

ANEXO II

ESTÁNDAR TECNOLÓGICO DE COMUNICACION.

Los ADCVN deberán remitir a la COMISION NACIONAL DE VALORES, al Sistema de Vigilancia y Monitoreo Inteligente (SVMI) mediante su plataforma basada en ISO 20022, en tiempo real y en formato FIX, lo que representa la implementación del protocolo *Financial Information Exchange* (FIX), versión *Latest*, formato XML. Teniendo en cuenta que el tipo de codificación de caracteres que se deberá adoptar es Unicode UTF-8.

FORMATO DE MENSAJE CON ETIQUETADO FIX

1. Introducción

Los mensajes de Post-Trade se caracterizan por ser mensajes que normalmente se comunican después de la colocación y ejecución exitosa de una orden y antes de la liquidación.

Las categorías de mensajes de post-trade son:

1. ASIGNACIÓN
2. CONFIRMACIÓN
3. INSTRUCCIONES DE LIQUIDACIÓN
4. CAPTURA COMERCIAL

2. Lista de Mensajes Post-Trade

Esta sección lista los mensajes de post-trade y las categorías a la que pertenecen.

Tipo de Mensaje (35)	Nombre del Mensaje	Categoría
J	AllocationInstruction	Asignación
AK	Confirmation	Confirmación
AU	ConfirmationAck	Confirmación
AV	SettlementInstructionRequest	Instrucciones de Liquidación
T	SettlementInstructions	Instrucciones de Liquidación
BQ	SettlementObligationReport	Instrucciones de Liquidación
AE	TradeCaptureReport	Información de captura comercial
AR	TradeCaptureReportAck	Información de captura comercial

3. Categoría Asignación

3.1 Componentes

3.1.1 OrdAllocGrp

Tag	Nombre	Req	Descripción
73	NoOrders	N	–
→11	CIOrdID	N	Identificador de orden asignado por el cliente si la(s) orden(es) se entregaron electrónicamente a través de FIX (o se les asignó un CIOrdID) y se ejecutaron. Si los pedidos se entregaron manualmente (o no se entregaron mediante FIX), el contenido de este campo debe ser la palabra "MANUAL". Tenga en cuenta que, si un pedido ha sufrido una o más cancelaciones/reemplazos, debe ser el CIOrdID de la versión más reciente del pedido. Obligatorio cuando NoOrders(73) > 0 y debe ser el primer campo repetido del grupo.
→37	OrderID	N	–
→38	OrderQty	N	–

3.1.2 Instrument

Este componente es un grupo repetitivo que forma parte del mensaje ExecutionReport (35=8) para transmitir información de ejecución.

Tag	Nombre	Req	Descripción
55	Symbol	N	Representación común, "entendida por humanos" de la seguridad. El valor de SecurityID se puede especificar si no existe ningún símbolo Información adicional: se utiliza para especificar <i>Código de Especie/Título</i> <i>Código de Serie</i> <i>Código de Cheque</i>
207	Security Exchange	Y	Mercado, utilizado para ayudar a identificar un valor Información adicional: esto reemplaza la necesidad de enviar 1301 (MarketID) para los mensajes de ejecución. Debe estar en línea con los códigos de identificación de mercado ISO 10383 (MIC) <i>Por Ejemplo:</i> <i>XMAB (MAE)</i> <i>ROFX (Rosario Futures Exchange)</i> <i>XMTB (Matba)</i> <i>XBUE (Bolsa de Buenos Aires)</i>
48	SecurityID	Y	Código ISIN. Requiere que se especifique SecurityIDSource. Se utiliza el código ISIN
22	SecurityIDSource	N	Se requiere especificar SecurityID.

			<p>El valor válido es "4" para ISIN</p> <p>Se permite enviar "M" (Market Assigned) para contratos de Derivados</p>																																																																										
167	SecurityType	N	<p>Se recomienda utilizar CFICode en lugar de SecurityType para instrumentos que no sean de Renta Fija.</p> <p>Obligatorio para Renta Fija. Requerido para Futuros, Opciones y derivados</p>																																																																										
762	SecuritySubType	N	<p>Calificación/identificación de subtipo del SecurityType (por ejemplo, para SecurityType="MLEG"). Si se especifica, se requiere SecurityType.</p>																																																																										
461	CFICode	N	<p>Indica el tipo de valor utilizando valores de la norma ISO 10962, Clasificación de Instrumentos Financieros (Código CFI). Se recomienda utilizar CFICode en lugar de SecurityType para instrumentos que no sean de Renta Fija.</p> <p>Información adicional: Los códigos válidos son</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>CÓDIGO</th> <th>DESCRIPCIÓN</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>100</td> <td>Títulos Públicos</td> </tr> <tr> <td>110</td> <td>Emitidos por el Estado Nacional</td> </tr> <tr> <td>120</td> <td>Emitidos por Estados Provinciales</td> </tr> <tr> <td>130</td> <td>Emitidos por Municipios</td> </tr> <tr> <td>140</td> <td>Otros</td> </tr> <tr> <td>200</td> <td>Títulos Emitidos por el BCRA</td> </tr> <tr> <td>300</td> <td>Acciones</td> </tr> <tr> <td>310</td> <td>Pymes</td> </tr> <tr> <td>320</td> <td>No Pymes Nacionales</td> </tr> <tr> <td>330</td> <td>No Pymes Extranjeras</td> </tr> <tr> <td>400</td> <td>Cedears</td> </tr> <tr> <td>400</td> <td>Cedears</td> </tr> <tr> <td>500</td> <td>Certificados de Valores (CEVAS)</td> </tr> <tr> <td>500</td> <td>Certificados de Valores (CEVAS)</td> </tr> <tr> <td>600</td> <td>Obligaciones Negociables</td> </tr> <tr> <td>600</td> <td>Obligaciones Negociables</td> </tr> <tr> <td>610</td> <td>Pymes</td> </tr> <tr> <td>650</td> <td>Valores de Corto Plazo</td> </tr> <tr> <td>700</td> <td>Cupones</td> </tr> <tr> <td>710</td> <td>Cupones de Títulos Públicos</td> </tr> <tr> <td>720</td> <td>Cupones de Títulos Privados</td> </tr> <tr> <td>800</td> <td>Cheques de Pago Diferido, FACTURAS Y PAGARE</td> </tr> <tr> <td>810</td> <td>Avalados</td> </tr> <tr> <td>820</td> <td>Patrocinados</td> </tr> <tr> <td>830</td> <td>Directos</td> </tr> <tr> <td>900</td> <td>Índices</td> </tr> <tr> <td>900</td> <td>Índices</td> </tr> <tr> <td>1000</td> <td>Fondos de Inversión</td> </tr> <tr> <td>1000</td> <td>Fondos de Inversión</td> </tr> <tr> <td>1100</td> <td>Fideicomisos</td> </tr> <tr> <td>1110</td> <td>Títulos de Deuda</td> </tr> <tr> <td>1120</td> <td>Certificados de Participación</td> </tr> <tr> <td>1200</td> <td>Moneda</td> </tr> <tr> <td>1200</td> <td>Moneda</td> </tr> <tr> <td>1300</td> <td>Warrants</td> </tr> <tr> <td>1300</td> <td>Warrants</td> </tr> </tbody> </table>	CÓDIGO	DESCRIPCIÓN	100	Títulos Públicos	110	Emitidos por el Estado Nacional	120	Emitidos por Estados Provinciales	130	Emitidos por Municipios	140	Otros	200	Títulos Emitidos por el BCRA	300	Acciones	310	Pymes	320	No Pymes Nacionales	330	No Pymes Extranjeras	400	Cedears	400	Cedears	500	Certificados de Valores (CEVAS)	500	Certificados de Valores (CEVAS)	600	Obligaciones Negociables	600	Obligaciones Negociables	610	Pymes	650	Valores de Corto Plazo	700	Cupones	710	Cupones de Títulos Públicos	720	Cupones de Títulos Privados	800	Cheques de Pago Diferido, FACTURAS Y PAGARE	810	Avalados	820	Patrocinados	830	Directos	900	Índices	900	Índices	1000	Fondos de Inversión	1000	Fondos de Inversión	1100	Fideicomisos	1110	Títulos de Deuda	1120	Certificados de Participación	1200	Moneda	1200	Moneda	1300	Warrants	1300	Warrants
CÓDIGO	DESCRIPCIÓN																																																																												
100	Títulos Públicos																																																																												
110	Emitidos por el Estado Nacional																																																																												
120	Emitidos por Estados Provinciales																																																																												
130	Emitidos por Municipios																																																																												
140	Otros																																																																												
200	Títulos Emitidos por el BCRA																																																																												
300	Acciones																																																																												
310	Pymes																																																																												
320	No Pymes Nacionales																																																																												
330	No Pymes Extranjeras																																																																												
400	Cedears																																																																												
400	Cedears																																																																												
500	Certificados de Valores (CEVAS)																																																																												
500	Certificados de Valores (CEVAS)																																																																												
600	Obligaciones Negociables																																																																												
600	Obligaciones Negociables																																																																												
610	Pymes																																																																												
650	Valores de Corto Plazo																																																																												
700	Cupones																																																																												
710	Cupones de Títulos Públicos																																																																												
720	Cupones de Títulos Privados																																																																												
800	Cheques de Pago Diferido, FACTURAS Y PAGARE																																																																												
810	Avalados																																																																												
820	Patrocinados																																																																												
830	Directos																																																																												
900	Índices																																																																												
900	Índices																																																																												
1000	Fondos de Inversión																																																																												
1000	Fondos de Inversión																																																																												
1100	Fideicomisos																																																																												
1110	Títulos de Deuda																																																																												
1120	Certificados de Participación																																																																												
1200	Moneda																																																																												
1200	Moneda																																																																												
1300	Warrants																																																																												
1300	Warrants																																																																												

996	UnitOfMeasure	N	La unidad de medida de la materia prima subyacente en la que se basa el contrato.
231	ContractMultiplier	N	Especifica la relación o el factor de multiplicación para convertir de contratos a acciones (por ejemplo, 1,0, 100, 1000, etc.). Aplicable para Renta Fija, Bonos Convertibles, Derivados, etc. Nota: Si se utilizan, las cantidades deben expresarse en el monto 'nominal' (por ejemplo, contratos versus acciones).
997	TimeUnit	N	Unidad de tiempo asociada al contrato.
1147	UnitOfMeasureQty	N	Se utiliza para indicar la cantidad de la unidad de medida de la materia prima subyacente en la que se basa el contrato, como 2500 libras de ganado magro, 1000 barriles de petróleo crudo, 1000 fanegas de maíz, etc. UnitOfMeasureQty se requiere para UnitOfMeasure <996> Variable Enumeraciones de unidades de medida de cantidad. Consulte la definición de UnitOfMeasure <996> para obtener más información sobre el uso de UnitOfMeasureQty.
1435	ContractMultiplierUnit	N	Indica el tipo de multiplicador que se está aplicando al contrato. Se puede usar opcionalmente para definir aún más en qué unidad se expresa ContractMultiplier <231>.

3.1.3 Parties

El bloque de componentes de Partes se utiliza para identificar y transmitir información sobre las entidades tanto centrales como periféricas a la transacción financiera representada por el mensaje FIX que contiene el Bloque de Partes. El bloque Partes permite que se expresen muchos tipos diferentes de entidades mediante el uso del campo PartyRole <452> e identifica la fuente de PartyID <448> a través de PartyIDSource <447>.

Tag	Nombre	Req	Descripción
453	NoPartyIDs	N	El grupo repetido a continuación debe contener combinaciones únicas de PartyID, PartyIDSource y PartyRole
→448	PartyID	N	Se utiliza para identificar la fuente de PartyID. Obligatorio si se especifica PartyIDSource. Obligatorio si NoPartyIDs > 0.
→447	PartyIDSource	N	Se utiliza para identificar la fuente de clase del valor de PartyID (por ejemplo, J (Número de identificación fiscal)). Obligatorio si se especifica PartyID. Obligatorio si NoPartyIDs > 0.
→452	PartyRole	N	Identifica el tipo de PartyID (por ejemplo, Broker ejecutor). Obligatorio si NoPartyIDs > 0.
→802	NoPartySubIDs	N	El grupo repetido a continuación debe contener combinaciones únicas de PartySubID y PartySubIDType
→→523	PartySubID	N	Sub-identificador de parte
→→803	PartySubIDType	N	

Los valores válidos son:

Agente Comprador:

448 PartyID = CUIT solo valor numérico sin espacios o código LEI

447 PartyIDSource = J para CUIT o N para LEI - Legal Entity Identifier (ISO 17442)

452 PartyRole = 30

802 NoPartySubIDs = 1 (Persona Jurídica) o 2 (Persona Humana)

523 PartySubID = BUYER

803 PartySubIDType = 86

Agente Vendedor

448 PartyID = CUIT solo valor numérico sin espacios o código LEI

447 PartyIDSource = J para CUIT o N para LEI - Legal Entity Identifier (ISO 17442)

452 PartyRole = 30

802 NoPartySubIDs = 1 (Persona Jurídica) o 2 (Persona Humana)

523 PartySubID = SELLER

803 PartySubIDType = 86

Tipo Operacion Destino:

523 PartySubID = según la tabla debajo

803 PartySubIDType = 64

MERCADO	CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
BYMA	0	Terc (SC)
	2	FCI (SC)
	3	Otro Mercado
	4	INVERSOR CALIFICADO c/rec fondos (SC)
	5	Agente MAE
	6	INVERSOR CALIFICADO c/rec encaje (SC)
	7	INVERSOR CALIFICADO Cartera Propia (SC)
MAE	2	FCI
	3	Agente de bolsa
	4	INVERSOR CALIFICADO Fondo
	5	Cuenta Propia
	6	INVERSOR CALIFICADO Encaje
	7	INVERSOR CALIFICADO Recursos Propios

Comitente Comprador CUIT/LEI:

448 PartyID = CUIT solo valor numérico sin espacios o código LEI

447 PartyIDSource = J para CUIT o N para LEI - Legal Entity Identifier (ISO 17442)

452 PartyRole = 7

802 NoPartySubIDs = 3

Tipo Comitente Comprador

523 PartySubID = BUYER

803 PartySubIDType = 1 (Persona Jurídica) o 2 (Persona Humana)

523 PartySubID = según la tabla debajo

803 PartySubIDType = 41 (Customer account type)

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
2	FCI
3	Agente de Otro Mercado
4	Otros Institucionales Locales
5	Persona Humana Local
6	Persona Humana Extranjera
7	Persona Jurídica local
8	Persona Jurídica Extranjera

Denominación:

523 PartySubID = Nombre Legal completo

803 PartySubIDType = 5 (Full Entity Legal Name)

Comitente Vendedor CUIT/LEI:

448 PartyID = CUIT solo valor numérico sin espacios o código LEI

447 PartyIDSource = J para CUIT o N para LEI - Legal Entity Identifier (ISO 17442)

452 PartyRole = 30

802 NoPartySubIDs = 3

Tipo Comitente Vendedor

523 PartySubID = SELLER

803 PartySubIDType = 1 (Persona Jurídica) o 2 (Persona Humana)

523 PartySubID = de acuerdo a la tabla debajo

803 PartySubIDType = 41 (Customer account type)

CÓDIGO	DESCRIPCIÓN
2	FCI
3	Agente de Otro Mercado
4	Otros Institucionales Locales
5	Persona Humana Local
6	Persona Humana Extranjera
7	Persona Jurídica local
8	Persona Jurídica Extranjera

Denominación:

523 PartySubID = Nombre Legal completo

803 PartySubIDType = 5 (Full Entity Legal Name)

Responsable Comprador

448 PartyID = CUIT solo valor numérico sin espacios o código LEI

447 PartyIDSource = J para CUIT o N para código LEI - Legal Entity Identifier (ISO 17442)

452 PartyRole = 118

802 NoPartySubIDs = 3

Tipo Responsable Comprador 523 PartySubID = BUYER

803 PartySubIDType = 86

Domicilio:

523 PartySubID = Nombre Legal completo

803 PartySubIDType = 18 (Registered Address)

Telefono:

523 PartySubID = Número Telefonico
803 PartySubIDType = 7 (Phone Number)

Responsable Vendedor

448 PartyID = CUIT solo valor numérico sin espacios o código LEI
447 PartyIDSource = J para CUIT o N para código LEI - Legal Entity Identifier (ISO 17442)
452 PartyRole = 118
802 NoPartySubIDs = 3

Tipo Responsable Vendedor

523 PartySubID = SELLER
803 PartySubIDType = 86

Domicilio:

523 PartySubID = Domicilio registrado
803 PartySubIDType = 18 (Registered Address)

Telefono:

523 PartySubID = Número Telefonico
803 PartySubIDType = 7 (Phone Number)

Nro. FCI CNV

448 PartyID = CUIT solo valor numérico sin espacios o código LEI
447 PartyIDSource = J para CUIT o N para código LEI - Legal Entity Identifier (ISO 17442)
452 PartyRole = 49

3.2 Mensajes

3.2.2 Mensajes de Asignación de Instrucción

Tag	Nombre	Req	Descripción
Component	StandardHeader	Y	MsgType = J
70	AllocID	Y	Identificador único para este mensaje de instrucción de Asignación
71	AllocTransType	Y	Ejemplo: New, Cancel, Replace
626	AllocType	Y	Especifica el propósito o tipo de mensaje de Asignación
72	RefAllocID	N	Requerido para AllocTransType = Replace or Cancel
796	AllocCancReplaceReason	N	Requerido para AllocTransType = Replace or Cancel. Da el motivo de la sustitución o cancelación de la instrucción de Asignación
857	AllocNoOrdersType	N	Indica cómo se identifican las órdenes que se reservan y asignan mediante un mensaje AllocationInstruction o AllocationReport, ej. por definición explícita en los componentes OrdAllocGrp o ExecAllocGrp, o no identificado explícitamente.
Component	OrdAllocGrp	N	Indica número de órdenes a combinar para Asignación. Si los pedidos se entregaron manualmente, establezca 1 (uno). Requerido cuando AllocNoOrdersType = 1
54	Side	Y	–
Component	Instrument	Y	Inserte aquí el conjunto de campos "Instrumento" (simbología) definidos en el punto "3.1 Componentes". Para los NDF, la fecha y la hora de fijación se pueden especificar opcionalmente utilizando MaturityDate y MaturityTime.
53	Quantity	Y	Cantidad total (por ejemplo, número de acciones) asignada a todas las cuentas, o que está lista para reservar
854	QtyType	N	–
30	LastMkt	N	Mercado de las ejecuciones.
229	TradeOriginationDate	N	–
15	Currency	Y	Moneda de AvgPx. Debe ser la moneda del mercado o bolsa local donde se realizó la operación.
Component	Parties	N	Inserte aquí el conjunto de campos "Partes" (identificación de la empresa) definido en el punto "3.1 Componentes "
75	TradeDate	Y	–
60	TransactTime	N	Fecha/hora en que se genera la Asignación
63	SettlType	N	–
64	SettlDate	N	Tiene prioridad sobre el valor de SettlType y se requiere u omite condicionalmente para valores específicos de SettlType. Requerido para que los NDF especifiquen la "fecha de valor".

381	GrossTradeAmt	N	Expresado en la misma moneda que AvgPx(6). (Quantity (53) * AvgPx(6) o AvgParPx(860)) o suma de (AllocQty(80) * AllocAvgPx(153) o AllocPrice(366)). Para Renta Fija, AvgParPx(860) se usa cuando AvgPx(6) no se expresa como "porcentaje del precio a la par".
715	ClearingBusinessDate	N	Indica la fecha comercial de compensación para la cual se liquidará la transacción.
Component	StandardTrailer	Y	–

4. Categoría Confirmación

4.1 Componentes

4.1.1 CpctyConfGrp

Tag	Nombre	Req	Descripción
862	NoCapacities	N	–
→528	OrderCapacity	Y	Especifica la capacidad de la empresa que ejecuta la(s) orden(es)
→529	OrderRestrictions	N	–
→863	OrderCapacityQty	N	La cantidad que se ejecutó bajo esta capacidad (por ejemplo, cantidad ejecutada como agente, como principal, etc.). Si se especifica alguno, todas las entradas del componente deben tener especificado OrderCapacityQty y la suma de los valores de OrderCapacityQty debe ser igual a AllocQty de este mensaje.

4.2 Mensajes

4.2.1 Mensajes de Confirmación

Tag	Nombre	Req	Descripción
Component	StandardHeader	Y	MsgType = AK
664	ConfirmID	Y	ID único para este mensaje
772	ConfirmRefID	N	Obligatorio si ConfirmTransType es Replace o Cancel
859	ConfirmReqID	N	Solo se usa cuando este mensaje se usa para responder a una solicitud de Confirmación (a la que se refiere este ID))
666	ConfirmTransType	Y	New, Cancel o Replace
773	ConfirmType	Y	Indica si este mensaje representa una Confirmación o un mensaje de estado comercial
665	ConfirmStatus	Y	–
940	AffirmStatus	N	Se utiliza para comunicar un mensaje de estado de Confirmación (35 = AK) "afirmado" (es decir, cuando ConfirmType (773) = 1 (Estado)) a las partes interesadas que necesitan o deben recibir dicho mensaje de estado de Confirmación. Este campo no debe usarse cuando se envía un mensaje de Confirmación (35=AK) que necesita ser afirmado.
2390	TradeConfirmaciónReferenceID	N	–
Component	Parties	N	Insertar aquí el conjunto de campos de "Partes" (identificación de la empresa) definidos en el punto "3.1 Componentes" Requerido para renta fija También se debe usar asociado con ProcessCode para intermediarios de crédito (por ejemplo, para operaciones de corretaje dirigidas)

Component	OrdAllocGrp	N	Indica número de órdenes a combinar para Asignación. Si los pedidos se entregaron manualmente, establezca 1 (uno). Requerido cuando AllocNoOrdersType = 1
------------------	--------------------	---	---

70	AllocID	N	Se utiliza para referirse a una Instrucción de Asignación anterior.
60	TransactTime	Y	Representa la hora en que se generó este mensaje.
75	TradeDate	Y	–
Component	Instrument	Y	Inserte aquí el conjunto de campos “Instrumento” (simbología) definidos en el punto “3.1 Componentes”
80	AllocQty	Y	La cantidad que se confirma con este mensaje (esto es a nivel comercial, no a nivel de bloque ni de orden)
854	QtyType	N	–
54	Side	Y	–
15	Currency	Y	–

Component	CpctyConfGrp	Y	–
79	AllocAccount	Y	Número de cuenta para la operación que se confirma con este mensaje
798	AllocAccountType	N	–
6	AvgPx	Y	Precio bruto de la operación que se está confirmando Siempre expresado en porcentaje de la par para Renta Fija
381	GrossTradeAmt	Y	Se confirma el monto comercial bruto para la cuenta asignada.

118	NetMoney	Y	–
890	MaturityNetMoney	N	Dinero neto al vencimiento si el cupón cero y el valor al vencimiento son diferentes del valor nominal
119	SettlCurrAmt	N	–
120	SettlCurrency	N	–
155	SettlCurrFxRate	N	–
63	SettlType	N	–
64	SettlDate	N	–
Component	StandardTrailer	Y	–

4.2.2 Mensaje de Respuesta a Mensaje Confirmación

Tag	Nombre	Req	Descripción
Component	StandardHeader	Y	MsgType = AU
664	ConfirmID	Y	–
75	TradeDate	Y	–
60	TransactTime	Y	Fecha/Hora Reconocimiento de Instrucción de Asignación generado
940	AffirmStatus	Y	–
2390	TradeConfirmaciónReferenceID	N	–
774	ConfirmRejReason	N	Requerido para ConfirmStatus = 1 (rejected)
573	MatchStatus	N	Indica si los detalles financieros provistos en la Confirmación fueron cotejados con éxito.
58	Text	N	Puede incluir una explicación para ConfirmRejReason(774) = 99
Component	StandardTrailer	Y	–

5. Categoría de Instrucciones de Liquidación

5.1 Componentes

5.1.1 SettleInstGrp

Tag	Nombre	Req	Descripción
778	NoSettleInst	N	–
→162	SettleInstID	N	Identificación única para estas Instrucciones de Liquidación. Obligatorio excepto cuando SettleInstMode es 5= Rechazar solicitud de SSI
→163	SettleInstTransType	N	New, Replace, Cancel or Restate Requerido excepto donde SettleInstMode es 5= Rechazar solicitud de SSI
→214	SettleInstRefID	N	Requerido cuando SettleInstTransType es Cancel o Replace
→Component	Parties	N	Inserte aquí el conjunto de campos de "Partes" (identificación de la empresa) definidos en el punto "3.1 Componentes". Se utiliza aquí para la ubicación del asentamiento. También se utiliza para ejecutar intermediarios para CIV Instrucciones de Liquidación
→54	Side	Y	Se puede usar para SettleInstMode = 1 si se proporcionan SSI para un lado en particular.
→167	SecurityType	Y	Se puede usar para SettleInstMode = 1 si se proporcionan SSI para un tipo de seguridad en particular (como alternativa a CFICode).
→461	CFICode	Y	Se puede usar para SettleInstMode =1 si se proporcionan SSI para un CFI en particular (identificado por el código CFI).
→120	SettleCurrency	Y	Se puede usar para SettleInstMode = 1 si se proporcionan SSI para una moneda de liquidación en particular
→168	EffectiveTime	Y	Fecha/hora de vigencia (inicio) de estas Instrucciones de Liquidación. Obligatorio excepto cuando SettleInstMode es 5=Rechazar solicitud de SSI
→126	ExpireTime	Y	Fecha/hora de finalización para estas Instrucciones de Liquidación.
→779	LastUpdateTime	Y	Fecha/hora en que se actualizó por última vez estas Instrucciones de Liquidación (o se creó si no se actualizó desde su creación). Requerido excepto donde SettleInstMode is 5=Reject SSI request
→Component	SettleInstructionsData	N	Inserte aquí el conjunto de campos "SettleInstructionsData" definidos en "Common Components of Application Messages"

5.1.2 SettlInstructionsData

Tag	Nombre	Req	Descripción
172	SettlDeliveryType	N	Obligatorio si AllocSettlInstType = 1 o 2
169	StandInstDbType	N	Obligatorio si AllocSettlInstType = 3 (no se debe completar de lo contrario)
170	StandInstDbName	N	Obligatorio si AllocSettlInstType = 3 (no se debe completar de lo contrario)
171	StandInstDbID	N	Identificador utilizado dentro de StandInstDbType Obligatorio si AllocSettlInstType = 3, caso contrario no se debe completar

5.1.3 SettlObligationInstructions

Tag	Nombre	Req	Descripción
1165	NoSettlOblig	N	–
→430	NetGrossInd	N	–
→1161	SettlObligID	N	ID único para estas Instrucciones de Liquidación
→1162	SettlObligTransType	N	New, Replace, Cancel, or Restate
→1163	SettlObligRefID	N	Obligatorio donde SettlObligTransType <1162> es Cancelar o Reemplazar. El SettlObligID <1161> de la obligación de liquidación que se cancela o reemplaza.
→1157	CcyAmt	N	Flujo neto de moneda 1
→119	SettlCurrAmt	N	Flujo neto de moneda 2
→15	Currency	N	Divisa 1 en el par de divisas indicado, la divisa repartida
→120	SettlCurrency	N	Divisa 2 en el par de divisas indicado, la divisa repartida
→155	SettlCurrFxRate	N	Tasa derivada de Ccy2 por Ccy1 basada en compensación
→64	SettlDate	N	Fecha valor
→Component	Instrument	N	Se utiliza para expresar el instrumento en el que tiene lugar la liquidación
→Component	Parties	N	–
→168	EffectiveTime	N	Fecha/hora de inicio de estas Instrucciones de Liquidación
→126	ExpireTime	N	Fecha/hora de terminación de estas Instrucciones de Liquidación.
→779	LastUpdateTime	N	Fecha/hora en que se actualizó por última vez esta Instrucción de Liquidación (o se creó si no se actualizó desde su creación).
→Component	SettlDetails	N	Transmite los detalles de la cuenta de liquidación informados como parte de la obligación

5.1.4 SettlDetails

Tag	Nombre	Req	Descripción
1158	NoSettlDetails	N	–
→1164	SettlObligSource	N	Indica la fuente de las Instrucciones de Liquidación
→169	StandInstDbType	N	–
→170	StandInstDbName	N	–
→171	StandInstDbID	N	–

5.2 Mensajes

5.2.1 Mensajes de Instrucción de Liquidación

Tag	Nombre	Req	Descripción
Component	StandardHeader	Y	MsgType = T
777	SettlInstMsgID	Y	Identificador único para este mensaje
791	SettlInstReqID	N	Solo se usa cuando este mensaje se usa para responder a una solicitud de Instrucciones de Liquidación (a la que se refiere este ID)
160	SettlInstMode	Y	1=Instrucciones Permanentes, 2=Anulación de Cuenta de Asignación Específica, 3=Permanencia de Cuenta de Asignación Específica, 4=Orden Específica, 5=Rechazar solicitud de SSI
792	SettlInstReqRejCode	N	Requerido para SettlInstMode = 5. Usado para proporcionar el motivo del rechazo de un mensaje de Solicitud de Instrucciones de Liquidación.
58	Text	N	Se puede utilizar para proporcionar cualquier texto de rechazo adicional cuando se rechace un mensaje de Solicitud de Instrucciones de Liquidación.
11	ClOrdID	N	Obligatorio para SettlInstMode <160> = 4 y cuando se hace referencia a pedidos que se enviaron electrónicamente a través de FIX o se les asignó un ClOrdID.
60	TransactTime	Y	Fecha/hora en que se generó este mensaje
Component	SettlInstGrp	N	Obligatorio excepto cuando SettlInstMode es 5= Rechazar solicitud de SSI
Component	StandardTrailer	Y	–

5.2.2 Mensaje de Informe de obligación de liquidación

Tag	Nombre	Req	Descripción
Component	StandardHeader	Y	MsgType = BQ
715	ClearingBusinessDate	N	–
1160	SettlObligMsgID	Y	Identificador único para este mensaje
1159	SettlObligMode	Y	Se utiliza para identificar el modo de información de la obligación de liquidación que es preliminar o definitiva
58	Text	N	Se puede utilizar para proporcionar cualquier texto de rechazo adicional cuando se rechace un mensaje de Solicitud de Instrucciones de Liquidación.
60	TransactTime	N	Hora en que se creó el Informe de Obligación de Liquidación.
Component	SettlObligationInstructions	Y	–
Component	StandardTrailer	Y	–

6. Categoría Informes de captura comercial

6.1 Componentes

6.1.1 TradeReportOrderDetail

Tag	Nombre	Req	Descripción
37	OrderID	Y	–
11	ClOrdID	Y	En el caso de las cotizaciones, se puede asignar a QuoteMsgID (1166) de una sola cotización (MsgType = S) o QuoteID (117) de una MassQuote (MsgType = i).

528	OrderCapacity	N	–
1093	LotType	N	–

6.1.2 TrdCapRptSideGrp

Tag	Nombre	Req	Descripción
552	NoSides	N	–
→54	Side	Y	Obligatorio cuando NoSides(552) > 0.
→1427	SideExecID	N	–
→Component	Parties	N	–

→1	Account	N	Requerido para ejecuciones contra órdenes enviadas electrónicamente a las que la institución o intermediario les asignó una cuenta.
→660	AcctIDSource	N	–
→581	AccountType	N	–
→336	TradingSessionID	N	Por lo general, lo mismo para todos los lados de una operación, si se informa solo en el primer lado, el mismo TradingSessionID (336) se aplica a todos los lados de la operación.
→625	TradingSessionSubID	N	Por lo general, lo mismo para todos los lados de una operación, si se informa solo en el primer lado, el mismo TradingSessionSubID (625) se aplica a todos los lados de la operación.
→159	AccruedInterestAmt	N	–

→118	NetMoney	N	Valor expresado en la moneda reflejada por el campo Moneda(15).
→591	PreallocMethod	N	–

→70	AllocID	N	Sirve para asignar un ID al bloque de pre asignaciones.
→Component	TrdAllocGrp	N	–
→1115	OrderCategory	N	–
→1444	SideLiquidityInd	N	–

→Component	TradeReportOrderDetail	N	Detalles del pedido para el pedido asociado con este lado de la operación.
------------	------------------------	---	--

6.1.3 TrdAllocGrp

Tag	Nombre	Req	Descripción
78	NoAllocs	N	–
→79	AllocAccount	N	Obligatorio si NoAllocs(78) > 0.
→661	AllocAcctIDSource	N	–
→736	AllocSettlCurrency	N	–
→467	IndividualAllocID	N	–
→Component	NestedParties2	N	–
→80	AllocQty	N	–

6.2 Mensajes

6.2.1 Informes de captura comercial

Component	StandardHeader	Req	Descripción
		Y	MsgType = AE
571	TradeReportID	Y	
1003	TradeID	N	–
1041	FirmTradeID	N	–
856	TradeReportType	N	–
568	TradeRequestID	N	Identificador de la solicitud de informe de captura comercial asociada con este informe de captura comercial.
828	TrdType	N	–
2667	AlgorithmicTradeIndicator	N	–

1123	TradeHandlingInstr	N	–
150	ExecType	N	Tipo de ejecución que se informa. Utiliza un subconjunto de ExecType(150) para informes de captura comercial.
1028	ManualOrderIndicator	N	Puede usarse para indicar el informe manual del comercio.
572	TradeReportRefID	N	El TradeReportID(571) al que se hace referencia para la corrección o cancelación comercial.
487	TradeReportTransType	N	Identifica el tipo de transacción del mensaje del informe comercial.
820	TradeLinkID	N	–
880	TrdMatchID	N	–
570	PreviouslyReported	N	–
423	PriceType	N	Se puede utilizar para indicar el precio comercial del gabinete.

549	CrossType	N	–
Component	RootParties	N	Se utiliza para partes de actuación que se aplican a todo el mensaje, no a individuales legs, sides, etc.

1300	MarketSegmentID	N	–
1301	MarketID	N	–
Component	Instrument	Y	–
32	LastQty	N	Requerido condicionalmente, excepto cuando se informan operaciones a partes que derivarán la cantidad a nivel de operación a partir de la información a nivel de pierna para operaciones de múltiples legs
31	LastPx	N	Requerido condicionalmente, excepto cuando se informan operaciones a partes que obtendrán el precio a nivel de operación a partir de la información a nivel de leg para operaciones de múltiples piernas.

15	Currency	N	Divisa principal del par de divisas especificado. Se utiliza para calificar LastQty(32) y GrossTradeAmout(381).
669	LastParPx	N	–
75	TradeDate	N	Se utiliza cuando se informa de transacciones distintas del día actual.
715	ClearingBusinessDate	N	–
2870	ClearingPortfolioID	N	–

60	TransactTime	N	Hora de la transacción representada por cuando ocurrió este TradeCaptureReport(35=AE). Tiempo de ejecución de la operación. También describe el momento de las transacciones en bloque.
63	SettlType	N	–
64	SettlDate	N	Tiene prioridad sobre el valor SettlType(63) y se requiere u omite condicionalmente para valores específicos de SettlType(63).
574	MatchType	N	–
Component	TrdCapRptSideGrp	Y	–
381	GrossTradeAmt	N	(LastQty(32) * LastPx(31) o LastParPx(669)). Para Renta Fija, LastParPx(669) se utiliza cuando LastPx(31) no se expresa como "porcentaje del precio a la par".

236	Yield	N	–
-----	-------	---	---

Component	StandardTrailer	Y	–
------------------	------------------------	---	---



República Argentina - Poder Ejecutivo Nacional
1983/2023 - 40 AÑOS DE DEMOCRACIA

Hoja Adicional de Firmas
Anexo

Número:

Referencia: Anexo II del Capítulo I del Título VIII de las NORMAS (N.T. 2013 y mod.).

El documento fue importado por el sistema GEDO con un total de 19 pagina/s.