



COMUNICACION DE OPERACIONES BAJO MiFIR. SCORE/CNMV: PLAN DE PRUEBAS

25 de septiembre de 2017

Índice

1. OBJETIVO	3
1.1. Descripción y propósito del Plan de Pruebas	3
1.2. Proyectos ESMA relacionados	4
2. DESCRIPCIÓN DEL PLAN	5
2.1. Ámbito	5
2.2. Fases del Plan	5
2.3. Descripción de las pruebas	6
2.4. Periodo de Pruebas	7
3. ORGANIZACIÓN DEL PLAN	8
3.1. Procedimiento de participación	8
3.2. Entorno de pruebas	8
3.3. Precondiciones del Plan de pruebas	9
3.4. Comunicación con la CNMV	9

1 OBJETIVO

1.1 DESCRIPCIÓN Y PROPÓSITO DEL PLAN DE PRUEBAS

A partir del 3 de enero de 2018 es de aplicación la obligación de comunicar las operaciones ejecutadas sobre instrumentos financieros prevista en el artículo 26 de la MiFIR (Reglamento 600/2014¹), en la que se establece que las empresas de servicios de inversión que ejecuten operaciones sobre instrumentos financieros deberán comunicar los datos completos y exactos de esas operaciones a la autoridad competente con la mayor brevedad, y a más tardar al cierre del siguiente día hábil.

El presente documento pretende ayudar a las entidades que van a comunicar operaciones bajo el ámbito de la MiFIR a través del sistema SCORE (System for Collecting Operations Reported by Entities), mediante el desarrollo de un Plan de Pruebas previo a la puesta en producción del sistema en la CNMV, que coincidirá con la entrada en vigor de la obligación de comunicación de operaciones.

Este Plan de Pruebas se dirige tanto a las entidades que vayan a comunicar por sus propios medios como a los Centros de Negociación -Mercados Regulados (MR), Sistemas Multilaterales de Negociación (SMN) o Sistemas Organizados de Contratación (SOC)-, y a los Sistemas de Información Autorizados (SIA) bien por la CNMV o por otra autoridad competente del Espacio Económico Europeo (EEE).

La estrategia del Plan de Pruebas del sistema SCORE/CNMV persigue como principal objetivo ofrecer a estas entidades la posibilidad de comprobar -con antelación a la puesta en marcha del sistema y con la colaboración de la CNMV- si los procedimientos y procesos desarrollados para la generación, validación, remisión de ficheros a la CNMV y recepción de ficheros “feedback” se lleva a cabo según las especificaciones definidas tanto por ESMA como por la CNMV.

Aunque la participación en el Plan de Pruebas no es obligatoria, se recomienda a las entidades que vayan a comunicar operaciones a la CNMV que tomen parte en algunas o todas las fases de pruebas que se describen en este documento para garantizar la mejor calidad del reporte de información y evitar o minimizar los problemas cuando el sistema entre en funcionamiento.

Este documento se debe leer conjuntamente con la [Guía Operativa de Comunicación de Operaciones bajo MiFIR](#) publicada por la CNMV, así como la información y documentación referenciada en esta Guía y publicada tanto por la CNMV como por ESMA.

El Plan de Pruebas se dirige fundamentalmente a las Unidades de IT, Cumplimiento Normativo y a otras áreas involucradas en la comunicación de operaciones, responsables de asegurar que la entidad cumpla con su obligación de comunicación de operaciones bajo la MiFIR, ya que incluye tanto aspectos técnicos (canales de comunicación, formatos de ficheros, estructuras de la información) como de los contenidos de las operaciones a reportar diariamente.

¹ Reglamento (UE) n° 600/2014 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 15 de mayo de 2014, relativo a los mercados de instrumentos financieros y por el que se modifica el Reglamento (UE) n° 648/2012.

1.2 PROYECTOS ESMA RELACIONADOS

En paralelo al Plan de Pruebas del sistema SCORE/CNMV para la Comunicación de Operaciones bajo MiFIR, se llevará a cabo en la CNMV conjuntamente el “Transaction Reporting Test Plan” definido por ESMA en relación al proyecto TREM que se ha desarrollado para el reporte de operaciones entre las distintas autoridades pertenecientes al ámbito de ESMA.

Ambos sistemas en prueba utilizarán a su vez otros subsistemas y conjuntos de datos necesarios para la correcta comunicación de operaciones y que forman parte del proyecto FIRDS (Financial Instrument Reference Data System) definido por ESMA y cuya primera fase ha entrado en vigor en Julio de 2017, permitiendo a las autoridades de ESMA disponer, entre otros repositorios de datos, de una muestra significativa de los datos referenciales de los instrumentos admitidos en los mercados europeos actualizados diariamente desde los distintos centros de negociación.

Las características de estos sistemas, algunos en producción parcialmente y otros aún en desarrollo, permitirán realizar algunas de las pruebas con datos tanto simulados como reales, si bien durante el periodo de pruebas no estará garantizada completamente la robustez y calidad de los repositorios de datos actualizados diariamente desde ESMA al resto de autoridades. Esta circunstancia no debe ser un obstáculo para la realización de las pruebas por parte de las entidades.

2 DESCRIPCIÓN DEL PLAN

2.1 ÁMBITO

La Guía Operativa de la Comunicación de Operaciones a la CNMV establece el ámbito de las entidades que pueden comunicar las operaciones, y serán éstas mismas las susceptibles de probar el sistema SCORE/CNMV. Son las entidades obligadas que vayan a comunicar por sus propios medios, los Centros de Negociación -Mercados Regulados (MR), Sistemas Multilaterales de Negociación (SMN) o Sistemas Organizados de Contratación (SOC)-, y los Sistemas de Información Autorizados (SIA) bien por la CNMV o por otra autoridad competente del Espacio Económico Europeo (EEE).

El ámbito de las pruebas a realizar, debido a la complejidad del sistema en su conjunto así como las organizaciones y sistemas externos involucrados en el mismo, se llevará a cabo en tres fases diferenciadas que se detallarán en el capítulo siguiente.

La realización del Plan de Pruebas del sistema SCORE/CNMV no es obligatoria para las entidades, aunque si recomendable en la medida en que éstas quieran estar preparadas para realizar una correcta comunicación de operaciones a la CNMV. Por este motivo, las pruebas están descritas más adelante en su tipología, pero no enumeradas de forma concreta ni asociadas a aspectos concretos del proceso. Cada entidad podrá libremente realizar cuantas pruebas desee de cada tipo con la única restricción del marco temporal asignado en cada momento por la CNMV.

2.2 FASES DEL PLAN

Las pruebas que recomienda la CNMV se concentran sobre los aspectos más críticos del procedimiento de comunicación de operaciones a la CNMV. El Plan de Pruebas del sistema SCORE/CNMV contempla tres fases que se describen a continuación:

- 1) **Pruebas unitarias de la entidad.** Esta fase implica probar las funcionalidades del sistema o sistemas implementados en la entidad que comunica las operaciones. Se trata de probar los procesos de negocio que intervienen en la generación de los ficheros diarios con las operaciones a comunicar a la CNMV. Estas pruebas:
 - a. Deberá realizarlas individualmente cada entidad.
 - b. Deberán apoyarse en la documentación publicada por CNMV y ESMA.
 - c. Deberían incluir pruebas no funcionales (rendimiento, estrés, grandes volúmenes, seguridad, etc.)
- 2) **Pruebas de integración con la CNMV.** Para realizar las pruebas de esta segunda fase es recomendable haber realizado con éxito las pruebas de la primera. Se trata de garantizar el acceso a los sistemas de la CNMV necesarios para remitir la información de las operaciones, así como el intercambio de ficheros entre la entidad y la CNMV, por cualquiera de los canales de comunicación definidos en la Guía Operativa de la CNMV.

- 3) **Pruebas piloto en pre-producción.** Para llevar a cabo las pruebas de esta tercera fase es necesario haber realizado con éxito las pruebas de las fases anteriores. El objetivo de estas pruebas será testear en entorno de pre-producción y de principio a fin todo el sistema, y en la medida de lo posible con datos reales. La CNMV garantizará la confidencialidad de esta información, cuyo uso será exclusivamente el de probar los sistemas desarrollados tanto en la CNMV como en las entidades. Estos datos no serán utilizados para la supervisión de las entidades, y serán eliminados de los sistemas de la CNMV al terminar esta fase de pruebas.

La CNMV aconseja realizar estas tres fases de pruebas tanto a las entidades que vayan a comunicar operaciones cuando entre en vigor la MiFIR (Enero de 2018), como a aquellas otras que comiencen su comunicación de operaciones después de esta fecha.

2.3 DESCRIPCIÓN DE LAS PRUEBAS

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

I. Pruebas unitarias de la entidad

- a. Generación de ficheros XML y validación contra los esquemas ESMA, tanto de ficheros con contenidos como los de la BAH (Business Application Header). La CNMV recomienda la plataforma *MyStandards* de SWIFT para probar los ficheros XML y la validación de los diferentes esquemas publicados por ESMA.
- b. Compresión del fichero XML (por ejemplo, con WinZip).
- c. Firma del fichero .ZIP por sus propios medios (para entidades que comuniquen por el canal FTPS) según las especificaciones de la Guía Operativa de la CNMV.
- d. Generación de ficheros XML con la correcta convención de nombres de la Guía Operativa de la CNMV.

II. Pruebas de integración con la CNMV

- a. Acceso al trámite de CIFRADOCTRT – Transaction Reporting Test.
- b. Acceso al servidor FTPS de la CNMV para pruebas: TR-CNMV-TEST.
- c. Remisión a la CNMV de un fichero por el trámite TRT de CIFRADOCTRT.
- d. Remisión a la CNMV de un fichero por el servidor FTPS de pruebas.
- e. Recepción desde CIFRADOCTRT del Acuse de recibo (email).
- f. Remisión a la CNMV de ficheros con errores a nivel de fichero. Es aconsejable probar los distintos errores reflejados en el Capítulo 5 de la Guía Operativa de la CNMV.
- g. Remisión a la CNMV de ficheros con errores a nivel de contenido. Se aconseja igualmente probar distintos tipos de errores de contenido, que se describen a nivel global en el Capítulo 5 de la Guía Operativa de la CNMV, y se detallan en la documentación de ESMA (validation rules).

- h. Remisión a la CNMV de ficheros sin errores a nivel de contenido.
- i. Remisión a la CNMV de ficheros con volúmenes de operaciones similares a los que serán habituales en producción.
- j. Recepción desde SCORE/CNMV del fichero FDB/FRQ de respuesta.

III. Pruebas piloto en pre-producción

- a. Remisión a la CNMV de ficheros con datos reales.
- b. Recepción desde SCORE/CNMV del fichero FDB sobre datos reales.
- c. Depuración y reenvío de operaciones erróneas a la CNMV.

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.

2.4 PERIODO DE PRUEBAS

El ámbito temporal de realización del Plan de Pruebas de la Comunicación de operaciones a la 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 2 de Octubre al 30 de Noviembre de 2017.
- 2) Fase III: del 13 de Noviembre al 15 de Diciembre de 2017.

La Fase I (Pruebas unitarias de la entidad) se deberá llevar a cabo, en la medida de lo posible, antes de realizar la Fase II conjuntamente con la CNMV, si bien al ser la Fase I de exclusiva responsabilidad de la entidad, podrán llevarse a cabo en paralelo.

Para abordar las pruebas relativas a la Fase III (Pruebas piloto en pre-producción), que se solapa temporalmente con la Fase II, la entidad deberá haber superado junto con la CNMV las pruebas relativas a las fases anteriores.

Para aquellas entidades que inicien la Comunicación de Operaciones a la CNMV después de la entrada en vigor la MiFIR (Enero de 2018), la CNMV aconsejará igualmente realizar estas pruebas y establecerá los correspondientes plazos para realizarlas antes de comenzar a comunicar las operaciones.

3 ORGANIZACIÓN DEL PLAN

3.1 PROCEDIMIENTO DE PARTICIPACION

Aquellas entidades que quieran realizar el Plan de Pruebas del sistema SCORE/CNMV deberán solicitarlo por correo electrónico a la dirección score.uat@cnmv.es.

La CNMV solicitará por email los datos de contacto necesarios para registrar la entidad que participará en las pruebas. Desde este buzón serán atendidas las peticiones y se le indicarán tanto los parámetros de conexión necesarios (si es el caso) como las pautas para ir realizando todas las pruebas, así como el éxito en las mismas o la conveniencia de repetir las.

De igual modo se comunicará la finalización de las distintas fases o los posibles cambios en las ventanas temporales, si los hubiera.

3.2 ENTORNO DE PRUEBAS

El Plan de Pruebas del sistema SCORE/CNMV dispondrá de un entorno de pruebas a tal efecto para mayor seguridad durante el desarrollo de las mismas entre las entidades y la CNMV.

Como se ha mencionado anteriormente en este documento, la CNMV recomienda la plataforma *MyStandards* de SWIFT para probar los ficheros XML y la validación de los diferentes esquemas publicados por ESMA.

En lo que respecta a los canales de comunicación, se habilitará un trámite electrónico de pruebas en CIFRADO, así como un acceso específico al servidor FTPS de la CNMV para realizar estas pruebas mediante este canal.

PRUEBAS A TRAVÉS DE CIFRADO

Para realizar las pruebas de conexión a través de CIFRADO, la entidad deberá previamente estar dada de alta en el sistema (ver Guía Operativa de la CNMV). Toda vez que se accede al sistema CIFRADO/CNMV, se deberá seleccionar de la lista de trámites disponibles el trámite electrónico "TRT – Transaction Reporting Test", que es un trámite exclusivamente de prueba mediante el cual se testea el acceso a CIFRADO, la firma electrónica y la comunicación con la CNMV. Tras acceder al correspondiente formulario de prueba, solo será necesario rellenar un campo con la descripción del fichero de prueba que se va a subir, así como el propio fichero, que debe ser un XML comprimido en formato ZIP y siguiendo la convención de nombres detallada en la Guía Operativa de la CNMV.

El sistema CIFRADO/CNMV le asignará un número de trámite, pero no será asignado número de registro oficial alguno, y se le devolverá un correo electrónico a la dirección de correo que se haya incluido en el formulario a modo de acuse de recibo.

PRUEBAS A TRAVÉS DEL SERVIDOR FTPS

Para realizar las pruebas de conexión a través del servidor FTPS de la CNMV la entidad deberá solicitar este acceso explícitamente en su correo electrónico a la dirección score.uat@cnmv.es. A través del correo electrónico a la dirección especificada por la entidad se le pasarán los parámetros necesarios para acceder a este servidor, en principio serán los siguientes:

Nombre del servidor: FTPserver.cnmv.es

Protocolo: SSL

Modo: PASIVO

El resto de datos de acceso (Usuario, Password, Puerto de entrada, etc.) serán facilitados por correo electrónico a la Entidad como parte de la respuesta a su solicitud.

Respecto a las pruebas relacionadas con los contenidos de los ficheros (Fases II y III), las limitaciones de los datos referenciales a disposición de la CNMV en cada momento se podrán traducir en la inhibición de algunos controles sobre los contenidos, en tanto los repositorios de información ofrecidos por ESMA no tengan la suficiente robustez. En cualquier caso este hecho -inevitable por la naturaleza, complejidad y características del proyecto- no debe influir en la realización de las pruebas ni el éxito de las mismas.

3.3 PRECONDICIONES DEL PLAN DE PRUEBAS

El ámbito de entidades susceptibles de participar en este Plan de Pruebas son las Entidades Obligadas, los Centros de Negociación o los SIA autorizados por la CNMV (o en proceso de registro) o autorizados por otra NCA que se hayan procedido a registrar en la CNMV como entidades que reportarán operaciones.

Estas entidades deben haber remitido a la CNMV el Formulario de Registro de Entidades que reportan bajo MiFIR publicado por la CNMV, y adicionalmente solicitar por correo electrónico a través de la dirección score.uat@cnmv.es la participación en el Plan de Pruebas.

Consecuentemente estas entidades deberán tener acceso bien al sistema CIFRADO/CNMV o al servidor FTPS de la CNMV en el entorno de pruebas de ambos sistemas.

3.4 COMUNICACION CON LA CNMV

Durante el periodo de pruebas, y para cualquier aspecto relacionado exclusivamente con las mismas, las entidades utilizarán la dirección de correo electrónico score.uat@cnmv.es para comunicarse con la CNMV, que será atendido por el Departamento de Sistemas de Información.