

Specifiche File definizione Mapping Firm Code e Gestione Operativa

Version 1.5

Riservato



INDICE

Revisioni	4
1 Accordo di Riservatezza	5
2 Introduzione	6
1 Specifiche di formato del file di mapping.....	7
2.1 Formato della sezione Dati	7
1.1.1 Formato per la classe FT_C_MRK_CLIENT	7
1.1.2 Formato per la classe FT_C_FIRM_CODE_DEFINITION.....	8
1.2 Esempi concreti.....	9
1.2.1 Classe FT_C_MRK_CLIENT.....	9
1.2.2 Classe FT_C_FIRM_CODE_DEFINITION	10
2 Gestione File Mapping.....	11

REVISIONI

Versione	Data	Autore	Descrizione
1.0	11/10/2017	Prima Versione	List
1.1	15/11/2017	Gestione Conti Cointestati ed indicazioni lunghezze campi di tipo stringa	List
1.2	23/11/2017	Aggiunta <Member ID> alla stringa di esempio di header	List
1.3	28/12/2017	- Modifica degli orari nella paragrafo <i>Gestione File Mapping</i> - Modifica numerazione titoli	List
1.4	10/09/2018	Aggiunte restrizioni FirmShortCode	List
1.5	21/03/2022	Orario limite di upload cambiato da 19:00 a 23:00	List

1 ACCORDO DI RISERVATEZZA

Tutte le informazioni contenute in questo documento relative a prodotti, servizi e strategie sono da considerarsi come proprietarie e confidenziali, fornite esclusivamente per uso interno del destinatario del documento.

L'accettazione del presente documento implica l'impegno da parte del destinatario di non diffondere e di non rendere disponibile nessuna delle informazioni in esso contenute al personale della propria organizzazione che non sia tenuto ad essere informato o che non sia coinvolto nella valutazione dei contenuti del presente documento.

Le informazioni citate non devono essere divulgate, direttamente o indirettamente, a nessun altro offerente o concorrente senza il previo consenso scritto di LIST.

2 INTRODUZIONE

Questo documento descrive il formato del file utilizzato per il censimento del Client Identification Code associato al ClientID (mapping implementato nella classe **FT_C_MRK_CLIENT**) e del Firm Short Code associato al relativo Firm Long Code (mapping implementato con la classe **FT_C_FIRM_CODE_DEFINITION**); descrive inoltre le modalità di invio e gestione dello stesso file.

1 SPECIFICHE DI FORMATO DEL FILE DI MAPPING

Il file è un semplice file di testo, con estensione .txt di cui si richiede che il nome inizi con il prefisso

- "HIMTF_MemberId_C_" per mapping MarketClient,
- "HIMTF_MemberId_IE_" per mapping FirmCode

dove *MemberId* è il codice assegnato al Partecipante dal Mercato.

Il resto del nome del file è libero.

Un singolo file può contenere soltanto un tipo di mapping (MarketClient o FirmCode), quindi un file contenente informazioni su entrambe le classi non sarebbe riconosciuto.

I parametri contenuti nel file devono essere separati dal carattere <TAB>.

In maniera generica il file caricato dal componente è formato da due sezioni:

- Una sezione di HEADER, i cui parametri sono:
 - Nome della classe da importare (FT_C_MRK_CLIENT o FT_C_FIRM_CODE_DEFINITION)
 - Il **MemberID** per cui si richiede il mapping
 - Il numero di righe da inserire
 - Un parametro opzionale **RESET** che richiede la cancellazione dei record attualmente presenti nella tabella.

Nel caso in cui il parametro RESET sia specificato, i record contenuti nella sezione dati dello stesso file verranno inseriti in tabella dopo la completa rimozione, a seguito del RESET, di quelli presenti in precedenza.

In caso di "Reset", gli stessi short code inviati in passato possono essere inviati nuovamente.

Di seguito un esempio di riga Header del file:

```
<nome_classe><TAB><MemberID><TAB><numero_record_che_seguiranno><TAB>(opzionale)RESET
```

Si specifica, inoltre, che un file può contenere soltanto una riga di Header per cui, come accennato nel paragrafo precedente, non è possibile inserire dati di più classi in un singolo file.

- Una sezione dati, contenente il numero di righe richieste nella sezione HEADER, con i parametri richiesti sulla base della classe da inserire.

2.1 FORMATO DELLA SEZIONE DATI

1.1.1 Formato per la classe FT_C_MRK_CLIENT

Attraverso la classe FT_C_MRK_CLIENT l'intermediario fornisce l'associazione fra ClientID short code e long code ai fini MIFID II obbligatorio per le attività di conto terzi.

I parametri richiesti per l'inserimento di un record nella tabella **FT_C_MRK_CLIENT** sono i seguenti:

Field Name	Required	Data Type	Description	Length
MemberID	KEY - Mandatory	STRING	Id of the member which submits the file	16
ClientID	KEY - Mandatory	STRING	Id of the clientid short code	32
Description	Optional	STRING		64
CountryID	Optional	STRING		6
Client Type	Mandatory	ENUM	"Person" or "LegalEntity" Specify the MIFID Client Type	
Client Identification Code	KEY - Mandatory	STRING	Contains the national ID (if Person) or LEI (if LegalEntity) of the Client (MIFIDII)	40

Esistono due vincoli sui parametri passati: il primo è che il MemberID deve essere uguale al MemberID indicato nella sezione Header del file, mentre il secondo è che il parametro Client Type può assumere soltanto i valori Person oppure LegalEntity (il confronto è Case Sensitive), mentre tutti gli altri parametri sono costituiti da stringhe libere.

Nel seguito è indicato un esempio di riga per la classe **FT_C_MRK_CLIENT**.

MemberID<TAB>**ClientID**<TAB>**Description**<TAB>**CountryID**<TAB>**ClientType** (Person oppure **LegalEntity**)<TAB>**ClientIdentificationCode**

Gestione Conti Cointestati

Per la gestione dei conti cointestati si richiede che essi vengano forniti dal partecipante inserendo più righe sul file con Client Identification Code diversi che fanno riferimento allo stesso ClientID short code. Per Esempio:

ClientID Short Code	Client Identification Code
SC1	CodiceFiscale1
SC1	CodiceFiscale2
SC1	CodiceFiscale3

Nel caso in cui l'intermediario debba correggere/cancellare/inserire l'associazione fra un ClientID short code ed uno dei conti cointestati, è tenuto ad inviare per quel ClientID short code tutti i Client Identification Code a lui associati.

In altre parole, in un singolo file per ogni Client Short Code da mappare gli intermediari devono specificare sempre tutti i Client Identification Code relativi ad ogni singolo short code.

1.1.2 Formato per la classe **FT_C_FIRM_CODE_DEFINITION**

Attraverso la classe **FT_C_FIRM_CODE_DEFINITION** l'intermediario fornisce l'associazione fra Execution/Investment short code e long code ai fini MIFID II obbligatorio per le attività di conto proprio.

I parametri richiesti per l'inserimento di un record nella tabella **FT_C_FIRM_CODE_DEFINITION** sono i seguenti:

Field Name	Required	Data Type	Description	Length
MemberID	KEY - Mandatory	STRING	Id of the member which submits the file	16
FirmShortCode	KEY - Mandatory	ULONG	Id of the short code	
FirmCodeType	KEY - Mandatory	ENUM	"Investment" or "Execution"	
FirmLong Code	Mandatory	STRING	Long Code of the Firm	64
FirmType	Mandatory	ENUM	"Person" or "Algorithm"	

Anche su questa sezione esistono dei vincoli:

- Il MemberID deve essere uguale al MemberID indicato nella sezione Header del file (analogamente alla sezione dati per la classe **FT_C_MRK_CLIENT**)
- Il FirmShortCode deve essere un numero tra 0 e 2147483647
- Il parametro **FirmCodeType** può assumere i valori **Investment** oppure **Execution**, anche in questo caso il confronto è Case Sensitive
- Il parametro **FirmType** può assumere soltanto i valori **Person** oppure **Algorithm**, anche in questo caso il confronto è Case Sensitive.
- Nel caso in cui lo stesso **FirmShortCode** voglia essere utilizzato sia come **Investment** che come **Execution**, sarà necessario inserire 2 righe, una per ciascun **FirmCodeType**.

Nel seguito è indicato un esempio di riga per l'inserimento di un record nella tabella **FT_C_FIRM_CODE_DEFINITION**.

MemberID<TAB>**FirmShortCode**<TAB>**FirmCodeType** (Investment oppure Execution)<TAB>**FirmLongCode**<TAB>**FirmType**(Person oppure Algorithm)

Oltre ai vincoli imposti dal software, si precisa anche che all'interno del sistema si assume che gli ShortCode siano *univoci*, ovvero che uno Short Code sia associato ad un solo Long Code, permettendo la identificazione univoca di un soggetto (Persona o Algoritmo).

Lo stesso Short Code può essere censito sia come Investment Decision che come Execution Decision, in questo caso ci saranno due record che si differenziano unicamente per il parametro FirmCodeType.

1.2 ESEMPI CONCRETI

Nel seguente paragrafo forniamo degli esempi concreti di contenuto del file di mapping.

1.2.1 Classe FT_C_MRK_CLIENT

Nome del file: HiMTF_MRK_CLIENT_01234.txt

Contenuto:

FT_C_MRK_CLIENT 01234 1

01234 Client ClientDescription ITA Person ADDJHN81M15G187D

1.2.2 Classe FT_C_FIRM_CODE_DEFINITION

Nome del file: HiMTF_FIRM_CODE_DEF_01234.txt

Contenuto:

FT_C_FIRM_CODE_DEFINITION	01234	1	RESET	
01234	121212	Investment	136485475	Person

In questo caso, a seguito della presenza del parametro RESET, tutti i record presenti in tabella vengono cancellati e contestualmente viene inserito in tabella il record, in questo caso uno solo, contenuto nella sezione dati del file stesso.

2 GESTIONE FILE MAPPING

Ogni aderente dovrà caricare il proprio file di mapping sull'usuale sito FTP nella sottodirectory **Mifid_ShortCode** fino alle ore 23:00 rispettando la naming convention definita nel capitolo Formato della sezione Dati. A fronte della successiva elaborazione da parte della piattaforma di mercato il file verrà rimosso da tale directory e archiviato.

L'elaborazione del file avviene un'unica volta e quindi non sono possibili ulteriori caricamenti dello stesso file. Gli aderenti a fronte di erronei caricamenti di file di mapping sul proprio sito FTP, avranno comunque la possibilità di eliminare/sostituire il file caricato, ovviamente entro le 23:00.



www.list-group.com