



GUÍA OPERATIVA DE LA COMUNICACIÓN DE INTERNALIZADORES DE LA LIQUIDACIÓN (ART. 9 CSDR)

6 de Junio de 2019

ÍNDICE

GLOSARIO	4
1 CUESTIONES GENERALES	5
1.1 INTRODUCCIÓN	5
1.2 LEGISLACIÓN APLICABLE	5
1.3 OBJETIVO DE LA COMUNICACIÓN DE OPERACIONES	6
1.4 USUARIOS DE LA GUIA DE COMUNICACIÓN DE OPERACIONES	6
2 GUIA OPERATIVA	7
2.1 CONTENIDO	7
2.2 ENTIDADES OBLIGADAS A REMITIR INFORMACIÓN A LA CNMV	7
2.3 INFORMES A REMITIR	7
2.4 SISTEMA DE COMUNICACION DE OPERACIONES A LA CNMV	8
3 CANALES DE COMUNICACIÓN	9
3.1 ENTIDADES QUE COMUNICAN POR SUS PROPIOS MEDIOS	9
3.2 ENTIDADES QUE COMUNICAN A TRAVES DE OTRAS	10
4 REMISION DE FICHEROS A LA CNMV	12
4.1 FORMATO	12
4.2 CONVENCION DE NOMBRES	12
4.3 NORMAS GENERALES EN EL ENVIO DE FICHEROS	15
4.4 FLUJO DE INTERCAMBIO DE FICHEROS	16
5 VERIFICACION DE FICHEROS	17
5.1 VALIDACIONES A NIVEL DE FICHERO Y ENTIDAD	17
5.2 VALIDACIONES DE CONTENIDO	18
6 INFORMACIÓN DEL RESULTADO DE LA VERIFICACION	19
7 PLAN DE PRUEBAS CNMV	20
7.1 AMBITO DEL PLAN DE PRUEBAS	20

7.2	DESCRIPCION DEL PLAN DE PRUEBAS	20
7.3	CALENDARIO Y ORGANIZACIÓN DEL PLAN	21

GLOSARIO

CNMV	Comisión Nacional del Mercado de Valores
CIFRADO	Sistema de cifrado y firma electrónica para la remisión y trámite por vía telemática de documentos ante la CNMV
CIL	Trámite electrónico de comunicación trimestral de operaciones con liquidación internalizada
CSDR	Reglamento (UE) 909/2014 sobre mejora de la liquidación de valores
CSV	Código seguro de verificación
ESMA	European Securities and Markets Authority
FDB	Ficheros de respuesta, <i>feedback</i> , remitidos por CNMV dando cuenta del resultado de la verificación
FNMT	Fábrica Nacional de Moneda y Timbre
ISO	International Organization for Standardization
PDF	Portable Document Format
T-CIL	Trámite electrónico de TEST para la comunicación trimestral de operaciones con liquidación internalizada
UE	Unión Europea
XML	Extended Marked-Up Language
XSD	XML Schema Definition

1 CUESTIONES GENERALES

1.1 INTRODUCCIÓN

La obligación impuesta por el artículo 9 del CSDR (Reglamento (UE) 909/2014¹) a los internalizadores de la liquidación de comunicar trimestralmente a su autoridad competente el volumen y valor agregado de todas las operaciones con valores que liquiden al margen de los sistemas de liquidación de valores entró en vigor el 10 de marzo de 2019, de acuerdo con lo previsto en el artículo 3 del Reglamento Delegado (UE) 2017/391² y en el apartado 1 del artículo 1 del Reglamento de Ejecución (UE) 2017/393³.

El primer informe, correspondiente a las operaciones liquidadas durante el segundo trimestre natural de 2019, habrá de remitirse tan pronto como esté operativo el sistema CIL/CNMV, de lo que se informará a las entidades con antelación.

La Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) publica esta guía operativa de la comunicación de internalizadores de la liquidación con el objetivo de informar y ayudar a las entidades de servicios de inversión, entidades de crédito y sucursales en España de entidades extracomunitarias sujetas a esta obligación en la parte relativa a los requisitos de acceso a los sistemas desarrollados por la CNMV, los canales de comunicación disponibles, la convención de nombres de los ficheros, la operativa en el intercambio de información, así como las validaciones y restricciones específicas implementadas por la CNMV y ESMA.

1.2 LEGISLACIÓN APLICABLE

La obligación de comunicación resulta del primer apartado del artículo 9 del CSDR: ‘Los internalizadores de la liquidación informarán trimestralmente a las autoridades competentes sobre el volumen y el valor agregados de todas las operaciones con valores que liquiden al margen de los sistemas de liquidación de valores’.

El mismo reglamento, en su artículo 2, apartado 1.(11) define al internalizador de la liquidación como ‘cualquier entidad, incluidas las autorizadas con arreglo a la Directiva 2013/36/UE⁴ o a la Directiva 2014/65/UE⁵ que ejecute órdenes de transferencia por cuenta de clientes o por cuenta propia por medios distintos de un sistema de liquidación de valores’.

¹ Reglamento (UE) N° 909/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo de 23 de julio de 2014 sobre la mejora de la liquidación de valores en la Unión Europea y los depositarios centrales de valores y por el que se modifican las Directivas 98/26/CE y 2014/65/UE y el Reglamento (UE) n o 236/2012.

² Reglamento Delegado (UE) 2017/391 de la Comisión de 11 de noviembre de 2016 que completa el Reglamento (UE) n° 909/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo en lo que respecta a las normas técnicas de regulación por las que se especifica con mayor precisión el contenido de la información que debe comunicarse sobre las liquidaciones internalizadas.

³ Reglamento de Ejecución (UE) 2017/393 de la Comisión, de 11 de noviembre de 2016, por el que se establecen normas técnicas de ejecución en lo que respecta a las plantillas y los procedimientos para la notificación y transmisión de información sobre las liquidaciones internalizadas de conformidad con el Reglamento (UE) n° 909/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo.

⁴ Directiva 2013/36/UE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 26 de junio de 2013, relativa al acceso a la actividad de las entidades de crédito y a la supervisión prudencial de las entidades de crédito y las empresas de inversión, por la que se modifica la Directiva 2002/87/CE y se derogan las Directivas 2006/48/CE y 2006/49/CE.

⁵ 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.

El artículo 1 del Reglamento Delegado (UE) 2017/391 precisa el alcance de las operaciones objeto de información: a los efectos de su ámbito de aplicación se entenderá como instrucción de liquidación internalizada ‘toda instrucción de un cliente del internalizador de la liquidación de poner una cantidad de dinero a disposición del destinatario o de que se transfiera la titularidad o el derecho correspondiente a uno o varios valores mediante una anotación en un registro o de otra forma, y que el internalizador de la liquidación líquida en sus propios libros y no mediante un sistema de liquidación de valores’.

El artículo 2 del Reglamento Delegado (UE) 2017/391 detalla el contenido del informe a remitir cuyo formato e instrucciones de cumplimentación se encuentran en los anexos I y II del Reglamento de Ejecución (UE) 2017/393

[Las directrices de ESMA 5.1 a 5.3 sobre el Art.9 del CDSR](#) aclaran la normativa anterior, detallando criterios para considerar qué operaciones en concreto están incluidas en la obligación, la forma de cumplimentar los datos requeridos y qué entidades son sujeto de la obligación de remisión de información.

1.3 OBJETIVO DE LA COMUNICACIÓN DE OPERACIONES

La naturaleza de la liquidación internalizada de operaciones es análoga a las liquidaciones realizadas en sistemas de liquidación de valores y en buena parte sustitutiva de estas últimas. Es preciso contar con datos fiables del volumen de este tipo de operaciones para poder evaluar y tratar el riesgo que las operaciones liquidadas internamente pueden suponer.

1.4 USUARIOS DE LA GUIA DE COMUNICACIÓN DE OPERACIONES

Esta Guía se dirige a las unidades de sistemas de información, cumplimiento normativo y otras áreas involucradas en la liquidación de operaciones, responsables de asegurar que sus entidades cumplen con esta obligación de manera completa, puntual y correcta. Se recomienda por ello que las entidades adopten todas las medidas necesarias para conseguir y poder comprobar periódicamente su correcto cumplimiento. Asimismo, se recomienda nombrar a una persona responsable de la comunicación de operaciones con liquidación internalizada tanto ante la CNMV como a efectos internos, encargada de coordinar los diferentes departamentos potencialmente implicados en esta obligación.

Para facilitar esta labor la CNMV ha habilitado adicionalmente la siguiente dirección de correo para atender a las dudas de los usuarios sobre este tema: csdr.mercados@cnmv.es, enfocada fundamentalmente a resolver dudas técnicas sobre la aplicación de la normativa y otros aspectos de negocio, además del servicio de ayuda de la Sede Electrónica (sedecnmv@cnmv.es y teléfono 902 180 772), para resolver dudas sobre aspectos de la operativa trimestral del trámite CIL con la CNMV.

2 GUIA OPERATIVA

2.1 CONTENIDO

La guía operativa de la comunicación de internalizadores de la liquidación tiene como objeto orientar tanto a las Entidades obligadas como a las entidades que reportan en todo lo referente a los procedimientos técnicos necesarios para comunicarse con la CNMV, la correcta generación de ficheros de operaciones en formato XML bajo el estándar ISO 20022, la remisión de los mismos, el flujo de información entre las entidades que reportan y la CNMV, así como los controles y verificaciones necesarios para que la información de operaciones pueda ser incorporada correctamente en los sistemas de la CNMV.

Queda fuera del ámbito de esta Guía la descripción detallada de los elementos de información a incluir en cada informe trimestral, ya que tanto el formato XML como los contenidos a remitir han sido definidos a nivel de todas las autoridades competentes a través de la Autoridad Europea de Mercados y Valores (ESMA por sus siglas en inglés) ⁶.

El propósito principal de esta guía es facilitar la comprensión del sistema de remisión de información a la CNMV, conocer su funcionamiento y resolver posibles dudas o incidencias.

A lo largo de esta guía se describe el canal de comunicación que tienen las entidades para comunicar sus operaciones a la CNMV, el flujo de ficheros entre la entidad y la CNMV, la convención de nombres de ficheros, las reglas básicas de reporte, las verificaciones que lleva a cabo la CNMV sobre la información recibida y, finalmente, la gestión de errores por parte de la CNMV sobre la información remitida por las entidades.

2.2 ENTIDADES OBLIGADAS A REMITIR INFORMACIÓN A LA CNMV

Están obligadas a remitir la información solicitada a la CNMV las entidades cuyo Estado de origen es España o aquellas otras autorizadas en Terceros Estados no miembros de la Unión Europea que operan en territorio nacional mediante sucursal.

Las sucursales en España de entidades autorizadas en Estados Miembros de la Unión Europea no deberán enviar a la CNMV los informes sobre internalización de liquidación, si no que deberán dar cuenta de su actividad, a través de su matriz, a la Autoridad Competente de su Estado de origen.

2.3 INFORMES A REMITIR

Las entidades obligadas realizarán tantas remisiones de ficheros como sean necesarias para dar cuenta de las:

- Operaciones liquidadas internamente en territorio nacional por entidades cuyo estado miembro de origen sea España. Un fichero.

⁶ Se puede acceder a los ficheros XSD correspondientes y a ejemplos de XML que los cumplen a través del enlace *related XML files* del apartado *Internalised settlement reporting* de la página web de ESMA <https://www.esma.europa.eu/regulation/post-trading/settlement>

- Operaciones liquidadas internamente mediante sucursal en España por entidades de terceros países no pertenecientes a la Unión Europea. Un fichero
- Operaciones liquidadas internamente a través de sucursales en Estados Miembro de la Unión Europea. Un fichero por cada Estado Miembro.
- Operaciones realizadas mediante sucursales en Terceros Países, un fichero englobando toda la actividad.

En caso de que la entidad obligada no haya tenido actividad en alguno de los epígrafes anteriores, no será necesaria la remisión de fichero para tal caso.

2.4 SISTEMA DE COMUNICACION DE OPERACIONES A LA CNMV

La CNMV ha diseñado el trámite electrónico CIL que permitirá a las entidades comunicar su actividad de liquidación internalizada de un modo ágil y sencillo, recibir la respuesta a los ficheros remitidos en un plazo de tiempo corto, y gestionar las incidencias fácilmente, de modo que puedan reaccionar con diligencia y remitir sus ficheros en tiempo y forma.

3 CANALES DE COMUNICACIÓN

3.1 ENTIDADES QUE COMUNICAN POR SUS PROPIOS MEDIOS

ALTA EN EL SERVICIO CIFRADO/CNMV

La entidad que comunica las operaciones debe estar dada de alta previamente en el servicio CIFRADO/CNMV y disponer de un certificado electrónico de representante de persona jurídica válido en la CNMV.

Si la entidad no está dada de alta en CIFRADO/CNMV, el procedimiento detallado en <https://sede.cnmv.gob.es/sedecnmv/documentos/solicitudPJ.pdf> le servirá de guía.

Es preciso que la persona física firmante del fichero esté autorizada, bien de manera general, bien específicamente para realizar el nuevo trámite CIL - Comunicación trimestral de operaciones con liquidación internalizada del servicio CIFRADO/CNMV.

Si la entidad está dada de alta en CIFRADO/CNMV pero la persona física firmante del fichero no está autorizada a utilizar el trámite CIL, deberá solicitar la autorización a través de la Sede Electrónica de la CNMV (correo electrónico sedecnmv@cnmv.es, teléfono 902 180 772).

Se recomienda que la entidad obligada tenga más de un certificado de representante de persona jurídica y más de una persona con firma autorizada para enviar los ficheros en el nuevo trámite para evitar incumplir el plazo de remisión por cualquier tipo de incidencia.

Teniendo en cuenta que el proceso de alta en el Servicio CIFRADO/CNMV no es inmediato y suele tardar varios días se recomienda que las entidades actúen con la antelación necesaria para obtener los certificados requeridos y poder cumplir con su obligación en lo que respecta al plazo de remisión de las operaciones (máximo diez días hábiles desde el final del trimestre natural al que se refiere la información).

Adicionalmente al alta en el trámite CIL, la entidad deberá comunicar obligatoriamente las personas responsables tanto a nivel técnico (negocio) como a nivel operativo (IT) en el [Formulario de registro de Entidades Obligadas CSDR](#) y rellenar sus datos de contacto para que, en caso de incidencias, la CNMV pueda acudir a ellas sin demora. La información solicitada en el formulario deberá mantenerse permanentemente actualizada, remitiendo en caso necesario uno nuevo cuando se produzcan variaciones en la misma. El formulario deberá enviarse a la dirección de correo electrónico csdr.mercados@cnmv.es indicando en el campo asunto 'Formulario datos informe CSDR art. 9'.

REMISION A TRAVES DE LA SEDE ELECTRONICA DE LA CNMV

Una vez generado el fichero XML por la entidad y comprimido en formato ZIP, deberá ser firmado electrónicamente y remitido a la CNMV mediante el trámite CIL del servicio CIFRADO/CNMV.

Los pasos a seguir para la firma y posterior envío a la CNMV son los siguientes:

- Conectarse a la página web de la CNMV y entrar en el apartado: Sede Electrónica / Registro Electrónico, utilizando el certificado de representante de persona jurídica o el usuario y clave facilitados al darse de alta en el servicio.
- Seleccionar el trámite denominado: CIL (Comunicación trimestral de operaciones con liquidación internalizada).
- Siguiendo los pasos que se indican en la pantalla del trámite, seleccionar el fichero comprimido a enviar, firmarlo y enviarlo mediante el botón de Firmar y Enviar disponible en la página.
- Al recibirse el fichero en la CNMV, se enviará a la dirección de correo electrónico indicada en el formulario de firma un acuse de recibo en formato PDF. Este acuse de recibo únicamente indica que el fichero ha sido recibido y registrada su entrada en la CNMV, en ningún caso que la información contenida sea formalmente válida, lo que se verificará en un paso posterior.
- Si el envío ha sido correcto, el fichero PDF de “acuse de recibo” contendrá la fecha y hora de presentación y número de registro de entrada. También incluirá un código CSV (Código Seguro de Verificación) cuyo objeto es poder verificar la autenticidad del acuse de recibo remitido por la CNMV.
- 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, se enviará a la dirección o direcciones de correo previamente habilitadas por la Entidad 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 el remitente pueda subsanarlos y proceder al reenvío de las rectificaciones, en apartados posteriores se describe las validaciones realizadas y los códigos de error que se pueden generar.

3.2 ENTIDADES QUE COMUNICAN A TRAVES DE OTRAS

Las entidades obligadas podrán delegar la remisión de información en terceras entidades, siempre que éstas sean también entidades obligadas al reporte del Art. 9 CSDR y se encuentren dadas de alta en CIFRADO. Al igual que las que presentan la información por sus propios medios deberán remitir inicialmente, y mantener actualizada, la información solicitada a través del [Formulario de registro de Entidades Obligadas CSDR](#) anteriormente mencionado mediante su envío al buzón de correo csdr.mercados@cnmv.es e indicando como asunto ‘Formulario datos informe CSDR art. 9’. Dentro la información recabada se encuentra la relativa a la existencia de delegación e identidad de la entidad en la que se delega. En el correo, además del formulario cumplimentado, deberá enviarse documentación acreditativa del contrato de delegación y de la capacidad de los intervinientes para celebrarlo.

La responsabilidad sobre la información remitida continuará siendo de la entidad obligada que deberá establecer los controles necesarios para asegurarse de que es correcta y completa y, en su caso, que realizará las modificaciones oportunas.

No podrá comunicarse el inicio, cese o variaciones en la delegación mientras existan ficheros que hacen referencia a la entidad delegante para los que no hayan finalizado los procedimientos de verificación.

4 REMISION DE FICHEROS A LA CNMV

4.1 FORMATO

Los ficheros remitidos estarán comprimidos en formato ZIP y cada uno incluirá tan sólo un fichero XML que cumpla con el formato de mensaje ISO 200022 y las estructuras de los mismos según [los esquemas XML publicados por ESMA](#). El fichero ZIP y el XML tendrán idéntico nombre, excluida la extensión.

4.2 CONVENCION DE NOMBRES

NOMBRES DE FICHEROS REMITIDOS A LA CNMV

La denominación de cada fichero resultará de la concatenación de los siguientes campos:

Denominación de campo	Valor a Concatenar	Observaciones
LEI_REMITENTE	LEI de la entidad que remite el fichero (20 caracteres)	De la entidad delegada si hay delegación en la remisión de archivos o, en caso contrario, de la propia entidad obligada.
Guion bajo	-	
TIPO_FICHERO	DATISR	Siempre tendrá este valor
Guion bajo	-	
OBLIG_INFORMACIÓN	CSDR9	Siempre tendrá este valor
Guion bajo	-	
PAIS_SUCURSAL	Código ISO 3166 Alpha-2 del país de la sucursal o "TS"	Código correspondiente al país de la UE donde prestan servicio las sucursales de cuya liquidación internalizada se informa. Será TS si informa de la actividad agrupada de todas las sucursales en terceros países no miembros de la UE.
Guion medio	-	
LEI_OBLIGADA	LEI de la entidad obligada, de la que se da cuenta de la información en el fichero	Será distinto de LEI_REMITENTE si la entidad obligada ha delegado en la entidad remitente la obligación de remisión.
Guion medio	-	
Año	YYYY	Año al que hace referencia la actividad que se informa.
Guion medio	-	
Trimestre	Q1, Q2, Q3 o Q4	Trimestre al que hace referencia la

		actividad que se informa QX, donde X será 1,2,3 o 4 según se informe del primer, 2º, 3er o 4º trimestre
Guion bajo	-	
Versión	Valor numérico de la versión del fichero con 4 dígitos y rellenando con ceros por la izquierda (0001..9999)	Número de la versión del fichero que hace referencia exactamente a la misma sucursal, entidad, año y trimestre.

La extensión del fichero será la correspondiente según se trate de un fichero comprimido o de un XML.

La siguiente tabla contiene ejemplos de nombres de ficheros, excluida su extensión:

Nombre Fichero	Descripción
AA3800E5JT257M7W5O29_DATISR_CSDR9_ES-AA3800E5JT257M7W5O29-2019-Q2_0001	Primera versión remitida del fichero que hace referencia a la actividad total prestada en España de la entidad con LEI AA...O29 en el segundo trimestre de 2019. La entidad remitente es la misma que aquella a la que hace referencia la información, no existe delegación.
AA3800E5JT257M7W5O29_DATISR_CSDR9_ES-AA3800E5JT257M7W5O29-2019-Q2_0002	Segunda versión remitida por la entidad a la CNMV del fichero anterior.
AA3800E5JT257M7W5O29_DATISR_CSDR9_IT-AA3800E5JT257M7W5O29-2019-Q2_0001	Hace referencia a la actividad de la misma entidad, mismo año y mismo trimestre, pero por la totalidad de sus sucursales en Italia.
AA3800E5JT257M7W5O29_DATISR_CSDR9_TS-AA3800E5JT257M7W5O29-2019-Q2_0001	Hace referencia a la actividad de la misma entidad, mismo año y mismo trimestre, pero por la totalidad de sus sucursales en terceros países no miembros de la UE.
BB800E5JT257M7W5O52 _DATISR_CSDR9_ES-213800E5JT257M7W5O29-2019-Q2_0001	Existe delegación. Primera versión remitida por la entidad con LEI BB8.O52 que hace referencia a la actividad total prestada en España de la entidad con LEI AA...O29 en el segundo trimestre de 2019.

Los campos del *Business Application Header* (head.001.001.01) se cumplimentarán con los siguientes valores:

Nombre Campo	Valor
From	Código del país de España según la ISO 3166 Alpha-2. Siempre será "ES", de acuerdo al formato definido para este campo en el XSD head.001.001.1 <OrgId><Id><OrgId><Othr><Id>ES</Id></Othr></OrgId></Id></OrgId>
To	Siempre "EU", informado de acuerdo al formato definido para este campo en el XSD head.001.001.1 <OrgId><Id><OrgId><Othr><Id>EU</Id></Othr></OrgId></Id></OrgId>
Business Identifier	Message Se tomará del <u>nombre del fichero</u> según definición de la tabla anterior (sin la extensión) <u>a partir del campo PAIS_SUCURSAL (incluido), se eliminará el guion entre Año YYYY y el trimestre QX,</u> y se generará el <u>Identificador único del fichero de 35 caracteres.</u> Por ejemplo: ES-AA3800E5JT257M7W5O29-2019Q2_0001
Message Identifier	Definition Auth.072.001.01
Creation Date	Fecha y hora de creación del mensaje en formato ISO 8601

Una vez generado se comprimirá en formato ZIP. El nombre del fichero comprimido será el mismo que el XML pero con la extensión ZIP.

NOMBRES DE FICHEROS ENVIADOS POR LA CNMV

Una vez que un fichero ha sido correctamente recibido se somete a un conjunto de validaciones tanto de formato como de contenido en la CNMV y en ESMA. Terminado este proceso se genera un fichero XML de respuesta o *feedback* que se envía a la entidad remitente por correo electrónico.

El fichero de respuesta de la CNMV tendrá el mismo nombre que el fichero de origen en todos sus elementos excepto en el campo TIPO_FICHERO cuyo valor será siempre 'FDBISR'. Será un archivo ZIP que contendrá un único fichero XML conforme al formato de mensaje ISO 200022 y según el esquema XML correspondiente.

Un ejemplo de fichero *feedback* enviado por la CNMV sería:

AA3800E5JT257M7W5O29_ **FDBISR** _CSDR9_ES-AA3800E5JT257M7W5O29-2019-Q2_0001

En este caso el valor de los campos del *Business Application Header* será:

Nombre Campo	Valor
From	Siempre EU, informado de acuerdo al formato definido para este campo en el XSD head.001.001.1 <OrgId><Id><OrgId><Othr><Id>EU</Id></Othr></OrgId></Id></OrgId>
To	Siempre ES, informado de acuerdo al formato definido para este campo en el XSD head.001.001.1 <OrgId><Id><OrgId><Othr><Id>ES</Id></Othr></OrgId></Id></OrgId>
Business Identifier	Message Mismo valor que en el fichero remitido de cuya verificación se informa
Message Identifier	Definition Auth.031.001.01

4.3 NORMAS GENERALES EN EL ENVÍO DE FICHEROS

La remisión de ficheros a la CNMV se registrará por las siguientes normas generales:

❖ **Periodicidad de envío.** De acuerdo con el artículo 1.1 del Reglamento de ejecución (UE) 2017/393 los ficheros serán remitidos dentro de los diez días hábiles siguientes a la finalización de cada trimestre natural.

❖ **Periodos y sucursales sin liquidación internalizada.** No se remitirán ficheros para periodos y ámbitos territoriales en los que no se haya producido liquidación internalizada de operaciones.

No obstante, la CNMV podrá contactar con la entidad obligada para confirmar si efectivamente para el periodo y ámbito territorial no ha existido actividad de la que informar.

❖ **Validar fichero XML.** La entidad remitente deberá siempre validar el fichero XML contra sus esquemas XSD correspondientes antes de la compresión y envío a la CNMV.

❖ **Acuse de Recibo.** El fichero que devuelve el servicio CIFRADO/CNMV de forma automática por correo electrónico es un simple “acuse de recibo”, y significa que se ha recibido en la CNMV y se ha registrado la entrada del fichero firmado electrónicamente. Este acuse de recibo no contiene información alguna sobre la validez del contenido del fichero, que será comprobada en un proceso posterior.

❖ **Sede Electrónica.** En caso de que tras remitir un fichero la Entidad no reciba el Acuse de Recibo deberá contactar con la CNMV a través del Servicio de Atención al Usuario de la Sede Electrónica (Telf.: 902 180 772 - Correo electrónico: sedecnmv@cnmv.es) para informar de tal circunstancia.

❖ **Ficheros de tipo *feedback* remitidos por la CNMV.** El sistema CIL/CNMV generará un fichero de tipo *feedback* por cada fichero recibido con el resultado del proceso de incorporación y lo enviara a la entidad remitente, y obligada caso de existir delegación, para su información a la mayor brevedad posible.

❖ **Fichero recibido y procesado en la CNMV.** Una entidad no debe dar por procesado el fichero hasta que no reciba tanto el acuse de recibo como el correo electrónico con el archivo de *feedback* con la información del resultado del proceso de validación. Si no recibe estos mensajes, deberá contactar con la Sede Electrónica. Entre la remisión del fichero y la recepción de la contestación puede mediar cierto plazo ya que la información es validada tanto en la CNMV como en ESMA.

❖ **Control de versiones.** Los sucesivos ficheros remitidos referidos a una misma combinación ‘entidad obligada/territorio sucursal/periodo’ deberán tener un número de versión mayor que el de todos los enviados anteriormente. El campo *Report Status (RptSts)* del mensaje auth.072.001.01 debe informarse tanto en primera remisión como en las subsiguientes con el valor ‘NEWT’. Existe un control de versiones de los ficheros, de tal manera que no se admitirá un nuevo fichero con número de versión incrementada hasta que se haya procesado y comunicado a la entidad el resultado de la verificación mediante el archivo *feedback* correspondiente.

- ❖ **Modificación de información aceptada.** La remisión de un nuevo fichero relativo a 'entidad obligada/territorio sucursal/periodo' para la que ya se ha comunicado la aceptación por la CNMV dará como resultado un error salvo que se informe en el campo *Report Status (RptSts)* del mensaje auth.072.001.01 los valores 'AMND' (modificación) o 'CANC' (cancelación). En ambos casos se eliminará la información anteriormente remitida y, si se trata de una modificación, se iniciará de nuevo el proceso de validación. El número de versión deberá ser mayor que el del último fichero correspondiente a la misma combinación 'entidad obligada/territorio sucursal/periodo' (p.e si la información anteriormente aceptada se remitió en la versión '0003', la versión del fichero con la nueva información con indicativo 'AMND' o 'CANC' será al menos '0004')
- ❖ **Periodo de conservación de la información remitida.** Las entidades, tanto si comunican directamente como si lo hacen mediante delegación, están obligadas a guardar copia de la información remitida durante, al menos, diez años conforme a lo establecido en el primer apartado del artículo 29 de CSDR.

4.4 FLUJO DE INTERCAMBIO DE FICHEROS

El intercambio de ficheros entre la Entidad que reporta y la CNMV se describe como un sencillo flujo de ficheros de liquidaciones internalizadas con los consiguientes ficheros de respuesta de la CNMV. Está diseñado para facilitar de forma intuitiva la comunicación con la CNMV y proporcionar la información necesaria para reaccionar ante cualquier incidencia.

Los principios básicos de este intercambio de ficheros son los siguientes:

- ❖ **Acuse de Recibo de la CNMV.** La recepción de los ficheros ZIP será acreditada por el envío casi inmediato del acuse de recibo a la entidad que los remite. **Fichero XML de respuesta.** Una vez enviado un fichero y siempre que la entidad que lo remite haya recibido el acuse de recibo, el sistema CIL/CNMV procesará la información y remitirá su fichero de respuesta o *feedback* a través del correo electrónico indicado para tal fin. Este fichero de respuesta informa tanto sobre la existencia o no de errores en el proceso de incorporación como de los errores en su caso detectados. No se incorporarán parcialmente ficheros: si parte de la información remitida no supera los controles de validación, el fichero será rechazado íntegramente.
- ❖ **Operativa en casos excepcionales.** En el caso de que una Entidad no pueda remitir su información deberá ponerlo en conocimiento de la CNMV a través de la Sede Electrónica o a través del buzón de correo csdr.mercados@cnmv.es.

5 VERIFICACION DE FICHEROS

Los ficheros recibidos a través del sistema CIL/CNMV pasan por una serie de verificaciones previas a su incorporación. La primera fase de estas verificaciones se produce a la recepción del fichero y se centra en comprobar el tipo, formato, estructura y extensión del fichero, la convención de nombres, la identificación de la Entidad obligada y, si es distinta, de la remitente a través del código LEI, la coherencia entre la situación de delegación según el nombre del fichero y la comunicada a la CNMV; y el control de versiones de ficheros recibidos. Es preciso superar los controles de esta primera fase para comenzar a procesar el contenido del fichero en una segunda fase de verificación.

Si alguno de los controles de cualquiera de las fases de verificación da como resultado un error, éste será comunicado a la entidad a través del fichero XML de tipo *feedback* y el fichero será descartado: su contenido no será procesado ni incorporado a las bases de datos de la CNMV, debiendo la entidad remitir un nuevo fichero con su número de versión incrementado.

Las entidades deberán implantar las verificaciones que se referencian en los dos siguientes epígrafes con el fin de evitar errores que den lugar al intercambio de numerosos ficheros entre ellas y la CNMV.

5.1 VALIDACIONES A NIVEL DE FICHERO Y ENTIDAD

A continuación se enumeran las validaciones que se llevarán a cabo en esta primera fase y los distintos códigos de error a los que pueden dar lugar:

Errores relativos al nombre del fichero:

- ❖ ESX-110: El fichero no sigue la convención de nombres CNMV.
- ❖ ESX-111: El 'LEI_REMITENTE' no es válido, o no está registrado en la CNMV.
- ❖ ESX-112: El 'LEI_OBLIGADA' no es válido, o no está registrado en la CNMV.
- ❖ ESX-113: El código 'TIPO_FICHERO' no es válido.
- ❖ ESX-114: El código 'OBLIG_INFORMACIÓN' no es válido.
- ❖ ESX-115: El código de 'PAIS_SUCURSAL' no es válido
- ❖ ESX-116: El código 'Año' no es válido.
- ❖ ESX-117: El código de 'Trimestre' no es válido.
- ❖ ESX-118: El código de 'Versión' no es válido.

Errores de formato y estructura del fichero:

- ❖ FIL-101: El fichero ZIP no puede descomprimirse.
- ❖ FIL-102: El fichero ZIP no contiene un, y solo un, fichero.
- ❖ FIL-103: Los nombres del fichero ZIP y el fichero XML no coinciden.
- ❖ FIL-104: El campo 'Message Identifier' del BAH es erróneo.
- ❖ FIL-105: La estructura del fichero XML no es conforme al esquema XML esperado.

Errores en identificación de entidades intervinientes:

- ❖ ESX-120: El LEI de la entidad remitente según la firma electrónica no coincide con el indicado en el campo 'LEI_REMITENTE' del nombre del fichero.
- ❖ ESX-121: Discrepancia entre entidad obligada y remitente: no consta delegación de la entidad obligada en la entidad remitente, o bien el fichero se ha remitido por la entidad obligada habiéndose comunicado delegación en tercera entidad.

Errores relativos al fichero reportado:

- ❖ FIL-107: Existe un fichero con idénticos periodo/entidad/sucursal/versión ya tratado (fichero duplicado).
- ❖ ESX-122: Existe un fichero referido a mismos periodo/entidad/sucursal pendiente de verificación.
- ❖ ESX-123: La versión del fichero es menor a la del último recibido referido a idénticos periodo/entidad/sucursal.

Esta lista no es exhaustiva y por tanto es susceptible de ser completada en el futuro con otros códigos de error en base a otras validaciones.

Estos errores se remitirán a la entidad que envía el fichero, y caso de ser distinta, a la entidad obligada en un fichero XML de tipo *feedback* a través del correo electrónico facilitado a la CNMV.

5.2 VALIDACIONES DE CONTENIDO

La información recibida será sometida a una segunda fase de controles tras haberse superado los anteriores. Éstos consistirán principalmente en comprobar la coherencia entre los importes informados en los campos de un mismo registro, entre los cumplimentados en los registros correspondientes a totales con el detalle según los diferentes criterios de desagregación (por tipo de instrumento, de operación o de cliente) y entre la información correspondiente al total de la liquidación internalizada y la suma de los mismos conceptos por cada depositario central de valores contemplado en el fichero remitido.

El detalle de los controles aplicados puede consultarse en el apartado 7.2 del documento [*Technical Guidance for Settlement Internalisers-Report Validation Rules*](#), publicado por ESMA.

6 INFORMACIÓN DEL RESULTADO DE LA VERIFICACION

Finalizado el proceso de verificación tanto entidad remitente como, en su caso, obligada recibirán por correo electrónico un fichero de respuesta con el formato XML descrito. En su campo *Status* se informará del resultado final de la verificación conforme a los siguientes valores:

- ❖ ACPT – *Accepted*, el fichero ha superado todas las validaciones, ha sido aceptado y la información grabada.
- ❖ CRPT – *Corrupted File*, el fichero ZIP da error al descomprimirse, no contiene exactamente un fichero XML o los nombres de ZIP y XML no son idénticos. La información no ha sido grabada y la entidad remitente deberá remitir un nuevo fichero subsanando los errores detectados e incrementando el número de versión.
- ❖ RJCT – *Rejected*, el fichero no ha pasado alguna validación. La información no ha sido grabada y la entidad remitente deberá remitir un nuevo fichero subsanando los errores detectados e incrementando el número de versión.

Todos los errores detectados vendrán detallados en este fichero FDBISR. Según la fase donde se hayan detectado el error y el tipo del que se trate, el fichero puede contener información sobre uno o más errores.

7 PLAN DE PRUEBAS CNMV

7.1 AMBITO DEL PLAN DE PRUEBAS

La Guía Operativa de la Comunicación de Internalizadores de Liquidación a la CNMV establece el ámbito de las entidades obligadas a comunicar las operaciones, y serán éstas mismas las susceptibles de probar el sistema CIL/CNMV. El ámbito de las pruebas a realizar se ceñirá principalmente a la comunicación, recepción, validación e incorporación de ficheros a la CNMV, dejando fuera del mismo la comunicación entre la CNMV y ESMA, que se llevará a cabo en otro entorno de pruebas entre ESMA y las distintas autoridades nacionales.

La realización del Plan de Pruebas del sistema CIL/CNMV no es obligatoria para las entidades obligadas, aunque sí recomendable en la medida en que éstas quieran estar preparadas para realizar una correcta comunicación a la CNMV. Cada entidad podrá libremente realizar cuantas pruebas desee con la única restricción del marco temporal asignado en cada momento por la CNMV.

7.2 DESCRIPCION DEL PLAN DE PRUEBAS

Las pruebas que la CNMV establece como necesarias en cada una de las fases, y sin perjuicio de todas aquellas que las entidades puedan realizar por sus propios medios, son las siguientes:

- I. **Pruebas unitarias de la entidad.** Estas pruebas serán llevadas a cabo por cada entidad por sus propios medios, en base a la documentación y especificaciones técnicas de ESMA y de la CNMV publicadas y referenciadas en esta Guía. Entre otras serán la de generación de ficheros XML y validación contra los esquemas ESMA, compresión de ficheros, verificación de la convención de nombres y chequeo de formatos y extensiones.
- II. **Pruebas de integración con la CNMV.** Estas pruebas se llevarán a cabo con la CNMV y siguiendo las especificaciones detalladas en esta Guía. Incluyen el acceso al trámite de CIFRADO T-CIL (trámite TEST de la comunicación trimestral de internalizadores de liquidación), remisión de ficheros de prueba correctamente generados y formateados, recepción del acuse de recibo desde el trámite T-CIL así como la recepción posterior por parte de la CNMV de los ficheros FDBISR con el resultado del proceso del fichero de prueba.
- III. **Pruebas piloto en pre-producción.** Estas pruebas serán opcionales y dependerán en gran medida de la capacidad de la CNMV para conectar su entorno de pruebas con el entorno de pruebas de ESMA y la coincidencia de ambos entornos de prueba en cuanto al calendario, de modo que se lleve a cabo el testeo de las funcionalidades a través del circuito completo y participen todos los actores (entidades, CNMV y ESMA). Las funcionalidades a testear serán las mismas que en la Fase II anterior.

7.3 CALENDARIO Y ORGANIZACIÓN DEL PLAN

El ámbito temporal de realización del Plan de Pruebas del sistema CIL/CNMV tendrá lugar en dos periodos diferentes para realizar las pruebas de las distintas fases en las que intervienen tanto las entidades como la CNMV.

Las ventanas temporales definidas por la CNMV son:

- 1) Fase II: del 1 de Julio al 27 de Septiembre de 2019.
- 2) Fase III: del 2 de Septiembre al 27 de Septiembre de 2019.

Durante la realización del Plan de Pruebas los sistemas de la CNMV no funcionarán en modo completamente automático, por lo cual tanto los procesos de recepción de ficheros como los de validación y envío de respuestas a través de los ficheros de tipo “feedback” se regirán por procesos semiautomáticos que requerirán actuaciones manuales para supervisar el control de dichos procesos y el mejor desarrollo de las pruebas. Las respuestas a los ficheros podrán tener un retraso desde su recepción de entre unas pocas horas y unos pocos días.

Todas las entidades obligadas al reporte de estas operaciones bajo el artículo 9 del CSDR tendrán habilitado el trámite T-CIL en CIFRADO a través del cual podrán remitir sus ficheros de prueba. La información contenida en los mismos, sea su contenido veraz o no, no será tomada en cuenta a ningún efecto respecto a la supervisión de la CNMV, sino que servirá meramente para testear el funcionamiento del sistema CIL/CNMV a través de este Plan de Pruebas.

Finalmente, para atender las dudas de los usuarios durante la realización de las pruebas, se han habilitado los buzones csdr.mercados@cnmv.es, enfocado fundamentalmente a resolver dudas técnicas sobre la aplicación de la normativa y otros aspectos de negocio, además del servicio de ayuda de la Sede Electrónica (sedecnmv@cnmv.es y teléfono 902 180 772) para resolver dudas sobre aspectos de la operativa trimestral del trámite CIL con la CNMV.