de un registro RI-CT implica dar de alta la información del cliente de un código corto, para todos los mercados desde el inicio del ORK y hasta 31-12-9999

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) en el mismo fichero. Si los registros RI-CT fueran entregados en distintos ficheros, se considerará que la última entrega sustituye a las anteriores.

Cuando se envía un registro RI-CT, con un código corto de cliente que ya había sido informado previamente en otro fichero, la información del nuevo RI-CT sustituirá a la del anterior a partir del día en de este envío.



En el caso de que la información enviada en un registro RI-CT asociada a un código corto sea la misma que la información que el sistema ya tiene para ese código corto, el nuevo registro RI-CT será rechazado (al ser redundante).

Para modificar la titularidad de todas las órdenes asociadas a un código corto será necesario enviar un registro CT con el campo Action=B y, posteriormente, un alta con la nueva información asociada a ese código corto cliente. Esto implica dar de baja el RI-CT entero, eliminando la información del cliente de las órdenes, y posteriormente asociar la nueva información a las mismas órdenes y a las futuras, con este código corto cliente.

Si se envía un registro de “Baja” de un registro CT para el que se hubiera mandado cotitulares, BME dará de baja todos los cotitulares asociados a ese registro RI-CT, es decir, en registros de cotitularidad no será posible dar de baja uno solo de los titulares, sino que se darán de baja todos con un solo registro de baja, y se enviará de nuevo la lista correcta de titulares.

La baja de un registro RI-CT de un código corto de cliente que haya sido utilizado en el Histórico ORK será rechazada.

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	Vacío		
5	Vacío		
6	Vacío		
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_Sc hNm	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.

El primer envío de un registro RI-DW implica dar de alta la información del decisor de un código corto, para todos los mercados desde el inicio del ORK y hasta 31-12-9999.

Cuando se envía un registro RI-DW, con un código corto de decisor que ya había sido informado previamente en otro fichero, la información del nuevo RI-DW sustituirá a la del anterior a partir del día en de este envío.

En el caso de que la información enviada en un registro RI-DW asociada a un código corto sea la misma que la información que el sistema ya tiene para ese código corto, el nuevo registro RI-DW será rechazado (al ser redundante).

La información enviada previamente en registros RI-DW de alta se puede dar de baja con registros RI-DW con el campo Action="B". Esto implica eliminar la información enviada anteriormente para ese código corto, por lo que el siguiente envío de un RI-DW se considerará como el primer envío de la información, es decir, se aplicará la información para todas las fechas en lugar de solo desde la fecha de envío

La baja de un registro RI-DW de un código corto de decisor que haya sido utilizado en el Histórico ORK será rechazada.

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	Vacío		
5	Vacío		
6	Vacío		
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.

El primer envío de un registro RI-EW implica dar de alta la información del ejecutor de un código corto, para todos los mercados desde el inicio del ORK y hasta 31-12-9999.

Cuando se envía un registro RI-EW, con un código corto de ejecutor que ya había sido informado previamente en otro fichero, la información del nuevo RI-EW sustituirá a la del anterior a partir del día en de este envío.

En el caso de que la información enviada en un registro RI-EW asociada a un código corto sea la misma que la información que el sistema ya tiene para ese código corto, el nuevo registro RI-EW será rechazado (al ser redundante).

La información enviada previamente en registros RI-EW de alta se puede dar de baja con registros RI-EW con el campo Action="B". Esto implica eliminar la información enviada anteriormente para ese código corto, por lo que el siguiente envío de un RI-EW se considerará como el primer envío de la información, es decir, se aplicará la información para todas las fechas en lugar de solo desde la fecha de envío

La baja de un registro RI-EW de un código corto de ejecutor que haya sido utilizado en el Histórico ORK será rechazada.

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, sobrescribe 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 QUO – Orden Quote BLO – Operación a precio convenido RFQ – Solicitud de volumen PLV – Posiciones a valor liquidativo FON – Operativa de fondos	Tipo de orden. Condiciona la validación del campo IdOrden.
	6	IdOrden		Número de la orden.
	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=P. Tipo de identificación de la persona física
	12	Prsn_Id	National_ID	Si PType=P. 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, CCPT	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 dentro de la empresa	Tipo de ejecutor de la operación dentro de la entidad.
	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 ni datos adicionales. Para informar de una cotitularidad mediante registros RC, es necesario que los registros RC con la información de los clientes esté en el mismo fichero. El envío de registros RC con datos de clientes en un nuevo fichero implica reemplazar el cliente o los clientes enviados en un fichero anterior.

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 sobrescribirán todos los titulares remitidos hasta ese momento, quedando el dato de titular de la orden marcado con "N" (no hay cliente, es una orden 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 el resto de campos del registro RC. Al tratarse de decisores y ejecutores, que solo puede haber uno en la orden y no se pueden sumar, el último enviado, esté en el mismo fichero o en uno diferente, reemplazará al enviado anteriormente.

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 o tienen un código corto erróneo, el ORK no mostrará un mensaje de error pidiendo la información del decisor y ejecutor.

Los campos DEA, TradCap y LiqProvAct son datos adicionales que viajan en la orden y no es necesario que se informen en los registros RC. Solo es necesario enviarlos si se desea modificar los campos de Indicador DEA, la capacidad de negociación y el indicador de actividad de provisión de liquidez de la orden. En este caso no sería necesario completar los campos de cliente, decisor y ejecutor. Solo se enviaría en el registro RC los datos identificativos de la orden y el dato que se va a modificar. **Si una orden está viva, los datos adicionales solo se pueden modificar desde el mercado**, en caso de que se envíe un registro RC con información en alguno de los campos adicionales, el registro será rechazado.

El envío de un registro RC con el campo Action="B" causa la baja toda la información que ha sido previamente comunicada con un RC de alta. Por lo tanto, será necesario enviar un RC con toda la información de la orden de nuevo (titularidad, decisor y ejecutor).

Solo se pueden enviar registros RC de alta y baja para órdenes que están en el área de trabajo. En caso de enviar registros RC para ordenes contenidas en el Histórico ORK, se rechazará el registro RC.

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.**

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) Capacidad en la que se actúa en la negociación
 - (8) Actividad de provisión de liquidez
- › **Validación 1 - La orden NO tiene cliente**, es decir: el código corto del cliente es 0, la orden no tiene el cliente asociado al código corto, no se ha enviado un RC con el cliente o se ha enviado un RC con el 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) Capacidad en la que se actúa en la negociación deberá ser DEAL o MTCH.

- › **Validación 2 - La orden tiene cliente**, es decir: el código del cliente es 1 (“AGGR”) o 2 (“PNAL”), se ha enviado un registro CT asociado al código corto de la orden, un RC con los datos del cliente o el flag “AGGR” o “PNAL”, entonces:
 - ✓ la capacidad de negociación (7) tiene que ser AOTC o MATCH

- › **Validación 3:** Si la orden ha sido marcada como verdadero en (2) **Direct Electronic Access (DEA)**, entonces:
 - ✓ La orden debe tener cliente: el código del cliente es 1 (“AGGR”) o 2 (“PNAL”), se ha enviado un registro CT asociado al código corto de la orden, un RC con los datos del cliente o el flag “AGGR” o “PNAL”
 - ✓ 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

- › **Validación 4: La orden NO tiene ejecutor dentro de la entidad**, (la orden 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 debe 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”.
 - ✓ 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, los ficheros recibidos después del inicio del proceso de consolidación se considerarán enviados al día siguiente, incluyéndose en el proceso de consolidación del 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. 21)

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 ordenes 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 23:30 y 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: **DAT**
- MD5 (33) → Se puede incluir 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. Cada fichero .DAT estará comprimido en un fichero .ZIP.

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 a los pocos minutos, indicando si el fichero fue incorporado satisfactoriamente.

El proceso de carga de ficheros INB realizará las siguientes validaciones antes de procesar la información

- **Ficheros con nomenclatura repetida:** Si se envía un fichero con un nombre idéntico al de otro fichero enviado previamente se renombrará el fichero enviado en la carpeta *filesin* del SFTP, añadiendo el prefijo "REP_" y dicho fichero no se procesará.
- **Ficheros con el mismo contenido:** Si se envía un fichero cuyo contenido es idéntico al de otro ya enviado se renombrará el fichero enviado, en la carpeta *filesin* del SFTP, añadiendo el prefijo "MD5_" y dicho fichero no se procesará.

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, ORVB y SHCD**
- AAAAMMDD (8) → Fecha de generación del fichero.
- SEQ (3) → Secuencia de 3 dígitos. Ejemplo: 001
- EXT (3) → Extensión del fichero: **CSV**
- MD5 (33) → Se puede incluir 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 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.

Limite en el tamaño de los ficheros de respuesta ORK y ORVB:

Los ficheros de respuesta mostrarán hasta un máximo de 10 mil mensajes. Si debido al número de errores, se superara este límite, en la última línea se mostrará un mensaje informando que el número de errores supera el límite del fichero:

“There are errors that are not displayed. Number of messages has exceeded the limit”

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 INB enviado por el miembro
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:

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
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 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			Vacío
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
1055	DA record Ending Date must be prior to D-1
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	The RC register does not match with any order available in the current Data Base
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
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
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-078	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-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-362	Not authorised MIC
CTR-701	Deregistration Action. No Registration record was found or it was rejected
CTR-761	Field should be a text string of no more than 10 characters
CTR-763	Short code. RI short code cannot be a number below 100
CTR-764	Field should not be greater than 4.294.967.295
CTR-765	Wrong client short code, please submit a RC record to provide client information
CTR-766	The RI register has been used in orders previous to the current Data Base
CTR-869	This client has already been submitted
CTR-900	Short code not allowed, it must be above 100
CTR-900	Short code not allowed, it must be above 100
CTR-911	Deregistration Action. No Registration record was found or it was rejected
CTR-955	Date must be a trading date
CTR-956	Initial date cannot be after Final Date
DAR-001	The DA register has been used in orders previous to the current Data Base
DWR-765	Wrong decision maker short code, please submit a RC record to provide decision maker information
DWR-766	The RI register has been used in orders previous to the current Data Base
DWR-909	This decisor has already been submitted
EWR-765	Wrong executor short code, please submit a RC record to provide executor information
EWR-766	The RI register has been used in orders previous to the current Data

	Base
EWR-899	This ejecutor has already been submitted
NOORDERS	No order has been submitted to the market
STA-001	File containing the report has an incorrect filename.
STA-002	File containing the report is corrupted.
STA-004	Error Parser CSV. Check that limiters and the file is codified as 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 LEI code cannot be different from filename ExctgPty LEI code
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
STR-926	There are errors that are not displayed. Number of messages has exceeded the limit of 10.000

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. (Solo si es RC)
3	Tipo_Err	RI, RC, VA	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 en la orden y no se ha remitido la información mediante un registro RC. • VA: indica que la orden tiene un error de coherencia.
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

Ficheros SHCD

Los ficheros SHCD se generarán cada inicio de mes en la carpeta filesout del SFTP.

La finalidad de estos ficheros es informar de qué códigos cortos han sido movidos al área histórica.

Nº	Campo	Dato	Descripción
1	ExctgPty	Código LEI	Código LEI de la entidad que introduce la orden
2	SubRegistro	CT/ DW/ EW	Indica el tipo de código corto que se muestra en el siguiente campo: CT=Cliente DW=Decisor EW=Ejecutor
3	Identificador		Código corto que se ha enviado al área histórica
4	Fecha	aaaaMMdd	Fecha en la que se realiza el movimiento al área histórica
5	Tipo	H/ D	Cambio de situación del código corto: H: el código corto se ha movido al área histórica D: el código corto se ha eliminado por no haber sido utilizado en ninguna orden en los últimos dos meses

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.

Asimismo, cuando una orden haya pasado al Histórico ORK (ver punto “Gestión histórica de datos del ORK” dentro del apartado 1) no podrá ser modificada.

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	Titular de la orden
4	Decisión de inversión dentro de la empresa
5	Ejecución dentro de la empresa
7	Capacidad de negociación
8	Actividad de provisión de liquidez

Método de actuación

Para corregir individualmente cualquiera de los datos susceptibles de ser modificados en una orden, el miembro deberá enviar un nuevo registro de alta de RC de una orden.

Un registro RC con datos del titular reemplazará la titularidad de otro RC si ha sido enviado en un **fichero diferente**. En caso de que los titulares se envíen en registros RC en el **mismo fichero** se añadirán cotitulares a la orden.

Los datos de decisores y ejecutores enviados en un RC reemplazarán a los anteriores, tanto si se envían en el mismo fichero como en uno nuevo.

El envío de un registro RC con el campo Action="B" dará de baja toda la información enviada mediante registros RC para esa orden.

En el caso de que, para una misma orden, se hayan facilitado short codes con sus correspondientes registros CT, DW y EW, y también se hayan facilitado datos mediante registro RC, los datos del registro RC siempre prevalecerán sobre cualquier información obtenible de los short codes.

Los registros RC no pueden modificar ni dar de baja información de órdenes que están en el Histórico ORK. En caso de que un registro RC esté asociado a una orden que está en el Histórico ORK será rechazado.

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	Vacío	
5	Vacío	
6	Vacío	
7	Identificador	120
8	SubRegistro	DW
9	Dcsn_typePrsn	P
10	Dcsn_Algo	
11	Dcsn_Othr_SchNm	CONCAT
12	Dcsn_Othr_Id	US19770912JON#DEWIT

Nº	Campo	REGISTRO RI-EW
1	TypeReg	RI
2	Action	A
3	ExctgPty	549300ASTRCPTXGNEI40
4	Vacío	
5	Vacío	
6	Vacío	
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	Vacío	
5	Vacío	
6	Vacío	
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	Vacío	
5	Vacío	
6	Vacío	
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	Vacío	
5	Vacío	
6	Vacío	
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	Vacío	
5	Vacío	
6	Vacío	
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	Vacío	
5	Vacío	
6	Vacío	
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 preasignado 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	Vacío	
5	Vacío	
6	Vacío	
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	Vacío	
5	Vacío	
6	Vacío	
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	

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/Modificación B-Baja
3	4	ExctgPty	Char	20	Código LEI de la entidad que ejecuta la operación.
4		Vacío			
5		Vacío			
6		Vacío			
7		Id	Char	20	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_SchmeNm	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”

Nº	RTS 22	Campo	Tipo	Long	Dato
1		SubRegistro	Char	2	DW
2	57	Dcsn_typePrsn	Char	1	P-Person A-Algorithm
3	57	Dcsn_Algo	Char	50	Si Dcsn_typePrsn='A'. Código del algoritmo que toma la decisión de la operación dentro de la entidad.
4	57	Dcsn_Othr_SchNm	Char	6	Si Dcsn_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID. NIDN, CCPT, CONCAT
5	57	Dcsn_Othr_Id	Char	35	Si Dcsn_typePrsn='P'. National_ID de la persona que toma la decisión de la operación dentro de la entidad.

Formato SubRegistro EW de ejecutores “within the firm”

Nº	RTS 22	Campo	Tipo	Long	Dato
1		SubRegistro	Char	2	EW
2	59	Exct_typePrsn	Char	1	P-Person A-Algorithm C-Client
3	57	Exct_Algo	Char	50	Si Exct_typePrsn='A'. Código del algoritmo que ejecuta la operación dentro de la entidad.
4	59	Exct_Othr_SchNm	Char	6	Si Dcsn_typePrsn='P'. Tipo de código del NATIONAL_ID
6	59	Exct_Othr_Id	Char	35	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 entidad
	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 entidad
	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)