



GUÍA DE COMUNICACIÓN DIARIA DE POSICIONES EN DERIVADOS DE MATERIAS PRIMAS A LA CNMV

Noviembre - 2018

Indice

I.GUÍA TÉCNICA DE COMUNICACIÓN DIARIA DE POSICIONES A LA CNMV.....	3
1. INTRODUCCIÓN	4
2. ALTA EN EL SERVICIO DE COMUNICACIÓN DIARIA DE POSICIONES	4
3. CRONOGRAMA DEL PROCESO DE REPORTE	6
II.GUÍA OPERATIVA DE LA COMUNICACIÓN DIARIA DE POSICIONES A LA CNMV.....	9
1. REMISION DE FICHEROS.....	10
• Remisión a través del servidor FTPS de la CNMV para los usuarios que tienen el servicio CIFRADO/CNMV	10
• Remisión a través del servidor FTPS de la CNMV para los usuarios que NO tienen el servicio CIFRADO/CNMV	10
2. VALIDACION DE DATOS.....	11
• Errores de transmisión de datos	11
• Formato de fecha y errores de archivo	11
• Corregir un archivo no válido	12
• Errores de contenido de los datos	14
• Corregir registros aceptados.....	14
• Campos de los archivos de respuesta.....	15
3. Especificaciones de carga de estado de posición.....	16
• Resumen de los datos a presentar.....	16
• Archivo de datos de negocio.....	23
• Encabezado de Aplicación de Negocio (Business Application Header) (BAH).....	24
• Abreviaturas.....	25
Anexo 1: Esquemas XML.....	1
• Descripción de los mensajes XML	1
• XPath.....	1
• Mensajes XML.....	3
Anexo 2: Convenciones de asignación de nombres de archivo	4
• Entidad que presenta la comunicación a MDP	4
• MDP a entidad que presenta la comunicación.....	5
Anexo 3: Normas de validación	6
• Normas de validación de archivos	6
• Normas de validación de contenidos	9



I. GUÍA TÉCNICA DE COMUNICACIÓN DIARIA DE POSICIONES A LA CNMV

Mayo-2018

1. INTRODUCCIÓN

Este documento contiene información de interés para las entidades que están obligadas, en virtud de los artículos 58.1.b) y 58.2 de MiFID II¹, a remitir a la CNMV informes diarios de posiciones (en adelante, informes de posiciones) en los siguientes instrumentos financieros: derivados de materias primas, derechos de emisión o derivados de estos.

El citado art. 58.1.b) establece que los centros de negociación deben remitir diariamente a su autoridad competente (CNMV) un desglose completo por cada titular final de las posiciones en derivados de materias primas, derechos de emisión o derivados de estos negociados en el centro.

Adicionalmente, de acuerdo con el art. 58.2, las Entidades de Servicios de Inversión que negocien esa misma clase de instrumentos fuera de un centro de negociación (ESIS obligadas) deberán remitir el desglose diario de sus posiciones en tales instrumentos si fueron negociados en un centro de negociación, y otro desglose de sus posiciones en instrumentos económicamente equivalentes a los anteriores que se hubieran negociado fuera de un centro de negociación (en adelante OTCEE), así como las posiciones de sus clientes hasta llegar al titular final de las mismas.

En la medida en que las posiciones correspondientes a los contratos negociados en centros de negociación ya están disponibles en la CNMV a través del reporte de estos últimos, las ESIS obligadas únicamente deberán reportar a la CNMV las posiciones en OTCEE.

El Reglamento de Ejecución 2017/1093² establece el formato y contenido de los informes diarios previstos en el art. 58.2 y que tales informes deberán ser presentados en un formato XML normalizado común.

Este mismo formato y contenido será el que deberán utilizar los centros de negociación para cumplir con la obligación establecida en el art. 58.1.b), en los términos que se señalan en la GUÍA OPERATIVA DE LA COMUNICACIÓN DIARIA DE POSICIONES A LA CNMV adjunta.

La CNMV será la receptora de esos informes diarios y agregará las posiciones por titular en cada instrumento negociado en un centro de negociación (y en sus correspondientes OTCEE) comprobando que la posición global del titular se encuentra por debajo de los límites establecidos. El sistema de Proceso de Informes de Posiciones (MDP) de la CNMV será el utilizado para el seguimiento del cumplimiento de estas obligaciones.

2. ALTA EN EL SERVICIO DE COMUNICACIÓN DIARIA DE POSICIONES

La CNMV ha establecido, dentro de la Sede Electrónica, un servicio para la realización de estas comunicaciones diarias. El acceso a este nuevo servicio requerirá de un registro previo del usuario en la Sede Electrónica de la CNMV siguiendo los siguientes pasos:

- El solicitante del servicio debe cumplimentar un formulario [\(añadir enlace\)](#) siguiendo las instrucciones y validaciones incluidas en el mismo. Será necesario aportar una dirección de

¹ DIRECTIVA 2014/65/UE DEL PARLAMENTO EUROPEO Y DEL CONSEJO, de 15 de mayo de 2014, relativa a los mercados de instrumentos financieros y por la que se modifican la Directiva 2002/92/CE y la Directiva 2011/61/UE.

² REGLAMENTO DE EJECUCIÓN (UE) 2017/1093 DE LA COMISIÓN, de 20 de junio de 2017, por el que se establecen normas técnicas de ejecución relativas al formato de los informes de posiciones de las empresas de servicios de inversión y los organismos rectores del mercado.

correo electrónico que será utilizada para las comunicaciones que se realicen como consecuencia de la solicitud. En el formulario se debe indicar si la entidad está dada de alta en el servicio CIFRADO/CNMV y, si es así, se debe introducir el usuario correspondiente con el que se quiere realizar la notificación, para que la CNMV pueda habilitarle el trámite.

- Tras completar adecuadamente el formulario, el usuario tendrá que rellenar un código de seguridad (tipo CAPTCHA) para, a continuación, enviar el formulario a través de la Sede Electrónica de la CNMV.
- Si todos los datos introducidos son correctos, la entidad comunicante recibirá por correo electrónico un “código de validación” que deberá introducir en el formulario subsiguiente. Si por el contrario, en esta primera pantalla hubiera habido algún problema (no ha rellenado algún campo obligatorio o lo ha hecho incorrectamente –formato de campos, p.ej.-) se rechazará el alta y deberá volver a solicitarse el acceso.
- Tras introducir el código de validación, la CNMV recibirá su registro y realizará las comprobaciones respecto de la identidad (entidad, persona de contacto, teléfono de contacto y una dirección de correo corporativa) de quien se ha dado de alta en la pantalla anterior. Esta comprobación se realizará habitualmente por una gestión telefónica.
- Si la comprobación es satisfactoria, la entidad comunicante recibirá un correo electrónico en el que se le informará de su registro en el sistema, se le habilitará el trámite en caso de que esté dado de alta en el servicio CIFRADO o, si no dispone de él, se le asignarán unas credenciales (usuario y contraseña) y parámetros de acceso, que deberán utilizarse posteriormente para remitir los informes diarios de posiciones.
- En el caso de usuarios de CIFRADO podrán enviar los ficheros a través de la sede o por FTPS. En ambos casos el fichero deberá estar firmado. Para las ESIS que accedan mediante usuario y contraseña el canal de comunicación a utilizar será el servidor FTPS.

La conexión al servidor FTPS de la CNMV no tiene coste alguno para las entidades obligadas y la remisión de ficheros de forma continua tampoco está sujeta a tasas.

- Las instrucciones para la remisión de ficheros, el flujo de intercambio de ficheros entre ESI obligada y la CNMV así como la convención de nombres, gestión de errores y otros aspectos relacionados se describen en la GUÍA OPERATIVA DE LA COMUNICACIÓN DIARIA DE POSICIONES A LA CNMV adjunta.

3. CRONOGRAMA DEL PROCESO DE REPORTE

Las fechas y horas de los eventos relacionados con la recepción por parte de la CNMV de los informes de posiciones y su proceso posterior se incluyen en la siguiente tabla:

Paso	Evento	Día y hora (Madrid CET)	Comentarios
1	Fin de la negociación día T.	Día T (Fin del horario de negociación del centro en el día T).	Las posiciones de final de la jornada son las que los centros de negociación deben suministrar en los informes de posiciones.
2	Se obtienen los datos de referencia (Fichero FIRDS) para el día T necesarios para validar el contenido de los informes de posiciones: LEI: Código Identificador de personas. ISIN: Cód. identificador del instrumento. MIC: Código del centro de negociación.	Está previsto que ESMA proporcione acceso a los datos de referencia del día T a partir de las 8:00h del día T+1, si bien el proceso interno de incorporación de los datos finalizará (salvo circunstancias excepcionales) entre las 10 y las 13h de dicho T+1.	La CNMV realizará un primer ciclo de validación de los informes de posición del día T remitidos por centros de negociación y ESIS obligadas a las 13:30 del día T+1, una vez finalizada la incorporación de los datos de referencia correspondientes al día T. A partir de las 14:00h los centros de negociación y ESIS y otras Autoridades Nacionales Competentes (ANCs) recibirán los mensajes de confirmación o rechazo resultado de este primer ciclo de validación de acuerdo con las reglas de validación establecidas.
3	Envío de los informes de posiciones correspondientes a T por parte de centros de negociación y ESIS (sólo contratos OTCEEs).	Se pueden enviar los informes de fin de la jornada de negociación T a partir de las 00:00 del día T+1 ¹ hasta el día T+1 a las 23:00h.	El primer ciclo de validación se producirá sobre la última versión disponible ² del fichero del informe diario remitido por cada centro de negociación y/o ESI. Posteriormente y hasta las 23:00 de T+1, los remitentes pueden

¹ Los informes de posiciones de la jornada T no se pueden enviar antes de las 00:00h del día T+1 porque sólo a partir de ese momento estará finalizado el 2º ciclo de validación de los informes de la jornada anterior (en este caso, posiciones del día T-1) y que se realizan contra el fichero FIRDS de T-1 incorporado durante la mañana de la jornada T. Si se enviaran los ficheros de posiciones correspondientes al día T antes de las 00:00h de T+1 serían también validados en el mismo proceso, por lo tanto contra el FIRDS actualizado a T-1 con lo que se podrían generar errores de validación “falsos” derivados de comparar posiciones en contratos del día T contra un FIRDS no actualizado a T.

² Si antes del primer ciclo de validación, o entre el primer y el segundo ciclo de validación, se enviara el fichero de posiciones correspondiente al día T en más de una ocasión con el mismo nombre (p.ej. porque el remitente se hubiera dado cuenta de algún error con carácter previo al propio proceso de validación de la CNMV) la última versión del fichero del mismo nombre sustituiría a los ficheros anteriores y sería el único fichero procesado en validación. Si se envían ficheros con nombres distintos (p.ej. ficheros de posiciones de días anteriores que hubieran sido rechazados en los dos ciclos de su día de validación correspondiente) todos ellos entran en el proceso de validación y generarían sus respectivos mensajes de confirmación o de error.

Paso	Evento	Día y hora (Madrid CET)	Comentarios
			actualizar sus informes correspondientes al día T y corregir los mensajes de error recibidos en la validación precedente. El segundo ciclo de validación correspondiente a T se realizará a continuación, de forma que ESIS y centros de negociación que hayan remitido un nuevo informe correspondiente al día T después del primer ciclo de validación recibirán los mensajes de confirmación o rechazo resultado de este segundo ciclo de validación a partir de las 23:30h de T+1.
4	Identificación de incumplimientos de los límites de posiciones.	Desde Día T+2 - 8:00h.	La CNMV compara las posiciones comunicadas en los informes de posiciones del día T con los límites de posiciones establecidos para cada contrato de derivados de materias primas, y envía una notificación al titular (y en su caso, a la matriz del grupo consolidado) de posiciones superiores a los límites.
7	Posteriores actuaciones por parte de la CNMV.	A partir del Día T+2.	En el supuesto de que los titulares de posiciones por encima de los límites no reduzcan su posición por debajo de los umbrales establecidos, la CNMV tomará en consideración actuaciones adicionales.

De acuerdo con lo anterior, el proceso de validación de los informes diarios de posiciones del día T empezará a las 13:30h del día T+1, cuando haya terminado la incorporación de los datos de referencia a la base de datos de la CNMV. Este primer ciclo de validación se realizará sobre todos los ficheros remitidos en el FTPS por cada centro de negociación o ESI, o en el caso de que se remita el fichero de posiciones con el mismo nombre más de una vez antes del primer ciclo de validación, sobre la última versión recibida de los informes correspondientes al día T disponibles en el FTPS para cada centro de negociación o ESI.

La CNMV aceptará los informes de posiciones remitidos por centros de negociación y ESIS (españolas y extranjeras) correspondientes a la posición final de cada titular en el día T hasta las

23:00h del día T+1. En el supuesto de recibir diferentes envíos de posiciones de un mismo centro de negociación o ESI respecto del mismo contrato, la CNMV considerará que las posiciones a chequear contra los límites establecidos son las incorporadas en el último fichero validado correctamente que se haya recibido de cada remitente para ese contrato.

Cuando una entidad remitente identifique un error en un informe que ya haya sido remitido y aceptado por parte de la CNMV, procederá tan pronto como le sea posible a remitir otro informe que corrija o anule el informe erróneo previo. Si fuera recibido y validado por la CNMV antes de las 23:00h de T+1 se incorporará a la Base de Datos de la CNMV en el momento del segundo ciclo de validación, y posteriormente al proceso normal de chequeo de posiciones contra los límites establecidos. Para errores en los informes aceptados e incorporados al proceso de chequeo que sean detectados hasta en un plazo de 5 años a contar desde el día T, la entidad remitente realizará el envío a la CNMV del informe corregido a la mayor brevedad posible. Estos reenvíos permitirán que la CNMV disponga de un conjunto de informes de posiciones lo más completo y preciso posible para que, en su caso, se pudiera proceder a recalcular las posiciones que cada titular mantenía en cada contrato.

Respecto de los informes de posiciones recibidos en la CNMV de centros de negociación españoles y que deban ser remitidos a otra ACC, la CNMV realizará los mismos procesos de validación que para el resto de los informes recibidos. Los informes validados con posiciones del día T serán remitidos a la ACC correspondiente a partir de la 01:00h de T+2.



II. GUÍA OPERATIVA DE LA COMUNICACIÓN DIARIA DE POSICIONES A LA CNMV

1. REMISION DE FICHEROS

Remisión a través del servidor FTPS de la CNMV para los usuarios que tienen el servicio CIFRADO/CNMV

Una vez generado el fichero XML por la entidad y comprimido con WinZip, deberá ser firmado electrónicamente por sus propios medios, cumpliendo las características de la firma, y remitido a la CNMV. La firma ha de realizarse con el certificado de representante de persona jurídica del servicio CIFRADO/CNMV.

Las características de la firma son:

- ❖ Formato: CADES-BES
- ❖ Algoritmo de firma: SHA-512
- ❖ Extensión .SIGN

Los pasos a seguir son los siguientes:

- Firmar el fichero del modo indicado anteriormente. El fichero tendrá el mismo nombre que el XML original y su extensión será .ZIP.SIGN.
- Conectarse mediante un cliente FTP al servidor FTPS de la CNMV ftpserver.cnmv.es , utilizando los parámetros facilitados por la Sede Electrónica de la CNMV en el momento de la solicitud del servicio y subir el fichero a la carpeta “\Inbox”.
- Al recibirse el fichero en la CNMV, se enviará a la dirección o direcciones de correo previamente habilitadas por la Entidad un acuse de recibo. Este acuse únicamente indica que el fichero ha sido recibido y registrada su entrada, en ningún caso que la información contenida sea válida, lo que se verificará en un paso posterior.
- Si se produce algún error en la recepción o validación inicial del fichero se envía un correo a esta misma dirección con información del error que se ha producido y no continúa el proceso.

Una vez verificado el contenido del fichero por parte de la CNMV, ésta enviará a la dirección o direcciones de correo un e-mail que llevará adjunto un fichero XML de tipo “feedback” con indicación de si la información recibida en la CNMV es correcta o tiene algún error. En este último caso se ofrecerá el máximo detalle posible de los errores detectados para que la entidad remitente pueda subsanarlos a la mayor brevedad. Adicionalmente, una copia del fichero respuesta de tipo “feedback” se subirá a la carpeta “\Outbox” del servidor FTPS.

Remisión a través del servidor FTPS de la CNMV para los usuarios que NO tienen el servicio CIFRADO/CNMV

Una vez generado el fichero XML por la entidad y comprimido con WinZip, deberá:

- Conectarse mediante un cliente FTP al servidor FTPS de la CNMV ftpserver.cnmv.es , utilizando los parámetros facilitados por la Sede Electrónica de la CNMV en el momento de la solicitud del servicio y subir el fichero a la carpeta “\Inbox”.
- Una vez verificado el contenido del fichero por parte de la CNMV, ésta enviará a la dirección o direcciones de correo un e-mail que llevará adjunto un fichero XML de tipo “feedback” con indicación de si la información recibida en la CNMV es correcta o tiene algún error. En este

último caso se ofrecerá el máximo detalle posible de los errores detectados para que la entidad remitente pueda subsanarlos a la mayor brevedad. Adicionalmente, una copia del fichero respuesta de tipo “feedback” se subirá a la carpeta “\Outbox” del servidor FTPS..

2. VALIDACION DE DATOS

El sistema MDP de la CNMV ejecutará el mismo conjunto de validaciones automáticas para todos los ficheros de informes de posiciones recibidos, ya sean remitidos por centros de negociación, ESIS (españolas o extranjeras) u otras ANCs.

En todos los casos, haya encontrado o no errores en el proceso de validación, el MDP enviará un fichero de retorno a cada remitente. El sistema puede rechazar un fichero en su conjunto o bien un registro específico de un fichero válido, dependiendo del tipo de error. Si no hubiera ningún error, el MDP enviará a la entidad remitente un mensaje informando que el fichero remitido ha sido aceptado en su totalidad.

Tras la primera fase del proceso de validación (nombre y formato), los ficheros quedarán retenidos en el sistema hasta que pueda producirse la segunda fase de la validación, que afecta al contenido del informe y que sólo puede realizarse cuando estén disponibles los datos de referencia correspondientes al día de negociación T reportado, lo que está previsto que se produzca a las 08:00h del día T+1. Cuando en la segunda fase de validación se detecte un error que afecte a un registro específico del informe, el MDP generará un mensaje que identificará el/los código/s de error y el/los mensaje/s de error que afecta/n a dicho registro. Este proceso se repetirá para cada registro del informe.

Los mensajes de retorno en XML están explicados bajo el título “Campos de los archivos de respuesta”.

La CNMV asegurará la unicidad de los informes remitidos creando una clave única para el informe de posiciones que combine los valores de los campos “número de referencia del informe”, “Fecha de la jornada de negociación” (de la posición comunicada), “código de producto del centro de negociación” e “identificador del titular de la posición”.

Errores de transmisión de datos

Cuando un TV (centro de negociación) o una IF (firma de inversión) carga un archivo al sistema, la pasarela del MDP valida los nombres del fichero entrante, comparando con los patrones de nombre de archivo. Los nombres de archivo que no coincidan con los patrones esperados serán rechazados al nivel de SFTP (Protocolo de Transferencia Segura de Archivos) y se mostrará el error estándar "Acceso denegado".

En el Anexo 2, en el apartado correspondiente a Entidad que presenta la comunicación a MDP, se incluyen las convenciones adecuadas relativas a la asignación de nombres de archivo.

Formato de fecha y errores de archivo

Una vez superadas con éxito las validaciones de transmisión de datos, el MDP comprueba que el archivo presentado cumple con la especificación de validación de archivo y formato.

Los TV/IV solo pueden presentar archivos después de haber realizado la validación XML con éxito utilizando el esquema XML definido por la CNMV (Anexo 1: Esquemas XML). Asimismo, el MDP

realizará una validación XML de los archivos recibidos. Este esquema impone un límite máximo de 500 000 registros por archivo. Si el archivo presentado contiene más de 500 000 registros, tendrá que ser dividido en distintos envíos para evitar exceder este límite.

Si se identifica un error en esta fase, el procesamiento se detiene, todos los registros incluidos en el archivo son rechazados y se envía a la entidad que presenta la comunicación un mensaje que explica el motivo del rechazo. La entidad que presenta la comunicación debe rectificar los errores de validación XML y reenviar todos los registros.

Ver el Anexo 3 – Normas de validación de archivos, relativo al formato aplicable y las normas de validación de archivos, y cómo los distintos estados de archivo se utilizan con los distintos errores de archivo.

Corregir un archivo no válido

En cuanto el MDP inicia la validación del archivo, el nombre del archivo ZIP se guarda en el sistema. Después de este punto del procesamiento, el nombre de archivo no puede volver a utilizarse, al considerarse un nombre de archivo duplicado y, por lo tanto, será rechazado (FIL-107).

Se establece una rigurosa secuenciación de archivos a través de la hora de recepción y las convenciones relativas a la asignación de nombres de archivo (consulte el Anexo 2: Convenciones de asignación de nombres de archivo), de forma que cada archivo hace referencia explícita a su predecesor. Cuando un envío no cumpla con una norma de validación de archivos, se procesarán todos los envíos posteriores en orden de recepción hasta encontrar un archivo con un nombre de archivo aceptable que haga referencia al último archivo procesado con éxito.

Cuando un archivo ha sido rechazado con un error de archivo, ninguno de los estados de posición de ese archivo será procesados por el MDP. Si la entidad que presenta la comunicación determina que el archivo debe ser reenviado al MDP, debe utilizarse siempre que sea posible el nombre de archivo del envío original incrementando el número de versión. Si el reenvío es demasiado complejo —por ejemplo, por contener errores relativos al número de versión—, es aconsejable reiniciar el procesamiento utilizando un nuevo número de secuencia, siempre que el número de secuencia anterior haga referencia al número de secuencia del último archivo procesado con éxito.

En el ejemplo siguiente (Imagen 1) se muestran una serie de remisiones de informes de posición en el orden en el que fueron recibidas por el MDP. Se indica cómo responderá el MDP a los errores de archivo y de pasarela, y cómo las entidades remitentes deben renombrar los archivos al reenviarlos, para evitar que se produzcan nuevos errores de archivo por nombres de archivo incorrectos.

Consulte el Anexo 3 – Normas de validación de archivos, si desea detalles sobre los errores de archivo de los informes de posición y sobre qué estados de archivo se asocian con dichos errores.

Imagen 1 – Ejemplos de corrección de archivos no válidos

	Nombre de archivo	Estado de archivo	Error de archivo	Comentarios
A	TXMPL_DATCPR_ NCAES_000004-0-000003_18	ACPT	-	Archivo aceptado sin errores
B	TXMPL_DATCPR_ NCAES_000005-0-000004_18	CRPT	FIL-101	Error de descompresión
C	TXMPL_DATCPR_ NCAES_000006-0-000005_18	RJCT	GBX-020	Se recibió un archivo con el número de secuencia 000005 pero 000005 no era el número de secuencia del último archivo aceptado con éxito
D	TXMPL_DATCPR_ NCAES_000008-0-000007_18	RMDR	FIL-109	El número de secuencia 000007 no fue recibido y procesado con éxito por el MDP; fue rechazado al nivel FTP y por lo tanto no puede ser utilizado en el número de secuencia anterior
E	TXMPL_DATCPR_ NCAES_000005-0-000004_18	RJCT	FIL-107	El error de descompresión ha sido resuelto pero el nombre de archivo ya se ha recibido anteriormente
F	TXMPL_DATCPR_ NCAES_000005-1-000004_18	ACPT	-	El incremento del número de versión significa que el nombre de archivo es único
G	TXMPL_DATCPR_ NCAES_000006-1-000005_18	ACPT	-	El incremento del número de versión significa que el nombre de archivo es único
H	TXMPL_DATCPR_ NCAES_000007-0-000006_18	ACPT	-	El nombre de archivo para el envío D nunca existió en MDP por lo que este nombre de archivo no se considera duplicado
I	TXMPL_DATCPR_ NCAES_000008-2-000007_18	RJCT	GBX-030	El número de versión se ha incrementado en 2, en lugar de en 1, respecto a la última presentación procesada con ese nombre de archivo
J	TXMPL_DATCPR_ NCAES_000009-0-000007_18	ACPT	-	El número de versión erróneo del archivo anterior no puede rectificarse fácilmente. El emisor utiliza un nuevo número de secuencia para reiniciar el procesamiento

Errores de contenido de los datos

Si se superan con éxito las pruebas de transmisión de datos y formato de datos, el MDP realizará validaciones automatizadas del contenido de los datos, incluyendo su validación comparándolos con los datos de referencia de la ESMA y la CNMV.

Si se identifica un error durante la validación de contenidos, los registros afectados serán rechazados. El sistema enviará información a la entidad que presenta la comunicación sobre los registros erróneos y el motivo, o motivos, del rechazo. La entidad que presenta la comunicación debe rectificar los errores y reenviar los registros corregidos en un nuevo archivo.

ESMA reúne y publica todos los días a las 08:00 CET un conjunto de datos de referencia relativo al día natural anterior para todos los instrumentos MiFID II. Así, si el día "T" se informa sobre una posición relativa al mismo día de negociación "T", será validada comparándola con los datos de referencia publicados a las 08:00 CET del día "T+1". Asimismo, la CNMV mantendrá datos de referencia internos con el fin de validar los códigos de producto de los centros.

Es necesario tener en cuenta que el MDP solo puede realizar la validación del contenido cuando los datos de referencia para el día de negociación relativo a la posición concreta están disponibles (es decir, a partir de las 8:00 CET del día "T+1"). El registro se considerará "retenido" hasta que estén disponibles los datos de referencia y en las estadísticas del archivo de información de estado aparecerá el código de estado del registro "RCVD" (recibido).

Una vez los datos de referencia hayan sido recibidos por el MDP, los registros retenidos serán procesados. Un archivo de información final confirmará si el registro ha sido aceptado o rechazado.

Consulte el Anexo 3 – Normas de validación de contenidos, si desea conocer las normas aplicables de validación de contenidos y los estados a nivel de registro.

Corregir registros aceptados

Cuando un informe de posición es aceptado como válido y, posteriormente, la entidad que presenta la comunicación descubre que la información presentada no era correcta, dicho estado debe ser corregido lo antes posible. El MDP aceptará la realización de correcciones hasta pasados cinco años desde el día de negociación al que haga referencia el estado.

Las medidas correctivas adecuadas dependerán de cada caso. Solo las correcciones recibidas y aceptadas antes de la fecha límite para ese día de negociación serán incluidas automáticamente en los cálculos de posición para ese día de negociación.

Si el registro fue presentado por error, la entidad que presenta la comunicación debe reenviar el informe con estado de informe CANC, con el fin de cancelarlo.

Si el registro debe ser corregido y las modificaciones tienen relación con campos que forman la clave única de un estado de posición (a saber, el número de referencia del mismo, el día de negociación, el código de producto del centro y el ID del titular de la posición), la entidad debe reenviar el informe con estado de informe CANC, con el fin de cancelarlo. Si la cancelación es aceptada, la entidad puede presentar la versión correcta del informe con estado de informe NEW.

Si el registro debe ser corregido y las modificaciones no afectan a los datos incluidos en un principio en los campos que forman la clave única de un estado de posición, la entidad debe reenviar el informe con las modificaciones necesarias y con estado de informe AMND. No existe un

límite máximo para el número de veces que un informe puede ser modificado en el plazo de cinco años.

Campos de los archivos de respuesta

En la tabla siguiente se describe cómo se elaborarán los archivos de respuesta a la entidad que presenta la comunicación.

Se incluyen detalles de las estadísticas de estado de archivo que muestran recuentos de posiciones por estado para el informe de posición y el identificador del mensaje.

Hay que tener en cuenta que será necesario utilizar el atributo identificador de mensaje [MsgRptIdr] dentro de la información de estado [MsgStsAdv] con el fin de determinar el archivo original para cualquier informe de posición que contenga errores.

El atributo "MsgRptIdr" de "MsgStsAdv" identificará cualquier archivo que utilice el nombre de archivo o componentes <SequenceNo>-<Version>_<Year> del nombre de archivo (definido para identificar de forma específica ese archivo ante la entidad que la realiza). Por ejemplo: "MsgRptIdr" 000234-0_18.

Nombre del campo	Descripción de la información	XPath BizData/Pyld/Document/...
Message Status [Obligatorio]	El Estado del Mensaje hace referencia al estado de todo el informe recibido de una entidad notificante. Entre los posibles estados del archivo se incluyen: ACPT - El archivo fue aceptado sin producirse errores CRPT - El archivo está corrupto RJCT - El archivo fue rechazado debido a errores de archivo o porque todos los registros fueron rechazados RMDR - Recordatorio PART - Parcialmente aceptado, en caso de que algún registro no supere las validaciones de contenido	FinInstrmRptgStsAdv/ StsAdv/MsgSts/RptSts
Validation Rule [Opcional]	La Norma de Validación proporciona los detalles de la norma que no pudo ser validada por el sistema. El ID contiene el campo de código de error descrito en las tablas del Anexo 3.	FinInstrmRptgStsAdv/ StsAdv/MsgSts/VldtnRule
Record Status [Opcional]	El Estado del Registro proporciona un estado por cada registro del informe presentado. El mismo informe puede aparecer varias veces si diversos elementos del mismo presentan errores.	FinInstrmRptgStsAdv/ StsAdv/RcrdSts

Original Record Identification [Obligatorio]	Este campo incluye una identificación técnica única e inequívoca del registro de datos original. Se trata de una concatenación del número de registro y el número de referencia del informe, separados por un punto. El número de registro es el número de fila física dentro del archivo. El número de registro es asignado en el momento de la recepción por el MDP.	FinInstrmRptgStsAdvc/ StsAdvc/RcrdSts/ OrgnlRcrdId
Status [Obligatorio]	Este campo define el estado del registro presentado. ACPT Aceptado RJCT Rechazado	FinInstrmRptgStsAdvc/ StsAdvc/RcrdSts/Sts
Validation Rule [Opcional]	La Norma de Validación proporciona los detalles de la norma que no pudo ser validada para el registro. El ID contiene el campo de código de error descrito en las tablas del Anexo 3.	FinInstrmRptgStsAdvc/ StsAdvc/RcrdSts/VldtnRule

3. Especificaciones de carga de estado de posición

Resumen de los datos a presentar

La siguiente tabla representa la plantilla de la CNMV para los estados de posición, basada en el borrador de implementación de estándares técnicos sobre estados de posición.

N.º de campo	Nombre del campo	Formato del campo	Detalles
1	Date and time of report submission	{DATE_TIME_FORMAT}	La fecha y la hora de presentación del informe.
2	Report reference number	{ALPHANUM-52}	Identificador único proporcionado por la entidad notificante. Este campo debe rellenarse con el identificador único proporcionado por la entidad notificante que identifica de forma inequívoca el informe tanto para la entidad notificante como para la autoridad receptora competente. La CNMV se asegurará de que este identificador sea único para cada una de las entidades notificantes combinándolo con otros campos del informe. Consulte el Anexo 2 si desea más detalles.
3	Date of the trading day of the reported position	{DATEFORMAT}	La fecha en la que la posición objeto de presentación es retenida al cierre del día de negociación en el centro de negociación relevante.

N.º de campo	Nombre del campo	Formato del campo	Detalles
4	Report Status	'NEWT' – Nuevo (New) 'CANC' – Cancelación (Cancellation) 'AMND' – Corrección (Amendment)	<p>Indicación de si el informe es nuevo o es una cancelación o una modificación de un informe presentado previamente.</p> <p>Cuando un informe presentado previamente es cancelado o modificado, debe enviarse un informe que contenga todos los datos del informe original y en el que se utilice el número de referencia original del informe y el estado del informe debe ser "CANC".</p> <p>En el caso de las modificaciones, debe enviarse un nuevo informe que contenga todos los datos del informe original y emplee el número de referencia del mismo con las modificaciones necesarias, y el estado del informe debe ser "AMND".</p>
5	Reporting entity ID	{LEI} O {NATIONAL_ID}	<p>Identificador de la entidad notificante. Será el Código Identificador de Entidad Jurídica (LEI, por Legal Entity Identifier) para personas jurídicas o el NATIONAL_ID para personas físicas que no dispongan de LEI.</p> <p>Puede tratarse de un centro de negociación o una empresa de servicios de inversión. En el supuesto de que la entidad obligada a reportar delegue en otra entidad, la entidad que externalice o delegue esta función seguirá siendo responsable de la exhaustividad y exactitud del informe.</p>
6	Position holder ID	{LEI} O {NATIONAL_ID}	<p>Identificador del titular de la posición.</p> <p>LEI para personas jurídicas o NATIONAL_ID para personas físicas que no dispongan de LEI.</p> <p>Nota: si la posición es mantenida como posición propia de la firma que presenta el informe, este campo será idéntico al campo "ID de la entidad notificante".</p>
7	Email address of position holder	{ALPHANUM-256}	<p>Dirección de correo electrónico para notificaciones relativas a las posiciones.</p> <p>Es necesario proporcionar una dirección de correo electrónico</p>

N.º de campo	Nombre del campo	Formato del campo	Detalles
			comercial.
8	Ultimate parent entity ID	{LEI} O {NATIONAL_ID}	<p>Identificador de la entidad matriz última del titular de la posición cuando se agregan posiciones de varias entidades de un grupo. LEI para personas jurídicas o NATIONAL_ID para personas físicas que no dispongan de LEI.</p> <p>Este campo puede ser idéntico a "ID de la entidad notificante" o "ID del titular de la posición" si la entidad matriz última mantiene sus propias posiciones o elabora sus propios informes.</p>
9	E-mail address of ultimate parent entity	{ALPHANUM-256}	<p>Dirección de correo electrónico para correspondencia relativa a posiciones agregadas.</p> <p>Es necesario proporcionar una dirección de correo electrónico comercial. En caso de que la entidad no tenga una entidad matriz, este campo debe rellenarse con la misma dirección proporcionada en el campo 7 "Dirección de correo electrónico del titular de la posición".</p>
10	Parent of collective investment scheme status	<p>'TRUE' – el titular de la posición es una IIC que toma decisiones de inversión independientes</p> <p>'FALSE' - el titular de la posición NO es una IIC que toma decisiones de inversión independientes</p>	<p>Campo en el que se indica si el titular de la posición es una institución de inversión colectiva que toma decisiones de inversión con independencia de su matriz, tal como establece el artículo 4(2) de RTS 21.</p> <p>Las entidades remitentes deben tener en cuenta que la referencia a "planes de inversión colectiva" en el nombre del campo de esta fila de la plantilla debe interpretarse como inclusiva de las "instituciones de inversión colectiva". Las instituciones de inversión colectiva incluyen aquellas entidades consideradas OICVM, tal como se definen en el artículo 1(2) de la Directiva 2009/65/CE, o FIA, tal como se definen el artículo 4(1)(a) de la Directiva 2011/61/EU.</p>

N.º de campo	Nombre del campo	Formato del campo	Detalles
11	Identification code of contract traded on trading venue	{ISIN}	<p>Identificador del instrumento derivado sobre materias primas, derecho de emisión o instrumento derivado del mismo.</p> <p>Revise el campo "Identificador del centro de negociación" más adelante si desea información sobre el tratamiento de contratos OTC económicamente equivalentes a contratos negociados en centros de negociación.</p>
12	Venue product code	{ALPHANUM-12}	<p>Identificador único e inequívoco, utilizado por el centro de negociación, que agrupa contratos con distintos vencimientos y precios de ejercicio en un mismo producto.</p>
13	Trading venue identifier	{MIC}	<p>Identificador para el centro de negociación en el que se mantiene la posición. Campo que debe rellenarse con el MIC de segmento, conforme a ISO 10383. Cuando no exista un MIC de segmento, hay que utilizar el MIC operativo.</p> <p>Utilizar el código MIC XXXX para posiciones negociadas fuera del centro en contratos OTC económicamente equivalentes.</p> <p>Utilizar el código MIC XOFF para derivados admitidos en TV y negociados fuera del mercado.</p>
14	Position type	<p>‘OPTN’ – Opciones, incluyendo opciones sobre FUTR, SDRV u OTHR types, y excluyendo contratos en los que la opcionalidad es solo un element intrínseco.</p> <p>‘FUTR’ – Futuros</p> <p>‘EMIS – Derechos de Emisión y sus derivados</p> <p>‘SDRV’ – Derivados sobre materias primas definidas en el punto (c) del artículo 4(1)(44) de la Directiva 2014/65/EU</p> <p>‘OTHR’ – cualquier otro tipo de contrato</p>	<p>Campo que indica si la posición es en futuros, opciones, derechos de emisión o instrumentos derivados de los mismos, instrumentos derivados sobre las materias primas tal como se definen en el punto (c) del artículo 4(1)(44) de Directiva 2014/65/ EU (por ejemplo, derivados titulizados) o cualquier otro tipo de contrato (por ejemplo, un derivado C10 conforme al anexo 1 de la Directiva 2014/65/EU).</p>

N.º de campo	Nombre del campo	Formato del campo	Detalles
15	Position maturity	<p>SPOT: Próximo Vencimiento (Spot month), incluyendo, en el caso de EMIS y SDRV, todas las posiciones.</p> <p>OTHR: Resto de los meses</p>	<p>Indicación de si el vencimiento de los contratos que comprenden la posición que se comunica corresponde al próximo vencimiento o al resto de vencimientos.</p> <p>Nota: se deben presentar informes separados para el próximo vencimiento y para el resto de vencimientos.</p> <p>En el artículo 2 de RTS 21 se proporciona una definición de "contrato de próximo vencimiento" como un contrato de derivados sobre materias primas relativo a una materia prima subyacente cuyo vencimiento es el próximo en tener lugar de conformidad con las normas establecidas por el centro de negociación. Asimismo, un contrato con "resto de vencimientos" se define como un contrato de derivados sobre materias primas que no es un contrato de próximo vencimiento.</p>
16	Position quantity	{DECIMAL – 15/2}	<p>Campo que debe rellenarse con la cantidad neta de posiciones mantenidas en el instrumento derivado sobre materias primas, expresada en lotes (cuando los límites de posición se expresan en lotes) o en unidades del subyacente.</p> <p>Este campo debe rellenarse con un número positivo para las posiciones largas y con un número negativo para las posiciones cortas.</p> <p>Si la posición es en instrumentos derivados sobre materias primas de los definidos en el punto (c) del Artículo 4(1)(44) de la Directiva 2015/65/EU (por ejemplo, derivados titulizados), este campo debe rellenarse con el número de unidades mantenidas.</p> <p>Tal como se indica en la sección 2 de la presente guía, tanto para las posiciones con próximo vencimiento como para las de resto de vencimientos debe registrarse el valor neto, agregando todas las posiciones largas y cortas con próximo</p>

N.º de campo	Nombre del campo	Formato del campo	Detalles
			vencimiento y, del mismo modo, las de resto de vencimientos.
17	Notation of the position quantity	LOTS – si Position quantity está expresada en lotes {ALPHANUM-25} – una descripción de la unidades usadas si Position quantity está expresada en unidades de subyacente UNIT - si Position quantity está expresada en unidades	Campo que debe rellenarse con las unidades utilizadas para notificar la cantidad de posiciones.
18	Delta equivalent position quantity	{DECIMAL-15/2}	<p>Si el tipo de posición es OPTN o una opción sobre EMIS, este campo contendrá el equivalente delta de la cantidad de posiciones comunicadas en el campo de cantidad de posiciones.</p> <p>Este campo debe rellenarse con un número positivo para las compras de opciones de compra y las ventas de opciones de venta y con un número negativo para las compras de opciones de venta y las ventas de opciones de compra. Las posiciones en opciones deben convertirse a posiciones en sus respectivos contratos en futuros sobre la base del delta actual para llegar al equivalente delta de la posición en futuros.</p> <p>Las posiciones largas en equivalente delta en las compras y las posiciones cortas en equivalente delta en las ventas deben añadirse a las posiciones largas en futuros. Las posiciones cortas en equivalente delta en las compras y las posiciones largas en equivalente delta en las ventas deben añadirse a las posiciones cortas en futuros.</p> <p>Los titulares de las posiciones deben utilizar el valor delta publicado por el centro de negociación o la ECC, si lo hubiera, para informar sobre sus posiciones en opciones. En caso de</p>

N.º de campo	Nombre del campo	Formato del campo	Detalles
			<p>que no se haya publicado un valor delta, los titulares de las posiciones pueden utilizar sus propios cálculos.</p> <p>Los titulares de las posiciones deben poder demostrar, cuando se les solicite, a la autoridad nacional competente responsable de la aplicación del límite de posición que sus cálculos reflejan adecuadamente el valor de la opción.</p>
19	Indicator of whether the position is risk reducing in relation to commercial activity	'TRUE' – la posición reduce riesgo 'FALSE' – la posición NO reduce riesgo	Campo en el que se indica si la posición reduce riesgos, de conformidad con el artículo 7 de RTS 21.

En la tabla siguiente se describen los formatos de cada campo de la plantilla de estado de posición.

Símbolo	Tipo de datos	Definición
{ALPHANUM-n}	Hasta n caracteres alfanuméricos	Campo de texto libre
{DATEFORMAT}	Formato de fecha conforme a ISO 8601	Las fechas tendrán el formato siguiente: AAAA-MM-DD
{DATE_TIME_FORMAT}	Formato de fecha y hora conforme a ISO 8601	Las fechas y horas tendrán el formato siguiente: AAAA-MM-DDThh:mm:ss.dzzzzzzZ Donde: AAAA es el año MM es el mes DD es el día T significa que debe utilizarse la letra T hh es la hora mm es el minuto ss.dzzzzzz es el segundo y su fracción de segundo Z es la zona horaria UTC Las fechas y horas deben indicarse en UTC
{ISIN}	12 caracteres alfanuméricos	Códigos ISIN definidos en ISO 6166

{LEI}	20 caracteres alfanuméricos	Identificador de Entidad Jurídica tal como se define en ISO 17442
{MIC}	4 caracteres alfanuméricos	Código Identificador de Mercado tal como se define en ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 caracteres alfanuméricos	El ID es el establecido en el artículo 6 y el anexo II de RTS 22 sobre las obligaciones de comunicación de operaciones de conformidad con el artículo 26 del Reglamento (EU) n.º 600/2014.
{INTEGER-n}	Número entero de hasta n dígitos	Campo numérico para valores enteros positivos y negativos
{DECIMAL-n/m}	Número decimal de hasta n dígitos en total, de los cuales m dígitos pueden ser digitales	Campo numérico para valores enteros positivos y negativos. Debe utilizarse como separador decimal el signo "." (punto), los números negativos deben ir precedidos del signo "-" (menos). Si corresponde, los valores deben ser redondeados y no truncados.

Archivo de datos de negocio

El archivo de datos de negocio engloba el Encabezado de Aplicación de Negocio (BAH), el Encabezado de Mensaje (MHD) y los Campos de Negocio (BF) y contiene:

- El Encabezado de Aplicación de Negocio dentro de "BizData/Hdr"
- El Encabezado de Mensaje y los Campos de Negocio dentro de "BizData/Pyld"

Para una presentación correcta de los archivos, deben definirse los siguientes espacios de nombres al crear el mensaje XML:

- `<BizData xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.003.001.01 head.003.001.01.xsd">`

Disponible en <https://sede.cnmv.gob.es/ov/esquemas/CDP/head.003.001.01.xsd>

- `<AppHdr xmlns="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01" xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:iso:std:iso:20022:tech:xsd:head.001.001.01 head.001.001.01_ESMAUG_1.0.0.xsd">`

Disponible en

https://sede.cnmv.gob.es/ov/esquemas/CDP/DRAFT5auth.031.001.01_ESMAUG_Reporting_1.0.2.xsd

- `<Document xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance" xsi:schemaLocation="urn:fca:org:uk:xsd:comp osrpt.001.09 composrpt.v1_9.xsd">`

Disponible en https://sede.cnmv.gob.es/ov/esquemas/CDP/composrpt.v1_9.xsd

Encabezado de Aplicación de Negocio (Business Application Header) (BAH)

En la tabla siguiente se detallan los elementos obligatorios del BAH que deben incluirse en todos los mensajes de datos de informes de posición, y cómo deben rellenarse.

Elemento	Descripción general	Contenido creado por las entidades que presentan la comunicación (tipo de archivo DATCPR)	Contenido recibido por las entidades que presentan la comunicación (tipo de archivo FDBCPR)
De	Identifica la organización que envía el mensaje	LEI de la entidad que presenta la comunicación.	ES
Para	Identifica la organización que recibe el mensaje.	ES	<From> es utilizado por la entidad que presenta la comunicación en las comunicaciones recibidas
Identificador Mensaje de Negocio	Identifica de forma inequívoca el mensaje de negocio al terminal de mensajes.	<Sequence No>-<Version>_<Year> del nombre del archivo ZIP a enviar (consulte las convenciones para la asignación de nombres de archivo en el Anexo 2).	<Sequence No>-<Version>_<Year> del nombre del archivo ZIP a enviar (consulte las convenciones para la asignación de nombres de archivo en el Anexo 2).
Identificador Definición de Mensaje	Identificación del tipo de mensaje (identificador de mensaje de conformidad con ISO 20022 o CNMV).	Identificador del mensaje de conformidad con la CNMV. Esto es "composrpt.v1_9" para los mensajes enviados al MDP con el informe de posiciones.	Identificador del mensaje de conformidad con ISO 20022. Auth.031.001.01
Fecha de creación	Fecha y hora a la que se creó este mensaje de negocio.	Fecha y hora UTC con formato ISO 8601.	Fecha y hora UTC con formato ISO 8601.
Relacionado	Especifica el Encabezado de Aplicación de Negocio del mensaje de negocio con el que está relacionado este mensaje de negocio	No se utiliza	<p>Cuando el archivo de información sea una respuesta a una única presentación, aquí se guardará una copia del BAH de dicho mensaje de datos.</p> <p>Cuando el archivo de información contenga detalles relativos a más de una presentación (por ejemplo, información posterior al reprocesamiento de informes retenidos), este atributo contendrá el BAH de la última presentación para la que se proporciona información.</p>

Abreviaturas

BAH	Encabezado de Aplicación de Negocio (Business Application Header)
CCA	Autoridad Competente Central (Central Competent Authority)
CET	Horario Central Europeo (Central European Time)
EEOTC	Contrato OTC Económicamente Equivalente (Economically Equivalent Over The Counter)
ESMA	Autoridad Europea de Valores y Mercados (European Securities and Markets Authority)
ETD	Derivado Negociado en un Mercado Regulado (Exchange Traded Derivative)
GLEIF	Fundación para los Identificadores Globales de Personas Jurídicas (Global Legal Entity Identifier Foundation)
IF	Empresa de Servicios de Inversión (Investment Firm)
ISIN	Código de Identificación de Instrumentos Financieros (International Securities Identification Number)
LEI	Identificador de Personas Jurídicas (Legal Entity Identifier)
MDP	Sistema de Proceso de Informes de Posiciones (Market Data Processor)
MIC	Código Identificador del Mercado (Market Identifier Code)
NCA	Autoridad Nacional Competente (National Competent Authority)
SCDPR	Reporte de Posiciones del Mismo Derivado de Materias Primas (Same Commodity Derivative Position Reports)
SFTP	Protocolo de Transferencia Segura de Archivos (Secure File Transfer Protocol)
TV	Centro de Negociación (Trading Venue)
UTC	Tiempo universal coordinado (Coordinated Universal Time)
VPC	Código de Producto del Centro de Negociación (Venue Product Code)
XML	Lenguaje de Marcado Extensible (Extensible Mark-Up Language)
XSD	Definición del Esquema XML (XML Schema Definition)

Anexo 1: Esquemas XML

Descripción de los mensajes XML

Todos los archivos que entren y salgan en el MDP tendrán una estructura estándar que incluirá una Definición de Esquemas XML (XSD) del Business Application Header(BAH) que engloba una XSD del BAH y una única XSD de Campos de Negocio.

La XSD del Encabezado de Mensaje de Negocio y la XSD del BAH son conformes a ISO 20022.

La XSD de Campos de Negocio para las presentaciones de estados de posición de derivados sobre materias primas ha sido desarrollada por la CNMV partiendo de los campos especificados por la ESMA. Dentro de lo posible, hemos alineado esta XSD con los estándares incluidos en la norma ISO 20022.

Todos los archivos que entren y salgan serán validados según el esquema XML correspondiente al tipo de archivo concreto de acuerdo con la tabla siguiente.

Componente del mensaje	Tipo de archivo presentado	Dirección desde el punto de vista del sistema MDP	Base ISO 20022 identificador de definición de mensaje/identificador CNMV
Encabezado de Aplicación de Negocio	All	Entrada / Salida	head.001.001.01
Encabezado de Mensaje de Negocio	All	Entrada / Salida	head.003.001.01
Datos de informe de posición de derivados sobre materias primas	DATCPR	Entrada	composrpt.v1_9
Archivo de información	FDBCPR	Salida	auth.031.001.01

XPaths

En la tabla siguiente se describe cómo los Xpaths alinean los campos de información para la presentación del estado de posición.

N.º de campo	Nombre del campo	Xpath base /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/NEWT o /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/AMND o /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/CANC
1	Fecha y hora de presentación del informe	/CPRBody/RptDt
2	Número de referencia del informe	/ReportRefNo
3	Fecha del día de negociación de la posición comunicada	/CPRBody/BusDt

N.º de campo	Nombre del campo	Xpath base /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/NEWT o /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/AMND o /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/CANC
4	Estado del informe	/FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/NEWT/ or /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/CANC/ or /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/AMND/
5	ID de la entidad notificante	/CPRBody/RptEnty/NationalID/Othr/SchmeNm/Prtry (values can be CONCAT or NIDN or CCPT) /CPRBody/RptEnty/NationalID/Othr/Id (values per the definition of CONCAT or NIDN or CCPT) or /CPRBody/RptEnty/LEI (value per the definition of an LEI)
6	ID del titular de la posición	/CPRBody/PstnHldr/NationalID/Othr/SchmeNm/Prtry (values can be CONCAT or NIDN or CCPT) /CPRBody/PstnHldr/NationalID/Othr/Id (values per the definition of CONCAT or NIDN or CCPT) or /CPRBodyPstnHldr/LEI (value per the definition of an LEI)
7	Correo electrónico del titular de la posición	/CPRBody/PstinHldrCntctEml
8	ID de la entidad matriz última	/CPRBody/PstnHldr/NationalID/Othr/SchmeNm/Prtry (values can be CONCAT or NIDN or CCPT) /CPRBody/PstnHldr/NationalID/Othr/Id (values per the definition of CONCAT or NIDN or CCPT) or /CPRBodyPstnHldr/LEI (value per the definition of an LEI)
9	Correo electrónico de la entidad matriz última	/CPRBody/ParentPstinHldrCntctEml
10	Situación de la matriz de una institución de inversión colectiva	/CPRBody/PstinHldrIslpdtInd
11	Código identificador del contrato negociado en centros de negociación	/CPRBody/ISIN
12	Código de producto del centro	/CPRBody/VenProdCde
13	Identificador del centro de negociación	/CPRBody/TrdngVenID
14	Tipo de posición	/CPRBody/PstnTyp
15	Vencimiento de la posición	/CPRBody/PstnMtrty

N.º de campo	Nombre del campo	Xpath base /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/NEWT o /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/AMND o /FinInstrmRptgTradgComPosRpt/CPR/CANC
16	Cantidad de posiciones	/CPRBody/PstnQty
17	Notación de la cantidad de la posición	/CPRBody/PstnQtyUoM /CPRBody/PstnQtyUoMDesc
18	Cantidad de posiciones en delta equivalente	/CPRBody/DeltaPstnQty
19	Indicador de si la posición reduce riesgos en relación con la actividad comercial	/CPRBody/RiskRdclnd

Mensajes XML

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



composrpt.v1_9.xsd

Las XSD conforme a ISO 20022 son:

- Para el feedback



DRAFT5auth.031.001.01_ESMAUG_Reporting_1.0.2.xsd

- Para la cabecera



head.001.001.01_ESMAUG_1.0.0.xsd



head.003.001.01.xsd

Anexo 2: Convenciones de asignación de nombres de archivo

Entidad que presenta la comunicación a MDP

El nombre de archivo de los archivos XML presentados a la CNMV debe observar la siguiente convención de asignación de nombres:

<Sender>_<FileType>_<Recipient>_<SeqNo>-<Version>-<PreviousSeqNo>_<Year>.xml

La entidad que presenta la comunicación archiva este fichero XML en un ZIP y lo carga en la carpeta apropiada (DATCPR) dentro de la carpeta "Entrantes" del sistema MDP. Su nombre debe coincidir con el del fichero archivado y observar la siguiente convención de asignación de nombres:

<Sender>_<FileType>_<Recipient>_<SeqNo>-<Version>-<PreviousSeqNo>_<Year>.zip⁵

Componente	Definición	Valor
<Sender>	Identificador de la entidad que envía el archivo a la CNMV. Si se trata de una firma de inversión, será el LEI de la entidad precedido de I. Si se trata de un centro de negociación, será el MIC conforme con ISO 10383 de dicho centro precedido de T.	Ixxxxxxxxxxxxxxxxxxxxx Txxxx
<FileType>	Atributo de 6 caracteres que identifica el tipo de información contenida en el archivo. Para los informes de posición, será DATCPR.	DATCPR
<Recipient>	Atributo de 5 caracteres que identifica la NCA del receptor. En el caso de la CNMV, es NCAES.	NCAES
<SeqNo>	Número de secuencia de 6 dígitos precedido de ceros que sirve para identificar de forma inequívoca la presentación ante la entidad que la presenta. La primera presentación será 000001 y la cifra se irá incrementando para las siguientes presentaciones (de 999999 volverá a pasar a 000001). La secuencia se reinicia cada año.	nnnnnn e.g. 000042
<Version>	Número de un solo dígito que sirve para indicar la versión de la presentación. Siempre debería ser 0 a menos que el archivo de presentación anterior haya sido rechazado, en cuyo caso el número de versión de la nueva presentación será 1.	n

⁵ De conformidad con ITS 4, "centro de negociación" debe interpretarse como "MIC de segmento para las posiciones comunicadas respecto a contratos dentro del centro. Cuando no exista un MIC de segmento, hay que utilizar el MIC operativo".

Componente	Definición	Valor
<PreviousSeqNo>	Número de secuencia de 6 dígitos de la presentación anterior. Se utiliza para garantizar un procesamiento secuencial estricto de las presentaciones. Nota: cuando una presentación da error y debe ser reenviada con un número de versión incrementado, el <PreviousSeqNo> debe coincidir con el de la presentación fallida, es decir, representar la última presentación aceptada. El primer <PreviousSeqNo> será 000000, y este número no volverá a utilizarse.	nnnnnn
<Year>	Los últimos dos dígitos del año en el que se generó el archivo. Por ejemplo, para un archivo creado durante 2018 el año será 18	nn

MDP a entidad que presenta la comunicación

El sistema MDP generará un archivo de información para cada presentación con nombre correcto recibida. Se seguirá la siguiente convención de asignación de nombre:

<Sender>_<FileType>_<Recipient>_<SeqNo>_<Year>.zip

El archivo ZIP contendrá un único archivo XML con el mismo nombre:

<Sender>_<FileType>_<Recipient>_<SeqNo>_<Year>.xml

Componente	Definición	Valor
<Sender>	Atributo de 5 caracteres que identifica el NCA del receptor. En el caso de la CNMV, es NCAES.	NCAES
<FileType>	Atributo de 6 caracteres que identifica el tipo de información contenida en el archivo. Para los archivos de información de estados de posición, será FDBCPR.	FDBCPR
<Recipient>	Identificador de la entidad que envía el archivo original a la CNMV. Será el <Sender> de la presentación o las presentaciones a las que hace referencia la información. Si se trata de una firma de inversión, será el LEI de la entidad precedido de I. Si se trata de un centro de negociación, será el MIC conforme con ISO 10383 de dicho centro precedido de T.	Ixxxxxxxxxxxxxxxxxxxx Txxxx
<SeqNo>	Número de secuencia de 6 dígitos precedido de ceros que sirve para identificar el archivo de información.	nnnnnn e.g. 000042
<Year>	Los últimos dos dígitos del año en el que se generó el archivo. Por ejemplo, para un archivo creado durante 2018 el año será 18	nn

Anexo 3: Normas de validación

Normas de validación de archivos

En la tabla siguiente se muestran las normas de validación de archivos que se aplicarán a las presentaciones de estados de posición de derivados sobre materias primas. Las normas se ejecutarán en el orden en el que aparecen en la tabla.

Si se recibe un error (FIL-XXX) en el archivo de información, esto indica que el MDP ha conservado el nombre del archivo ZIP. Si se utiliza el mismo nombre de archivo para la nueva presentación, ésta será rechazada por tener un nombre de archivo duplicado (FIL-107).

Control	Referencia del error	Mensaje de error	Medida correctora
El archivo no se puede descomprimir	FIL-101	El archivo no se puede descomprimir	Comprobar la compresión y volver a presentarlo
El archivo descomprimido no contiene exactamente un archivo XML	FIL-102	El archivo contiene más de un archivo XML	Corregir la estructura del archivo y volver a presentarlo
El nombre del archivo XML dentro del archivo ZIP no coincide con el nombre del archivo ZIP	FIL-103	El nombre del archivo XML no coincide con el nombre del ZIP que lo contiene	Corregir el nombre del archivo y volver a presentarlo
El archivo no puede tener el mismo nombre que un archivo ya enviado	FIL-107	El archivo <Filename> ya se envió en otra ocasión	Corregir el nombre del archivo y volver a presentarlo
El número de secuencia anterior no fue el último número de secuencia procesado con éxito	GBX-020	El número de secuencia anterior no fue el último número de secuencia procesado	Comprobar la secuencia de nombre de archivo y corregir el nombre de archivo
La presentación a la que hace referencia el número de secuencia anterior debe haberse recibido Esto también significa que la primera presentación recibida y/o aceptada debe tener un número de secuencia anterior de 000000	FIL-109	No se ha recibido el archivo correspondiente al número de secuencia de archivo anterior	Determinar por qué falta el archivo y tomar las medidas apropiadas (por ejemplo, volver a presentar el archivo faltante o volver a presentar el archivo con el número de secuencia de archivo anterior correcto)

Control	Referencia del error	Mensaje de error	Medida correctora
<p>El número de versión de una presentación corregida no es superior al de la última versión procesada</p> <p>O el número de versión recibido la primera vez que es presentado un nombre de archivo no es cero</p>	GBX-030	El número de versión anterior no fue el último número de versión procesado	Determinar cuál es el número de versión correcto y corregir el nombre de archivo
Solo puede aceptarse una versión de cada presentación	FIL-108	Ya se ha aceptado una versión anterior del archivo	Determinar si el contenido se incluyó en un archivo aceptado anteriormente y, si no es así, volver a presentarlo en un nuevo archivo en lugar de "Comprobar el resultado de la validación"
Verificar que el archivo recibido se adecúa al esquema XML correspondiente	FIL-105	La estructura del archivo no coincide con el esquema XML: [resultado de validación XML]	Comprobar el resultado de la validación (debe corresponderse con los formatos definidos en las instrucciones de presentación de información) y volver a enviar el archivo

Control	Referencia del error	Mensaje de error	Medida correctora
El identificador de mensaje conforme a la CNMV o ISO 20022 del BAH (*.xsd) no es válido	FIL-104	El identificador de mensaje conforme a ISO 20022 del BAH debe hacer referencia al último esquema aprobado	Corregir el identificador del mensaje de conformidad con el último esquema XSD

En la tabla siguiente se describe qué estados de archivo se utilizarán junto con los errores de archivo para rellenar el archivo de información.

Estado de archivo	Definición	Información complementaria
ACPT	Aceptado	El archivo ha sido aceptado, todo el contenido ha sido validado con éxito.
PART	Aceptado parcialmente	El archivo ha sido aceptado, pero no todo el contenido ha sido validado con éxito (algunos informes de posición pueden estar retenidos o haber sido rechazados).
RJCT	Rechazado	El archivo al completo ha sido rechazado y ninguno de sus contenidos ha sido procesado. Este estado de archivo está asociado con los siguientes códigos de error de archivo: FIL-102, FIL-103, FIL-104, FIL-105, FIL-107, FIL-108, GBX020, GBX030. Este estado también se utiliza si todos los informes de posición del archivo han sido rechazados tras la validación de contenidos. En este caso no habrá ningún código de error de archivo asociado.
CRPT	Archivo corrupto	El archivo no se puede abrir. Este estado de archivo está asociado con el siguiente código de error de archivo: FIL-101.
RMDR	Recordatorio	Este estado se utiliza si el MDP no ha recibido un archivo con el correspondiente número de secuencia de archivo anterior. Este estado de archivo está asociado con el siguiente código de error de archivo: FIL-109.

Normas de validación de contenidos

En la tabla siguiente se describen las normas de validación de contenidos que se aplicarán a todas las posiciones de derivados sobre materias primas presentadas en un archivo válido.

Campo	Norma de validación	Código de error	Texto del error
1	La fecha/hora de la presentación debe ser igual o anterior a la fecha/hora del sistema	CPR-901	La fecha de presentación del informe no puede ser una fecha futura
1	La fecha de presentación no puede ser anterior a la fecha de aplicación de MiFID II: 03/01/2018	CPR-902	La fecha de presentación del informe no puede ser anterior al 03/01/2018
3	La fecha de negociación debe ser igual o anterior a la fecha/hora del sistema	CPR-903	La fecha del día de negociación no puede ser una fecha futura
3	La fecha de negociación no puede ser anterior a la fecha de aplicación de MiFID II: 03/01/2018	CPR-904	La fecha del día de negociación no puede ser anterior al 03/01/2018
3	La fecha de negociación no puede ser anterior a cinco años antes de la fecha actual	CPR-905	No pueden haber pasado más de cinco años desde el día de negociación y la fecha actual
4	El estado "nuevo" (NEWT) solo se puede utilizar para la primera presentación de un informe de posición o cuando el último informe procesado con éxito con la misma clave única que el NEWT tenga estado "cancelado" (CANC)	CPR-906	El valor (NEWT) del campo "Estado del informe" no es válido
4	El estado "modificado" (AMND) solo se puede utilizar cuando el último informe procesado con éxito con la misma clave única que el AMND tenga estado NEWT o AMND	CPR-907	El valor (AMND) del campo "Estado del informe" no es válido
4	El estado CANC solo se puede utilizar cuando el último informe procesado con éxito con la misma clave única que el CANC tenga estado NEWT o AMND	CPR-908	El valor (CANC) del campo "Estado del informe" no es válido
5	Si se utiliza un LEI, este campo se rellenará con un LEI con el formato adecuado y que esté en la base de datos de LEI incluida en la base de datos Fundación Global Identificador de Entidad Jurídica (GLEIF). El estado del LEI será "Emitido", "Suspendido", "Pendiente de transferir" o "Pendiente de archivar". La fecha de registro inicial del LEI será igual o anterior a la fecha de negociación. El estado de la entidad debe ser activo. Si el estado de la entidad es inactivo, la fecha de la última actualización será igual o posterior a la fecha de negociación.	CPR-909	El LEI de la entidad notificante no es válido o no es válido para la fecha de negociación
5	Si se utiliza un identificador nacional, los primeros dos caracteres del código de identificación nacional deben ser un código de país de conformidad con ISO 3166 válido en la fecha de negociación.	CPR-910	El código de identificación nacional de la entidad notificante no incluye un código de país válido

5	<p>En caso de utilizar un código CONCAT, solo están permitidos los caracteres siguientes: letras mayúsculas del alfabeto latino, números, #. Debe ser una cadena de exactamente 20 caracteres en la que los dos primeros caracteres sean letras, los ocho siguientes sean números y los caracteres restantes sean letras o #, siendo letras el 11.º y el 16.º caracteres.</p> <p>En caso de utilizar un número de identificación nacional o número de pasaporte, solo están permitidos los caracteres siguientes: letras mayúsculas del alfabeto latino (A-Z), números (0-9), así como "+" y "-" si el identificador comienza por "FI" y "-" si el identificador empieza por "LV". Puede ser una cadena de 3 a 35 caracteres, en la que los dos primeros caracteres sean letras.</p>	CPR-911	El formato del código de identificación de la entidad notificante no es correcto
6	<p>Si se utiliza un LEI, este campo se rellenará con un LEI con el formato adecuado y que esté en la base de datos de LEI incluida en la base de datos GLEIF mantenida por la unidad operativa central.</p> <p>El estado del LEI será "Emitido", "Suspendido", "Pendiente de transferir" o "Pendiente de archivar".</p> <p>La fecha de registro inicial del LEI será igual o anterior a la fecha de negociación.</p> <p>El estado de la entidad será activo o, en caso de ser inactivo, la fecha de la última actualización será igual o posterior a la fecha de negociación.</p>	CPR-912	El LEI del titular de la posición no es válido o no es válido para la fecha de negociación
6	<p>Si se utiliza un identificador nacional, los primeros dos caracteres del código de identificación nacional deben ser un código de país de conformidad con ISO 3166 válido en la fecha de negociación.</p>	CPR-913	El código de identificación nacional del titular de la posición no incluye un código de país válido
6	<p>En caso de utilizar un código CONCAT, solo están permitidos los caracteres siguientes: letras mayúsculas del alfabeto latino, números, #. Debe ser una cadena de exactamente 20 caracteres en la que los dos primeros caracteres sean letras, los ocho siguientes sean números y los caracteres restantes sean letras o #, siendo letras el 11.º y el 16.º caracteres.</p> <p>En caso de utilizar un número de identificación nacional o número de pasaporte, solo están permitidos los caracteres siguientes: letras mayúsculas del alfabeto latino (A-Z), números (0-9), así como "+" y "-" si el identificador comienza por "FI" y "-" si el identificador empieza por "LV". Puede ser una cadena de 3 a 35 caracteres, en la que los dos primeros caracteres sean letras.</p>	CPR-914	El formato del código de identificación del titular de la posición no es correcto

8	<p>Si se utiliza un LEI, este campo se rellenará con un LEI con el formato adecuado y que esté en la base de datos de LEI incluida en la base de datos GLEIF mantenida por la unidad operativa central.</p> <p>El estado del LEI será "Emitido", "Suspendido", "Pendiente de transferir" o "Pendiente de archivar".</p> <p>La fecha de registro inicial del LEI será igual o anterior a la fecha de negociación.</p> <p>El estado de la entidad debe ser activo. Si el estado de la entidad es inactivo, la fecha de la última actualización será igual o posterior a la fecha de negociación.</p>	CPR-915	El LEI de la entidad matriz última no es válido o no es válido para la fecha de negociación
8	Si se utiliza un identificador nacional, los primeros dos caracteres del código de identificación nacional deben ser un código de país de conformidad con ISO 3166 válido en la fecha de negociación.	CPR-916	El código de identificación nacional de la entidad matriz última no incluye un código de país válido
8	<p>En caso de utilizar un código CONCAT, solo están permitidos los caracteres siguientes: letras mayúsculas del alfabeto latino, números, #. Debe ser una cadena de exactamente 20 caracteres en la que los dos primeros caracteres sean letras, los ocho siguientes sean números y los caracteres restantes sean letras o #, siendo letras el 11.º y el 16.º caracteres.</p> <p>En caso de utilizar un número de identificación nacional o número de pasaporte, solo están permitidos los caracteres siguientes: letras mayúsculas del alfabeto latino, números (0-9), así como "+" y "-" si el identificador comienza por "FI" y "-" si el identificador empieza por "LV". Puede ser una cadena de 3 a 35 caracteres, en la que los dos primeros caracteres sean letras.</p>	CPR-917	El formato del código de identificación de la entidad matriz última no es correcto
11	El código identificador comunicado para el contrato debe ser válido para el día de negociación comunicado	CPR-918	El ISIN del contrato no es válido o no es válido para la fecha de negociación
13	<p>El código MIC debe ser un código MIC válido de conformidad con ISO 10383 que indique un centro de negociación activo en la fecha de negociación</p> <p>Esta norma no es aplicable a los códigos MIC especiales "XXXX" y "XOFF"</p>	CPR-921	El MIC del centro de negociación no es válido o no es válido para la fecha de negociación
15	El vencimiento de la posición debe ser igual que SPOT si el tipo de posición es uno de los valores siguientes: "EMIS" o "SDRV"	CPR-922	El vencimiento de la posición de los contratos EMIS y SDRV debe comunicarse como SPOT
17	Si la notación de cantidad de la posición no es UNIT o LOTS, debe proporcionarse un valor alternativo	CPR-923	Debe proporcionarse una notación
17	La opción de texto libre {ALPHANUM-25} para la notación no debe ser igual que "UNIT" o "LOTS"	CPR-924	La notación proporcionada de cantidad de la posición no es válida
17	La opción de texto libre {ALPHANUM-25} para la notación no debe estar en blanco si la notación es "LOTS" o "UNIT"	CPR-927	Solo debe proporcionarse una notación

18	La cantidad de posiciones en equivalente delta debe rellenarse si el tipo de posición es "OPTN". Este campo es opcional si el tipo de posición es EMIS y debe rellenarse si el instrumento es una opción sobre un título de emisión.	CPR-925	El campo "Cantidad de posiciones en equivalente delta" debe rellenarse si el tipo de posición es OPTN
18	La cantidad de posiciones en equivalente delta debe dejarse en blanco si el tipo de posición es cualquiera de los valores siguientes: "FUTR", "SDRV" u "OTHR"	CPR-926	El campo "Cantidad de posiciones en equivalente delta" debe dejarse en blanco si el tipo de posición es FUTR, SDRV u OTHR

En la tabla siguiente se muestran posibles estados de registros utilizados para rellenar la información sobre estados de posición de derivados sobre materias primas.

Código de estado	Nombre	Definición	Uso en informes por parte de entidades que presentan comunicaciones
ACPT	Aceptado	El informe ha sido aceptado	No se utiliza
RJCT	Rechazado	El informe ha sido rechazado	Se utiliza en caso de que el informe de posición sea incorrecto. Deben proporcionarse en el elemento complejo RcrdSts los códigos de error que indiquen las normas de validación que han dado error (códigos CPR-NNN).
RCVD	Recibido	El informe ha sido recibido y está a la espera de ser validado	Se utiliza en caso de que el informe de posición no pueda ser validado porque todavía no hay disponibles datos de referencia para el día de negociación al que haga referencia la posición (los datos de referencia para el día T se proporcionan el día T+1). El código de estado RCVD solo se incluye en las estadísticas del archivo de información de estado.