REGULAMENTO DE EXECUÇÃO (UE) 2022/1860 DA COMISSÃO

de 10 de junho de 2022

que estabelece normas técnicas de execução relativamente à aplicação do Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho no que diz respeito aos padrões, formatos, periodicidade, métodos e mecanismos de comunicação de informações

(Texto relevante para efeitos do EEE)

A COMISSÃO EUROPEIA,

Tendo em conta o Tratado sobre o Funcionamento da União Europeia,

Tendo em conta o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 4 de julho de 2012, relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações ([1]), nomeadamente o artigo 9.º, n.º 6, quarto parágrafo,

Considerando o seguinte:

(1) O Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012 da Comissão ([2]), foi alterado substancialmente. Uma vez que seriam necessárias novas alterações para melhorar a clareza e a coerência do quadro jurídico, incluindo os requisitos de comunicação de informações noutras jurisdições, o Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012 deve ser revogado e substituído pelo presente regulamento.

(2) Os dados comunicados aos repositórios de transações pelas contrapartes de derivados devem ser apresentados num formato harmonizado, a fim de facilitar a recolha, agregação e comparação de dados entre repositórios de transações. Por conseguinte, deve ser estabelecido o formato para cada um dos campos a comunicar e as comunicações devem ser normalizadas por referência a uma norma ISO amplamente utilizada no setor financeiro.

(3) Podem ser apresentadas várias comunicações relativamente a um único derivado, se, por exemplo, forem feitas alterações sucessivas a esse derivado. A fim de assegurar que cada comunicação relativa a um derivado, e que cada derivado como um todo, são devidamente compreendidos, as comunicações devem ser apresentadas pela ordem cronológica de ocorrência dos eventos comunicados.

(4) Para reduzir o ónus da comunicação da alteração de determinados valores e, em especial, os pormenores relativos à avaliação do contrato e à margem fornecidas ou recebida, esses dados devem ser comunicados exatamente como se encontram no final de cada dia.

(5) O sistema mundial de identificador de entidade jurídica («LEI») já foi plenamente implementado, pelo que as contrapartes de um derivado ou as entidades responsáveis pela comunicação de informações só devem utilizar esse sistema para identificar uma entidade jurídica numa comunicação. Para que a utilização do sistema LEI seja eficaz, as contrapartes ou as entidades responsáveis pela comunicação de informações devem assegurar que os dados de referência relacionados com o seu LEI são renovados em conformidade com as condições de um emitente de LEI acreditado, designado por unidade operacional local.

(6) A determinação da contraparte num derivado é complexa para determinados produtos. Por conseguinte, a fim de assegurar que estas informações são comunicadas de modo coerente e exato, devem ser estabelecidas regras específicas para a determinação da direção do derivado.

(7) A fim de determinar as exposições reais das contrapartes, as autoridades competentes precisam de dispor de informações completas e exatas sobre as garantias trocadas entre essas contrapartes. Assim, devem ser determinadas regras específicas que garantam uma abordagem coerente no que respeita à comunicação de informações sobre a cobertura por garantias de um determinado derivado ou carteira.

([1]) JO L 201 de 27.7.2012, p. 1.

([2]) Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012 da Comissão, de 19 de dezembro de 2012, que estabelece as normas técnicas de execução no que se refere ao formato e à periodicidade das comunicações de transações a transmitir aos repositórios de transações nos termos do Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações (JO L 352 de 21.12.2012, p. 20).

(8) A especificação e classificação exatas e a identificação precisa dos derivados são essenciais para uma utilização eficiente dos dados e para uma agregação significativa dos dados dos diferentes repositórios de transações, contribuindo assim para os objetivos do Conselho de Estabilidade Financeira estabelecidos no Estudo de Viabilidade sobre a Agregação dos Dados dos Repositórios de Transações de Derivados OTC, publicado em 19 de setembro de 2014. Além disso, a aplicação do identificador único do produto (UPI) acordado a nível mundial é essencial para permitir a agregação de dados sobre derivados a nível mundial. Os requisitos de comunicação de informações relativos à classificação e identificação dos derivados devem portanto ser enunciados de forma que estas informações sejam integralmente disponibilizadas às autoridades competentes.

(9) A geração e a disponibilização atempadas do identificador de transação único (UTI) ([3]) são indispensáveis para permitir que ambas as contrapartes utilizem o mesmo UTI, assegurando assim a identificação e associação corretas das duas comunicações relativas ao mesmo derivado. Por conseguinte, é necessário estabelecer critérios para determinar a entidade responsável pela geração do UTI, de modo a evitar que o mesmo derivado seja contado duas vezes. Além disso, a fim de garantir este objetivo relativamente aos contratos de derivados celebrados com contrapartes fora da União, é importante alinhar estas regras com as orientações acordadas a nível mundial sobre o UTI.

(10) A alteração do LEI de uma determinada entidade devido a um evento empresarial ou a obtenção de um LEI por uma entidade jurídica pode resultar na necessidade de atualizar um número substancial de comunicações, nomeadamente todas as comunicações em que essa entidade seja identificada como parte envolvida num derivado. Por esse motivo, deve ser estabelecido um procedimento para assegurar que os repositórios de transações possam atualizar o identificador da entidade de forma centralizada, garantindo assim um processo eficiente, robusto e atempado.

(11) As autoridades podem não estar cientes de certos problemas de comunicação significativos das entidades que comunicam informações supervisionadas, por exemplo, quando tais problemas não resultam em rejeições de comunicações ou em lacunas de conciliação. A fim de assegurar que as autoridades estão cientes desses problemas de comunicação significativos, as entidades responsáveis pela comunicação de informações devem notificar as autoridades competentes dos erros e omissões relevantes no plano da comunicação.

(12) Caso uma contraparte financeira seja a única responsável e legalmente incumbida da comunicação dos elementos dos contratos de derivados OTC em nome de uma contraparte não financeira nos termos do artigo 9.º, n.º 1-A, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, a contraparte financeira deve tomar as medidas necessárias para assegurar que pode cumprir devidamente esta obrigação sem duplicação da comunicação de dados sobre derivados.

(13) As lacunas de conciliação são uma indicação clara de potenciais problemas com a qualidade dos dados comunicados. Por conseguinte, as contrapartes, as entidades responsáveis pela comunicação de informações e as entidades que apresentam comunicações de informações, consoante o caso, devem dispor de mecanismos destinados a assegurar a resolução das lacunas de conciliação.

(14) A fim de assegurar que as autoridades possam cumprir eficazmente os seus mandatos, em especial no que se refere à estabilidade financeira, é necessário que tenham uma imagem clara e completa de todos os derivados com um grau de risco importante. Apenas um requisito harmonizado de atualização adequada de todos os derivados pendentes pode evitar divergências na aplicação dos requisitos de comunicação de informações aplicáveis a esses derivados e, por conseguinte, atenuar o risco de comprometer a convergência no domínio da supervisão. Além disso, a garantia de que as comunicações relativas a derivados pendentes estão alinhadas em termos de conteúdo e qualidade dos dados permite simplificar os fluxos de comunicação de informações, resultando assim, no longo prazo, numa redução dos custos para todas as partes interessadas, incluindo os repositórios de transações, as entidades que comunicam informações e as autoridades competentes. Assim, para garantir a melhoria do funcionamento e a redução do ónus da comunicação de informações, em consonância com os objetivos das alterações do Regulamento (UE) n.º 648/2012 introduzidas pelo Regulamento (UE) 2019/834 do Parlamento Europeu e do Conselho ([4]), é

([3]) O termo *unique trade identifier* (UTI, ou seja, «identificador de transação único») utilizado no artigo 9.º, n.º 6, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 corresponde ao termo *Unique Transaction Identifier* utilizado na norma ISO 23897.

([4]) Regulamento (UE) 2019/834 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 20 de maio de 2019, que altera o Regulamento (UE) n.º 648/2012 no que diz respeito à obrigação de compensação, à suspensão da obrigação de compensação, aos requisitos de comunicação de informações, às técnicas de atenuação do risco para os contratos de derivados OTC não compensados através de uma contraparte central, ao registo e supervisão dos repositórios de transações e aos requisitos aplicáveis aos repositórios de transações (JO L 141 de 28.5.2019, p. 42).

essencial que as contrapartes comuniquem informações completas e exatas sobre todos os derivados pendentes, em conformidade com os requisitos atualmente aplicáveis. A fim de atenuar o ónus inicial relacionado com a atualização dos derivados pendentes, deve ser concedido às contrapartes um prazo adicional para atualizarem os dados relativos a esses derivados. Além disso, as contrapartes só deverão ser obrigadas a apresentar essa atualização se não ocorrer qualquer alteração dentro desse prazo que obrigue a contraparte a comunicar dados completos e exatos do derivado numa comunicação relativa a essa alteração.

(15) O presente regulamento tem por base os projetos de normas técnicas de execução apresentados à Comissão pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados (ESMA).

(16) A ESMA consultou os membros do Sistema Europeu de Bancos Centrais antes de apresentar os projetos de normas técnicas de execução que servem de base ao presente regulamento. A ESMA realizou consultas públicas abertas sobre os projetos de normas técnicas de execução em que se baseia o presente regulamento, analisou os potenciais custos e benefícios a eles associados e solicitou o parecer do Grupo de Interessados do Setor dos Valores Mobiliários e dos Mercados criado em conformidade com o artigo 37.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho ([5]).

(17) A fim de permitir que as contrapartes e os repositórios de transações tomem todas as medidas necessárias para se adaptarem aos novos requisitos, a data de aplicação do presente regulamento deve ser diferida de dezoito meses,

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

Artigo 1.º

Padrões relativos aos dados e formatos das comunicações sobre derivados

Os elementos de um contrato de derivados constantes da comunicação a apresentar nos termos do artigo 9.º do Regulamento (UE) 648/2012 devem ser fornecidos em conformidade com os padrões e formatos especificados nos quadros 1, 2 e 3 do anexo do presente regulamento, devendo essa comunicação ser fornecida num formato eletrónico e de leitura ótica comum e num modelo XML comum em conformidade com a metodologia segundo a norma ISO 20022.

Artigo 2.º

Periodicidade das comunicações

1. Todas as comunicações dos elementos dos derivados especificados no artigo 1.º do Regulamento Delegado (UE) 2022/1855 da Comissão ([6]) devem ser apresentadas por ordem cronológica de ocorrência dos eventos relativos às informações a comunicar.

2. Uma CCP, uma contraparte financeira ou uma contraparte não financeira a que se refere o artigo 10.º do Regulamento (UE) n.º 648/2012, que seja uma contraparte de um derivado, ou a entidade responsável pela comunicação de informações, deve comunicar qualquer alteração dos dados relativos às garantias nos campos 1 a 29 do quadro 3 do anexo do Regulamento Delegado (UE) 2022/1855 com o tipo de ação «Atualização da margem», exatamente como esses dados se encontram no final de cada dia, relativamente a esse derivado, quando:

a) O derivado não venceu e não foi objeto de uma comunicação com o tipo de ação «Cessação», «Erro» ou «Componente de posição», como referido no campo 151 do quadro 2 do anexo; ou

b) O derivado foi objeto de uma comunicação com o tipo de ação «Reabertura» não seguida de outra comunicação com o tipo de ação «Cessação» ou «Erro», como referido no campo 151 do quadro 2 do anexo.

([5]) Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 24 de novembro de 2010, que cria uma Autoridade Europeia de Supervisão (Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados), altera a Decisão n.º 716/2009/CE e revoga a Decisão 2009/77/CE da Comissão (JO L 331 de 15.12.2010, p. 84).

([6]) Regulamento Delegado (UE) 2022/1855 da Comissão, de 10 de junho de 2022, que complementa o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação que especificam os pormenores mínimos dos dados a comunicar aos repositórios de transações e o tipo de comunicações de informações a utilizar (ver página 1 do presente Jornal Oficial).

3. Uma contraparte de um contrato de derivados a que se refere o n.º 2, alíneas a) e b), que seja uma CCP, uma contraparte financeira ou uma contraparte não financeira a que se refere o artigo 10.º do Regulamento (UE) n.º 648/2012, ou a entidade responsável pela comunicação de informações, deve comunicar a avaliação de final de dia ao preço de mercado, ou com recurso a um modelo, desse contrato nos campos 21 a 25 do quadro 2 do anexo do Regulamento Delegado (UE) 2022/1855 com o tipo de ação «Atualização da margem», exatamente como esses dados se encontram no final de cada dia.

Artigo 3.º

Identificação das contrapartes e outras entidades

1. Uma comunicação deve utilizar um código de identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 com o objetivo de identificar:

a) Uma entidade de corretagem;

b) Uma CCP;

c) Um membro compensador;

d) Uma contraparte que é uma entidade jurídica;

e) Uma entidade que apresenta comunicações de informações;

f) Uma entidade responsável pela comunicação de informações;

g) Um prestador de serviços de redução dos riscos pós-transação.

2. A contraparte 1 num derivado a que se refere o campo 4 do quadro 1 do anexo do Regulamento Delegado (UE) 2022/1855 e a entidade responsável pela comunicação de informações devem assegurar que os dados de referência relacionados com o seu código de LEI segundo a norma ISO 17442 são atualizados em conformidade com as condições de qualquer uma das unidades operacionais locais acreditadas do Sistema Mundial LEI ao comunicarem a celebração ou a alteração de um contrato de derivados nos termos do artigo 9.º do Regulamento (UE) n.º 648/2012.

Artigo 4.º

Direção do derivado

1. O lado em que se situa a contraparte no contrato de derivados a que se referem os campos 17 a 19 do quadro 1 do anexo deve ser determinado aquando da conclusão do derivado, em conformidade com os n.ºs 2 a 14.

2. No que se refere às opções e às opções sobre *swaps*, a contraparte que detém o direito de exercer a opção deve ser identificada como a compradora e a contraparte que vende a opção e recebe um prémio deve ser identificada como a vendedora.

3. No caso dos *forwards* relacionados com divisas, a contraparte 1 deve ser identificada como a ordenante ou a beneficiária relativamente à componente 1, e o oposto relativamente à componente 2. A contraparte 2 deve preencher os campos 18 e 19 do quadro 1 com os valores opostos à contraparte 1.

4. No caso de *swaps* de divisas em que se realizam várias conversões de divisas, cada contraparte relativamente a ambas as componentes da transação deve ser identificada como a ordenante ou a beneficiária da componente com base na conversão de divisas que ocorre o mais próximo possível da data de termo.

5. No caso dos *forwards* que não os *forwards* relativos a divisas, e no caso dos futuros, a contraparte que compra o instrumento deve ser identificada como a compradora e a contraparte que vende o instrumento deve ser identificada como a vendedora.

6. No caso de contratos diferenciais financeiros e de margem financeira definida, a contraparte que tem expectativas de desvalorização no quadro do contrato deve ser identificada como a vendedora, e a contraparte que tem expectativas de valorização no quadro do contrato deve ser identificada como a compradora.

7. No caso dos *swaps* de dividendos, a contraparte que recebe pagamentos equivalentes aos montantes de dividendos deve ser identificada como a compradora e a contraparte que efetua esses pagamentos deve ser identificada como a vendedora.

8. No caso dos *swaps* de valores mobiliários que não os *swaps* relacionados com dividendos, a contraparte 1 deve ser identificada como a ordenante ou a beneficiária relativamente à componente 1, e o oposto relativamente à componente 2. A contraparte 2 deve preencher os campos 18 e 19 do quadro 1 com os valores opostos à contraparte 1.

9. No caso dos *swaps* de taxas de juro ou de índices de inflação, incluindo os *swaps* de divisas cruzadas, a contraparte 1 deve ser identificada como a ordenante ou a beneficiária relativamente à componente 1, e o oposto relativamente à componente 2. A contraparte 2 deve preencher os campos 18 e 19 do quadro 1 com os valores opostos à contraparte 1.

10. Com exceção das opções e das opções sobre *swaps*, no caso dos instrumentos derivados destinados à transferência do risco de crédito, a contraparte que compra a proteção deve ser identificada como a compradora e a contraparte que vende a proteção deve ser identificada como a vendedora.

11. No caso dos *swaps* de mercadorias, a contraparte 1 deve ser identificada como a ordenante ou a beneficiária relativamente à componente 1, e o oposto relativamente à componente 2. A contraparte 2 deve preencher os campos 18 e 19 do quadro 1 com os valores opostos à contraparte 1.

12. No caso dos *forwards* de taxa de juro, a contraparte 1 deve ser identificada como a ordenante ou a beneficiária relativamente à componente 1, e o oposto relativamente à componente 2. A contraparte 2 deve preencher os campos 18 e 19 do quadro 1 com os valores opostos à contraparte 1.

13. No caso de derivados relacionados com a variância, volatilidade e correlação, a contraparte que beneficia de um aumento do preço do subjacente deve ser identificada como a compradora e a contraparte que beneficia de uma diminuição do preço do subjacente deve ser identificada como a vendedora.

Artigo 5.º

Cobertura por garantias

A contraparte que comunica as informações deve identificar o tipo de cobertura por garantias do contrato de derivados ou de uma carteira de derivados a que se refere o campo 11 do quadro 3 do anexo do seguinte modo:

a) Como «não coberto por garantias», nos casos em que não existe acordo de garantia entre as contrapartes, ou em que o acordo de garantia entre as contrapartes estipula que as contrapartes não fornecem nem uma margem inicial nem uma margem de variação no que diz respeito ao derivado ou à carteira de derivados;

b) Como «coberto em parte por garantias: só a contraparte 1», nos casos em que o acordo de garantia entre as contrapartes estipula que a contraparte que comunica as informações apenas fornece regularmente margens de variação, e que a outra contraparte não contabiliza qualquer margem no que diz respeito ao derivado ou à carteira de derivados;

c) Como «coberto em parte por garantias: só a contraparte 2», nos casos em que o acordo de garantia entre as contrapartes estipula que a outra contraparte apenas fornece regularmente uma margem de variação, e que a contraparte que comunica informações não fornece qualquer margem no que diz respeito ao derivado ou à carteira de derivados;

d) Como «coberto em parte por garantias», nos casos em que o acordo de garantia entre as contrapartes estipula que ambas as contrapartes apenas fornecem regularmente uma margem de variação no que diz respeito ao derivado ou à carteira de derivados;

e) Como «coberto unilateralmente por garantias: só a contraparte 1», nos casos em que o acordo de garantia entre as contrapartes estipula que a contraparte que comunica informações fornece a margem inicial e fornece regularmente margens de variação, e que a outra contraparte não fornece quaisquer margens no que diz respeito ao derivado ou à carteira de derivados;

f) Como «coberto unilateralmente por garantias: só a contraparte 2», nos casos em que o acordo de garantia entre as contrapartes estipula que a outra contraparte fornece a margem inicial e fornece regularmente margens de variação, e que a contraparte que comunica informações não fornece quaisquer margens no que diz respeito ao derivado ou à carteira de derivados;

g) Como «coberto unilateral ou parcialmente por garantias: contraparte 1», nos casos em que o acordo de garantia entre as contrapartes estipula que a contraparte que comunica informações fornece a margem inicial e fornece regularmente margens de variação, e que a outra contraparte apenas fornece regularmente margens de variação no que diz respeito ao derivado ou à carteira de derivados;

h) Como «coberto unilateral ou parcialmente por garantias: contraparte 2», nos casos em que o acordo de garantia entre as contrapartes estipula que a outra contraparte fornece a margem inicial e fornece regularmente margens de variação, e que a contraparte que comunica informações apenas fornece regularmente margens de variação no que diz respeito ao derivado ou à carteira de derivados;

i) Como «coberto totalmente por garantias», nos casos em que o acordo de garantia entre as contrapartes estipula que ambas as contrapartes fornecem a margem inicial e fornecem regularmente margens de variação no que diz respeito ao derivado ou à carteira de derivados.

Artigo 6.º

Especificação, identificação e classificação dos derivados

1. Uma comunicação deve especificar um derivado com base no tipo de contrato e na categoria de ativos em conformidade com os campos 10 e 11 do quadro 2 do anexo.

A comunicação deve especificar a categoria de ativos que mais se assemelha ao derivado, se o derivado não pertencer a uma das classes de derivados referidas no campo 11 do quadro 2 do anexo. Ambas as contrapartes devem especificar a mesma categoria de ativos.

2. O derivado deve ser identificado no campo 7 do quadro 2 do anexo utilizando o código do número de identificação internacional de títulos (ISIN) segundo a norma ISO 6166 num dos seguintes casos:

a) É admitido à negociação ou negociado numa plataforma de negociação;

b) É negociado num internalizador sistemático e o seu subjacente é admitido à negociação ou negociado numa plataforma de negociação ou é um índice ou um cabaz composto de instrumentos negociados numa plataforma de negociação.

3. Um derivado que não seja o derivado referido no n.º 2 deve ser identificado no campo 8 do quadro 2 do anexo, utilizando o código do identificador único do produto (UPI) segundo a norma ISO 4914.

4. A contraparte que comunica as informações deve classificar o derivado no campo 9 do quadro 2 do anexo utilizando o código de classificação do instrumento financeiro (CFI) segundo a norma ISO 10962.

Artigo 7.º

Identificador de transação único

1. As contrapartes devem comunicar os derivados utilizando o UTI gerado em conformidade com os n.os 2, 3 e 5.

2. Um derivado, comunicado a nível de transação ou de posição, deve ser identificado utilizando um identificador de transação único (UTI) segundo a norma ISO 23897 no campo 1 do quadro 2 do anexo. O UTI é composto pelo LEI da entidade que gerou esse UTI seguido de um código com um máximo de 32 carateres que é único ao nível da entidade geradora.

3. As contrapartes devem determinar a entidade responsável pela geração do UTI de acordo com o seguinte:

a) Relativamente aos derivados compensados que não sejam os derivados entre duas CCP, o UTI deve ser gerado pela CCP no momento da compensação para o membro compensador. Um UTI diferente deve ser gerado pelo membro compensador para a sua contraparte relativamente a uma transação em que a CCP não seja uma contraparte;

b) Relativamente aos derivados executados centralmente mas não compensados centralmente, o UTI deve ser gerado pelo espaço ou organização de execução para o seu membro;

c) Relativamente aos derivados que não sejam os referidos nas alíneas a) e b), caso ambas as contrapartes estejam sujeitas a requisitos de comunicação de informações num país terceiro, o UTI deve ser gerado de acordo com as regras da jurisdição da contraparte que deve cumprir, em primeiro lugar, esses requisitos de comunicação de informações.

Se a contraparte sujeita à obrigação de comunicação de informações nos termos do artigo 9.º do Regulamento (UE) n.º 648/2012 tiver de cumprir, em primeiro lugar, os requisitos de comunicação de informações, a entidade responsável pela geração do UTI é a seguinte:

i) relativamente aos derivados que tenham sido centralmente confirmados por meios eletrónicos, a plataforma que confirma as transações no momento da confirmação;

ii) relativamente a todos os outros derivados, as contrapartes devem chegar a acordo sobre a entidade responsável pela geração do UTI. Se as contrapartes não chegarem a acordo, a contraparte cujo LEI é o primeiro com base na ordenação dos identificadores das contrapartes com os carateres do identificador invertidos é a responsável pela geração.

Caso a legislação aplicável do país terceiro em causa preveja o mesmo prazo para a comunicação de informações que o aplicável à contraparte sujeita à obrigação de comunicação de informações nos termos do artigo 9.º, n.º 1, primeiro parágrafo, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, as contrapartes devem chegar a acordo sobre a entidade responsável pela geração do UTI.

Se as contrapartes não chegarem a acordo e o derivado tiver sido confirmado centralmente por meios eletrónicos, o UTI deve ser gerado pela plataforma que confirma as transações no momento da confirmação.

Se o UTI não puder ser gerado pela plataforma que confirma as transações no momento da confirmação e os dados do derivado tiverem de ser comunicados a um único repositório de transações, esse repositório de transações é responsável pela geração do UTI.

Se o UTI não puder ser gerado pelo repositório de transações ao qual foram comunicados os dados do derivado, a contraparte cujo LEI é o primeiro na ordenação dos identificadores das contrapartes com os carateres invertidos é a responsável pela geração;

d) Relativamente aos derivados que não os referidos nas alíneas a), b) e c), que foram confirmados centralmente por meios eletrónicos, o UTI deve ser gerado pela plataforma que confirma as transações no momento da confirmação;

e) Relativamente a todos os derivados que não os referidos nas alíneas a) a d), são aplicáveis as seguintes disposições:

i) quando contrapartes financeiras celebram um contrato de derivados com contrapartes não financeiras, as contrapartes financeiras devem gerar o UTI,

ii) quando contrapartes não financeiras que ultrapassam o limiar de compensação celebram um contrato de derivados com contrapartes não financeiras que não atingem o limiar de compensação, as contrapartes não financeiras que ultrapassam o limiar de compensação devem gerar o UTI,

iii) relativamente a todos os derivados que não os referidos nas alíneas i) e ii), as contrapartes devem chegar a acordo sobre a entidade responsável pela geração do UTI. Se as contrapartes não chegarem a acordo, a contraparte cujo LEI é o primeiro com base na ordenação dos identificadores das contrapartes com os carateres do identificador invertidos é a responsável pela geração.

4. A contraparte que gera o UTI deve comunicar o UTI à outra contraparte em tempo útil e, o mais tardar, às 10h00 (tempo universal coordenado) do dia útil seguinte à data de celebração do contrato de derivados.

5. Não obstante o disposto no n.º 3, a geração do UTI pode ser delegada numa entidade diferente da determinada nos termos do n.º 3. A entidade geradora do UTI deve cumprir os requisitos estabelecidos nos n.ºs 2 e 4.

Artigo 8.º

Comunicação das alterações do LEI e atualização do código de identificação do LEI

1. Caso a contraparte identificada nos termos do artigo 3.º numa comunicação sobre derivados seja objeto de um evento de reestruturação empresarial que resulte numa alteração do seu LEI, essa contraparte ou a contraparte a que o novo LEI diz respeito, a entidade responsável pela comunicação de informações em nome de qualquer uma dessas contrapartes nos termos do artigo 9.º, n.ºs 1-A a 1-D, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, ou a entidade na qual uma das contrapartes delegou a comunicação de informações nos termos do artigo 9.º, n.º 1-F, do Regulamento (UE) n.º 648/2012,

deve notificar o repositório de transações ao qual a contraparte que foi objeto de um evento de reestruturação empresarial comunicou os seus derivados relativamente à alteração, bem como solicitar uma atualização do LEI dos derivados em causa a que se refere o artigo 2.º, n.º 2, alíneas a) e b), à data do evento de reestruturação empresarial que deu origem à alteração do LEI ou dos contratos comunicados após essa data.

2. Sempre que possível, o pedido de atualização do identificador dos derivados a que se refere o artigo 2.º, n.º 2, alíneas a) e b), deve ser apresentado, pelo menos, 30 dias de calendário antes do evento de reestruturação empresarial que resulte numa alteração do LEI. Se a entidade a que se refere o n.º 1 não puder fornecer essas informações ao repositório de transações 30 dias de calendário antes do evento de reestruturação empresarial que resultou numa alteração do LEI, deve notificar o repositório de transações o mais rapidamente possível.

3. O pedido referido no n.º 1 deve incluir, no mínimo, os seguintes elementos:

a) O LEI de cada uma das contrapartes que participam no evento de reestruturação empresarial;

b) O LEI da nova contraparte;

c) A data em que a alteração do LEI ocorre ou ocorreu;

d) Os UTI dos derivados em causa no caso de o evento de reestruturação empresarial afetar apenas um subconjunto de derivados a que se refere o artigo 2.º, n.º 2, alíneas a) e b);

e) Elementos comprovativos de que o evento de reestruturação empresarial ocorreu ou vai ocorrer, sob reserva das disposições relativas à divulgação pública de informação privilegiada previstas no artigo 17.º do Regulamento (UE) n.º 596/2014.

4. Quando uma contraparte notifica por erro um repositório de transações sobre uma alteração do seu LEI, deve seguir o procedimento para solicitar a atualização do seu LEI em conformidade com os n.ºs 1, 2 e 3.

5. Se uma contraparte identificada previamente com um identificador diferente do LEI obtiver um LEI, aplicam-se os procedimentos previstos nos n.ºs 1, 2 e 3.

6. Se uma alteração do LEI disser respeito a uma contraparte estabelecida num país terceiro, a sua contraparte que comunica as informações estabelecida na União, ou a entidade responsável pela comunicação de informações nos termos do artigo 9.º, n.ºs 1-A a 1-D, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, ou a entidade na qual a contraparte que comunica as informações estabelecida na União delegou a comunicação de informações, deve dar início ao procedimento previsto nos n.ºs 1, 2 e 3.

7. Se uma contraparte estabelecida num país terceiro identificada previamente com um identificador diferente do LEI obtiver um LEI, cada contraparte que comunica informações estabelecida na União afetada por esta alteração, ou entidade responsável pela comunicação de informações nos termos do artigo 9.º, n.ºs 1-A a 1-D, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, ou entidade na qual a contraparte que comunica informações estabelecida na União delegou a comunicação de informações, deve solicitar a atualização do identificador da contraparte estabelecida num país terceiro ao respetivo repositório de transações.

8. Se a alteração do LEI disser respeito a uma entidade referida no artigo 3.º, n.º 1, alíneas a), b), c), e) ou g), que não seja uma contraparte do derivado, a contraparte 1 ou a entidade responsável pela comunicação de informações deve confirmar ao repositório de transações os UTI dos derivados em causa a que se refere o artigo 2.º, n.º 2, alíneas a) e b). Se a contraparte 1 e a entidade responsável pela comunicação de informações não confirmarem ao repositório de transações os UTI dos derivados em causa a que se refere o artigo 2.º, n.º 2, alíneas a) e b), afetados pela alteração do LEI, a contraparte 1 ou a entidade responsável pela comunicação de informações deve atualizar o LEI da entidade em causa em todas as comunicações relativas aos derivados em causa a que se refere o artigo 2.º, n.º 2, alíneas a) e b), enviando uma comunicação com o tipo de ação «Alteração».

Artigo 9.º

Métodos e mecanismos de comunicação de informações

1. A entidade responsável pela comunicação de informações deve notificar a sua autoridade competente e, se for diferente, a autoridade competente da contraparte que comunica as informações em qualquer uma das seguintes situações:

a) Qualquer comunicação incorreta causada por falhas nos sistemas de comunicação de informações que possam afetar um número significativo de comunicações;

b) Qualquer obstáculo à comunicação de informações que impeça a entidade que apresenta a comunicação de informações de enviar comunicações a um repositório de transações no prazo referido no artigo 9.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 648/2012;

c) Qualquer problema significativo que resulte em erros a nível da comunicação de informações que não provoquem a rejeição por parte de um repositório de transações em conformidade com o Regulamento Delegado (UE) 2022/1858 da Comissão ([7]).

A entidade responsável pela comunicação de informações deve notificar imediatamente qualquer dessas situações, logo que delas tome conhecimento.

A notificação deve indicar, pelo menos, o tipo de erro ou omissão, a data da ocorrência, o âmbito das comunicações afetadas, os motivos dos erros ou omissões, as medidas tomadas para resolver o problema e o calendário para resolver o problema e efetuar as correções.

2. Caso uma contraparte financeira seja a única responsável e legalmente incumbida da comunicação dos elementos dos contratos de derivados OTC em nome de uma contraparte não financeira nos termos do artigo 9.º, n.º 1-A, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, deve aplicar as seguintes disposições:

a) Disposições para o fornecimento atempado, por parte da contraparte não financeira, dos seguintes elementos dos contratos de derivados OTC de que não se pode razoavelmente esperar que a contraparte financeira disponha e caso estes sejam desconhecidos por essa contraparte financeira:

   i) identificação do corretor, como referido no campo 15 do quadro 1 do anexo,

   ii) membro compensador, como referido no campo 16 do quadro 1 do anexo,

   iii) relação direta com a atividade comercial ou o financiamento de tesouraria, como referido no campo 20 do quadro 1 do anexo;

b) Disposições para a notificação atempada, por parte da contraparte não financeira à contraparte financeira, de qualquer alteração das suas obrigações legais nos termos do artigo 10.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 648/2012;

c) Disposições para a devida atualização por parte da contraparte não financeira do seu LEI, de acordo com as condições de qualquer uma das unidades operacionais locais acreditadas do Sistema Mundial LEI;

d) Disposições para a notificação atempada, por parte da contraparte não financeira à contraparte financeira, da sua decisão de iniciar ou de deixar de comunicar os elementos dos contratos de derivados OTC celebrados com a contraparte financeira. Essas disposições devem, pelo menos, assegurar que a notificação é efetuada por escrito ou por outros meios eletrónicos equivalentes, pelo menos 10 dias úteis antes da data em que a contraparte não financeira pretende iniciar ou deixar de comunicar informações.

3. As contrapartes, as entidades responsáveis pela comunicação de informações e as entidades notificadoras, consoante o caso, devem aplicar disposições que garantam que as reações recebidas sobre as lacunas de conciliação como previsto no artigo 3.º do Regulamento Delegado (UE) 2022/1858 sejam tidas em conta.

Artigo 10.º

Data até à qual os contratos de derivados devem ser comunicados

Uma contraparte de um derivado que preencha as condições estabelecidas no artigo 2.º, n.º 2, alíneas a) ou b), em XX. XXX.20XX ou a entidade responsável pela comunicação de informações deve comunicar todos os elementos desse derivado exigidos em conformidade com o anexo, apresentando uma comunicação com o tipo de evento «Atualização» no prazo de 180 dias de calendário a contar de [PO: inserir a data de aplicação das NTE], a menos que tenha apresentado uma comunicação com o tipo de ação «Alteração» ou «Correção» relativamente a esse derivado durante esse período.

([7]) Regulamento Delegado (UE) 2022/1858 da Comissão, de 10 de junho de 2022, que complementa o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação que especificam os procedimentos de conciliação de dados entre repositórios de transações e os procedimentos a aplicar pelos repositórios de transações para verificar o cumprimento, pela contraparte que comunica informações ou pela entidade que apresenta a comunicação de informações, dos requisitos de comunicação de informações, assim como a completude e exatidão dos dados comunicados (ver página 46 do presente Jornal Oficial).

Artigo 11.º

Revogação

O Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012 é revogado.

As referências ao regulamento revogado devem entender-se como sendo feitas ao presente regulamento.

Artigo 12.º

Entrada em vigor e aplicação

O presente regulamento entra em vigor no vigésimo dia seguinte ao da sua publicação no *Jornal Oficial da União Europeia*.

O presente regulamento é aplicável a partir de em 29 de abril de 2024.

O presente regulamento é obrigatório em todos os seus elementos e diretamente aplicável em todos os Estados-Membros.

Feito em Bruxelas, em 10 de junho de 2022.

Pela Comissão
A Presidente
Ursula VON DER LEYEN

ANEXO

Quadro 1

	Secção	Campo	Formato
1	Partes no derivado	Data e hora da comunicação	Data segundo a norma ISO 8601 em tempo universal coordenado (UTC) no formato AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Partes no derivado	Identificação da entidade que apresenta a comunicação de informações	Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation.
3	Partes no derivado	Entidade responsável pela comunicação de informações	Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation. O LEI deve ser devidamente renovado de acordo com as condições de qualquer uma das unidades operacionais locais acreditadas do Sistema Mundial de Identificação de Entidades Jurídicas.
4	Partes no derivado	Contraparte 1 (contraparte que comunica as informações)	Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation. O LEI deve ser devidamente renovado de acordo com as condições de qualquer uma das unidades operacionais locais acreditadas do Sistema Mundial de Identificação de Entidades Jurídicas.
5	Partes no derivado	Natureza da contraparte 1	F = Contraparte financeira N = Contraparte não financeira C = Contraparte central O = Outra
6	Partes no derivado	Setor empresarial da contraparte 1	Taxonomia das Contrapartes Financeiras: «INVF» - Empresa de investimento autorizada nos termos da Diretiva 2014/65/UE do Parlamento Europeu e do Conselho ([1]); «CDTI» - Instituição de crédito autorizada nos termos da Diretiva 2013/36/UE do Parlamento Europeu e do Conselho ([2]); «INUN» - Empresa de seguros ou de resseguros autorizada nos termos da Diretiva 2009/138/CE do Parlamento Europeu e do Conselho ([3]); «OICVM» - Um OICVM e, se for caso disso, a sua sociedade gestora, autorizados nos termos da Diretiva 2009/65/CE do Parlamento Europeu e do Conselho ([4]), exceto se esse OICVM for criado exclusivamente para efeitos de um ou mais planos de compra de ações reservados aos empregados; «ORPI» - Uma instituição de realização de planos de pensões profissionais (IRPPP), na aceção do artigo 6.º, ponto 1), da Diretiva (UE) 2016/2341 do Parlamento Europeu e do Conselho ([5]);

	Secção	Campo	Formato
			«AIFD» - Um fundo de investimento alternativo (FIA) na aceção do artigo 4.º, n.º 1, alínea a), da Diretiva 2011/61/UE do Parlamento Europeu e do Conselho ([6]), que esteja estabelecido na União ou seja gerido por um gestor de fundos de investimento alternativos (GFIA) autorizado ou registado nos termos dessa diretiva, exceto se esse FIA for criado exclusivamente para efeitos de um ou mais planos de compra de ações reservados aos empregados, ou se esse FIA for uma entidade com fins específicos de titularização a que se refere o artigo 2.º, n.º 3, alínea g), da Diretiva 2011/61/UE e, se for caso disso, o seu GFIA estabelecido na União; «CSDS» - Uma central de valores mobiliários autorizada nos termos do Regulamento (UE) n.º 909/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho ([7]); Taxonomia das contrapartes não financeiras. As seguintes categorias correspondem às principais secções da nomenclatura NACE, conforme definida no Regulamento (CE) n.º 1893/2006 do Parlamento Europeu e do Conselho ([8]): «A» - Agricultura, silvicultura e pesca; «B» - Indústrias extrativas; «C» - Indústrias transformadoras; «D» - Produção e distribuição de eletricidade, gás, vapor e ar condicionado; «E» - Atividades de abastecimento de água, saneamento, gestão de resíduos e descontaminação; «F» - Construção; «G» - Comércio por grosso e a retalho; reparação de veículos automóveis e motociclos; «H» - Transportes e armazenagem; «I» - Atividades de alojamento e restauração; «J» - Informação e comunicação; «K» - Atividades financeiras e de seguros; «L» - Atividades imobiliárias; «M» - Atividades de consultoria, científicas e técnicas; «N» - Atividades administrativas e de serviços de apoio; «O» - Administração pública e defesa; segurança social obrigatória; «P» - Ensino; «Q» - Saúde humana e ação social; «R» - Atividades artísticas, de espetáculos e recreativas; «S» - Outras atividades de serviços;

	Secção	Campo	Formato
			«T» - Atividades das famílias empregadoras de pessoal doméstico; atividades de produção de bens e serviços indiferenciados pelas famílias para uso próprio; «U» - Atividades dos organismos internacionais e outras instituições extraterritoriais; Sempre que seja comunicada mais do que uma atividade, indicar os códigos por ordem da importância relativa das respetivas atividades. Deixar em branco no caso das CCP e outros tipos de contrapartes nos termos do artigo 1.º, n.º 5, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 (9).
7	Partes no derivado	Limiar de compensação da contraparte 1	Valor booliano: VERDADEIRO = Acima do limiar FALSO = Abaixo do limiar
8	Partes no derivado	Tipo de identificador da contraparte 2	Valor booliano: — VERDADEIRO — FALSO, para as pessoas singulares que atuam como particulares que não são elegíveis para um LEI de acordo com a Declaração do Comité de Supervisão Regulamentar sobre pessoas singulares que atuam na qualidade de pessoas coletivas de 20 de setembro de 2015 («Declaração ROC»).
9	Partes no derivado	Contraparte 2	— Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation, ou código de até 72 caracteres alfanuméricos para pessoas singulares que atuam na qualidade de particulares que não são elegíveis para um LEI de acordo com a Declaração ROC. O código que identifica uma pessoa singular é composto pelo LEI da contraparte 1 seguido de um identificador único atribuído e mantido de forma coerente pela contraparte 1 para essa(s) pessoa(s) singular(es) para efeitos de comunicação de informações regulamentares.
10	Partes no derivado	Natureza da contraparte 2	Código de país segundo a norma ISO 3166 com 2 caracteres
11	Partes no derivado	Natureza da contraparte 2	F = Contraparte financeira N = Contraparte não financeira C = Contraparte central O = Outra

	Secção	Campo	Formato
12	Partes no derivado	Setor empresarial da contraparte 2	Taxonomia das Contrapartes Financeiras: «INVF» - Empresa de investimento autorizada nos termos da Diretiva 2014/65/UE; «CDTI» - Instituição de crédito autorizada nos termos da Diretiva 2013/36/UE; «INUN» - Empresa de seguros ou resseguros autorizada nos termos da Diretiva 2009/138/CE; «OICVM» - Um OICVM e, se for caso disso, a sua sociedade gestora, autorizados nos termos da Diretiva 2009/65/CE, exceto se esse OICVM for criado exclusivamente para efeitos de um ou mais planos de compra de ações reservados aos empregados; «ORPI» - Uma instituição de realização de planos de pensões profissionais (IRPPP), na aceção do artigo 6.º, ponto 1, da Diretiva (UE) 2016/2341; «AIFD» - Um fundo de investimento alternativo (FIA) na aceção do artigo 4.º, n.º 1, alínea a), da Diretiva 2011/61/UE, que esteja estabelecido na União ou seja gerido por um gestor de fundos de investimento alternativos (GFIA) autorizado ou registado nos termos dessa diretiva, exceto se esse FIA for criado exclusivamente para efeitos de um ou mais planos de compra de ações reservados aos empregados, ou se esse FIA for uma entidade com fins específicos de titularização a que se refere o artigo 2.º, n.º 3, alínea g), da Diretiva 2011/61/UE e, se for caso disso, o seu GFIA estabelecido na União; «CSDS» - Uma central de valores mobiliários autorizada nos termos do Regulamento (UE) n.º 909/2014; Taxonomia das contrapartes não financeiras. As seguintes categorias correspondem às principais secções da nomenclatura NACE, conforme definida no Regulamento (CE) n.º 1893/2006: «A» - Agricultura, silvicultura e pesca; «B» - Indústrias extrativas; «C» - Indústrias transformadoras; «D» - Produção e distribuição de eletricidade, gás, vapor e ar condicionado; «E» - Atividades de abastecimento de água, saneamento, gestão de resíduos e descontaminação; «F» - Construção; «G» - Comércio por grosso e a retalho; reparação de veículos automóveis e motociclos; «H» - Transportes e armazenagem; «I» - Atividades de alojamento e restauração; «J» - Informação e comunicação; «K» - Atividades financeiras e de seguros;

	Secção	Campo	Formato
			«L» - Atividades imobiliárias; «M» - Atividades de consultoria, científicas e técnicas; «N» - Atividades administrativas e de serviços de apoio; «O» - Administração pública e defesa; segurança social obrigatória; «P» - Ensino; «Q» - Saúde humana e ação social; «R» - Atividades artísticas, de espetáculos e recreativas; «S» - Outras atividades de serviços; «T» - Atividades das famílias empregadoras de pessoal doméstico; atividades de produção de bens e serviços indiferenciados pelas famílias para uso próprio; «U» - Atividades dos organismos internacionais e outras instituições extraterritoriais; Sempre que seja comunicada mais do que uma atividade, indicar os códigos por ordem da importância relativa das respetivas atividades. Deixar em branco no caso das CCP e outros tipos de contrapartes nos termos do artigo 1.º, n.º 5, do Regulamento (UE) n.º 648/2012.
13	Partes no derivado	Limiar de compensação da contraparte 2	Valor booliano: VERDADEIRO = Acima do limiar FALSO = Abaixo do limiar
14	Partes no derivado	Obrigação de comunicação de informações da contraparte 2	Valor booliano: — VERDADEIRO, se a contraparte 2 tiver a obrigação de comunicação de informações — FALSO, se a contraparte 2 não tiver a obrigação de comunicação de informações
15	Partes no derivado	Identificação do corretor	Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation.
16	Partes no derivado	Membro compensador	Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation.
17	Partes no derivado	Direção	4 caracteres alfabéticos: BYER = comprador SLLR = vendedor Preencher de acordo com o artigo 4.º do presente regulamento

	Secção	Campo	Formato
18	Partes no derivado	Direção da componente 1	4 caracteres alfabéticos: MAKE = ordenante TAKE = beneficiário Preencher de acordo com o artigo 4.º do presente regulamento
19	Partes no derivado	Direção da componente 2	4 caracteres alfabéticos: MAKE = ordenante TAKE = beneficiário Preencher de acordo com o artigo 4.º do presente regulamento
20	Partes no derivado	Ligação direta à atividade comercial ou à gestão de tesouraria	Valor booliano: VERDADEIRO = Sim FALSO = Não

(1) Diretiva 2014/65/UE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 15 de maio de 2014, relativa aos mercados de instrumentos financeiros e que altera a Diretiva 2002/92 / CE e a Diretiva 2011/61/UE (JO L 173 de 12.6.2014, p. 349).

(2) Diretiva 2013/36/UE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 26 de junho de 2013, relativa ao acesso à atividade das instituições de crédito e à supervisão prudencial das instituições de crédito e empresas de investimento, que altera a Diretiva 2002/87/CE e revoga as Diretivas 2006/48/CE e 2006/49/CE (JO L 176 de 27.6.2013, p. 338).

(3) Diretiva 2009/138/CE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 25 de novembro de 2009, relativa ao acesso à atividade de seguros e resseguros e ao seu exercício (Solvência II) (JO L 335 de 17.12.2009, p. 1).

(4) Diretiva 2009/65/CE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 13 de julho de 2009, que coordena as disposições legislativas, regulamentares e administrativas respeitantes a alguns organismos de investimento coletivo em valores mobiliários (OICVM) (JO L 302 de 17.11.2009, p. 32).

(5) Diretiva (UE) 2016/2341 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 14 de dezembro de 2016, relativa às atividades e à supervisão das instituições de realização de planos de pensões profissionais (IRPPP) (JO L 354 de 23.12.2016, p. 37).

(6) Diretiva 2011/61/UE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 8 de junho de 2011, relativa aos gestores de fundos de investimento alternativos e que altera as Diretivas 2003/41/CE e 2009/65/CE e os Regulamentos (CE) n.º 1060/2009 e (UE) n.º 1095/2010 (JO L 174 de 1.7.2011, p. 1).

(7) Regulamento (UE) n.º 909/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 23 de julho de 2014, relativo à melhoria da liquidação de valores mobiliários na União Europeia e às Centrais de Valores Mobiliários (CSDs) e que altera as Diretivas 98/26/CE e 2014/65/UE e o Regulamento (UE) n.º 236/2012 (JO L 257 de 28.8.2014, p. 1).

(8) Regulamento (CE) n.º 1893/2006 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 20 de dezembro de 2006, que estabelece a nomenclatura estatística das atividades económicas da NACE Revisão 2 e que altera o Regulamento (CEE) n.º 3037/90, assim como certos regulamentos CE relativos a domínios estatísticos específicos (JO L 393 de 30.12.2006, p. 1).

(9) Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 4 de julho de 2012, relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações (JO L 201 de 27.7.2012, p. 1).

Quadro 2

	Secção	Campo	Formato
1	Secção 2A – Identificadores e ligações	UTI	UTI segundo a norma ISO 23897. Até 52 caracteres alfanuméricos, só são permitidos os caracteres alfabéticos em maiúsculas A a Z e os algarismos 0 a 9.
2	Secção 2A – Identificadores e ligações	Número de referência da comunicação de informações	Campo alfanumérico com um máximo de 52 caracteres

	Secção	Campo	Formato
3	Secção 2A – Identificadores e ligações	UTI anterior (para as relações «uma para uma» e «uma para muitas» entre transações)	Até 52 caracteres alfanuméricos, só são permitidos os caracteres alfabéticos em maiúsculas A a Z e os algarismos 0 a 9.
4	Secção 2A – Identificadores e ligações	UTI da posição subsequente	Até 52 caracteres alfanuméricos, só são permitidos os caracteres alfabéticos em maiúsculas A a Z e os algarismos 0 a 9.
5	Secção 2A – Identificadores e ligações	Identificação da redução dos riscos pós-transação (PTRR)	Até 52 caracteres alfanuméricos, só são permitidos os caracteres alfabéticos em maiúsculas A a Z e os algarismos 0 a 9. Os primeiros 20 caracteres representam o LEI do prestador de serviços de compressão
6	Secção 2A – Identificadores e ligações	Identificador do pacote	Até 35 caracteres alfanuméricos.
7	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Número de identificação internacional de títulos (ISIN)	ISIN de 12 caracteres alfanuméricos segundo a norma ISO 6166
8	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Identificador único do produto (UPI)	UPI de 12 caracteres alfanuméricos segundo a norma ISO 4914
9	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Classificação dos produtos	CFI de 6 caracteres alfabéticos segundo a norma ISO 10962
10	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Tipo de contrato	CFDS = Contratos diferenciais financeiros FRAS = *Forwards* sobre taxas de juro FUTR = Futuros FORW = *Forwards* OPTN = Opção SPDB = Margem financeira definida (*spreadbet*) SWAP = *Swap* SWPT = Opção sobre *swaps* OTHR = Outro
11	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Categoria de ativos	COMM = Mercadorias e licenças de emissão CRDT = Crédito CURR = Moeda EQUI = Ações INTR = Taxa de juro
12	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Derivados baseados em criptoativos	Valor booliano: — VERDADEIRO - relativamente a derivados baseados em criptoativos — FALSO - relativamente a outros derivados

	Secção	Campo	Formato
13	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Tipo de identificação do subjacente	1 carácter alfabético: I = ISIN B = Cabaz X = Índice
14	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Identificação do subjacente	Para a identificação de subjacentes do tipo I: ISIN de 12 caracteres alfanuméricos segundo a norma ISO 6166 Para a identificação de subjacentes do tipo X: ISIN de 12 caracteres alfanuméricos segundo a norma ISO 6166, caso esteja disponível
15	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Indicador sobre o índice subjacente	Indicação do índice da taxa variável. 4 caracteres alfabéticos: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = *SWAP* EONIA EURI = EURIBOR EUUS = EURODÓLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = *Pfandbriefe* TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Tresouro SWAP = *SWAP* FUSW = Futuro *SWAP* EFFR = Taxa efetiva federal dos fundos (*Effective Federal Funds Rate*) OBFR = Taxa de financiamento bancário a um dia (*Overnight Bank Funding Rate*) CZNA = CZEONIA (índice médio da taxa checa a um dia)

	Secção	Campo	Formato
16	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Nome do índice subjacente	Até 50 caracteres alfanuméricos. São permitidos caracteres especiais se fizerem parte do nome completo do índice.
17	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Código do cabaz personalizado	Até 72 caracteres alfanuméricos, compostos pelo LEI do estruturador do cabaz seguido de até 52 caracteres alfanuméricos.
18	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Identificador dos componentes do cabaz	Para a identificação de subjacentes do tipo B: Todos os componentes individuais identificados através do ISIN com base na norma ISO 6166
19	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Moeda de liquidação 1	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
20	Secção 2B – Informações sobre os contratos	Moeda de liquidação 2	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
21	Secção 2C - Avaliação	Montante da avaliação	Valor positivo e negativo até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
22	Secção 2C - Avaliação	Moeda da avaliação	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
23	Secção 2C - Avaliação	Data e hora da avaliação	Data com base na norma ISO 8601 no formato «tempo universal coordenado» (UTC) AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
24	Secção 2C - Avaliação	Método de avaliação	4 caracteres alfabéticos: MTMA = Avaliação ao preço de mercado MTMO = Avaliação com recurso a um modelo CCPV = Avaliação por uma CCP
25	Secção 2C - Avaliação	Delta	Até 25 carateres numéricos, incluindo um máximo de 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. Admite-se qualquer valor entre -1 e 1 (incluindo -1 e 1).
26	Secção 2D - Garantias	Indicador sobre a carteira de garantias	Valor booliano: VERDADEIRO = garantido numa base de carteira FALSO = não faz parte de uma carteira
27	Secção 2D - Garantias	Código da carteira de garantias	Até 52 caracteres alfanuméricos Não são permitidos caracteres especiais

	Secção	Campo	Formato
28	Secção 2E -Atenuação de riscos/ Comunicação de informa-ções	Data e hora da confirmação	Data com base na norma ISO 8601 no formato «tempo universal coordenado» (UTC) AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
29	Secção 2E -Atenuação de riscos/ Comunicação de informa-ções	Confirmado	4 caracteres alfabéticos: — NCNF = não confirmado — ECNF = eletrónico — YCNF = não eletrónico
30	Secção 2F – Compen-sação	Obrigação de compensação	VERDADEIRO = o contrato pertence a uma classe de derivados OTC que tenha sido declarada sujeita à obrigação de compensação e ambas as partes no contrato estão sujeitas a essa obrigação de compensação FALSO = o contrato pertence a uma classe de derivados OTC que foi declarada sujeita à obrigação de compensação, mas uma ou ambas as contrapartes no contrato não estão sujeitas à obrigação de compensação ou valor «UKWN» - o contrato não pertence a uma classe de derivados OTC que tenha sido declarada sujeita à obrigação de compensação
31	Secção 2F – Compen-sação	Compensado	1 carácter alfabético: Y = sim, compensado centralmente, para as transações beta e gama. N = não, não compensado centralmente.
32	Secção 2F – Compen-sação	Data e hora da compensação	Data com base na norma ISO 8601 no formato «tempo universal coordenado» (UTC) AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
33	Secção 2F - Compensação	Contraparte central	Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation.
34	Secção 2G – Porme-nores da transação	Tipo de acordo-quadro	4 caracteres alfabéticos: «ISDA» - ISDA «CDEA» - Acordo de execução de derivados compensados FIA-ISDA «EUMA» - Acordo-quadro europeu «FPCA» - Acordo de clientes profissionais FOA «FMAT» - Acordo-quadro relativo a transações sobre instrumentos financeiros *forward* FBF «DERV» - *Deutscher Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte* (DRV) «CMOP» - *Contrato Marco de Operaciones Financieras* «CHMA» - Acordo-quadro suíço

	Secção	Campo	Formato
			«IDMA» - Acordo-quadro islâmico de derivados «EFMA» - Acordo-quadro EFET «GMRA» - GMRA «GMSL» - GMSLA «BIAG» - Acordo bilateral Ou «OTHR» se o tipo de acordo-quadro não constar da lista que precede
35	Secção 2G – Pormenores da transação	Outro tipo de acordo-quadro	Até 50 caracteres alfanuméricos.
36	Secção 2G – Pormenores da transação	Versão do acordo-quadro	Data com base na norma ISO 8601 de formato AAAA
37	Secção 2G – Pormenores da transação	Intragrupo	Valor booliano: VERDADEIRO = contrato celebrado como transação intragrupo FALSO = contrato não celebrado como transação intragrupo
38	Secção 2G – Pormenores da transação	PTRR (redução dos riscos pós-transação, ou *post-trade risk reduction*)	Valor booliano: VERDADEIRO = contrato resultante de um evento de PTRR FALSO = contrato não resultante de um evento de PTRR
39	Secção 2G – Pormenores da transação	Tipo de técnica de PTRR	4 caracteres alfabéticos: «PWOS» - Compressão de carteira sem um terceiro prestador de serviços «PWAS» - Compressão de carteira com um terceiro prestador de serviços ou uma CCP «PRBM» - Reequilíbrio da carteira/gestão das margens «OTHR» - Outro
40	Secção 2G – Pormenores da transação	Prestador de serviços de PTRR	Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation.
41	Secção 2G – Pormenores da transação	Espaço ou organização de execução	Código de identificação do mercado (MIC) com base na norma ISO 10383 com 4 caracteres alfanuméricos
42	Secção 2C – Pormenores da transação	Data e hora de execução	Data com base na norma ISO 8601 no formato «tempo universal coordenado» (UTC) AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
43	Secção 2C – Pormenores da transação	Data-valor	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.
44	Secção 2C – Pormenores da transação	Data de termo	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.
45	Secção 2C - Pormenores da transação	Data de cessação antecipada	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.

	Secção	Campo	Formato
46	Secção 2C – Pormenores da transação	Data final de liquidação contratual	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.
47	Secção 2C – Pormenores da transação	Tipo de entrega	4 caracteres alfabéticos: CASH = Em numerário PHYS = Física OPTL = Opcional para a contraparte ou conforme determinado por um terceiro
48	Secção 2G – Pormenores da transação	Preço	— Se o preço for expresso como valor monetário - qualquer valor até 18 caracteres numéricos, incluindo até 13 casas decimais. Se o valor tiver mais de 13 casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima. — Se o preço for expresso em percentagem - qualquer valor até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso em percentagem (por exemplo, 2,57 em vez de 2,57 %). Se o valor tiver mais de 10 casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima. O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
49	Secção 2G – Pormenores da transação	Moeda do preço	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
	Os campos 50 a 52 são reprodu-tíveis e devem ser preen-chidos no caso de derivados que envolvam tabelas de preços		
50	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor não ajustada do preço	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.
51	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final não ajustada do preço	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.
52	Secção 2G – Pormenores da transação	Preço em vigor entre a data-valor não ajustada e a data final	— Se o preço for expresso como valor monetário - qualquer valor até 18 caracteres numéricos, incluindo até 13 casas decimais. Se o valor tiver mais de 13 casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima. — Se o preço for expresso em percentagem - qualquer valor até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso em percentagem (por exemplo, 2,57 em vez de 2,57 %). Se o valor tiver mais de 10 casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima.

	Secção	Campo	Formato
			O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
53	Secção 2G – Pormenores da transação	Preço de transação do pacote	— Se o preço de transação do pacote for expresso como valor monetário - qualquer valor até 18 caracteres numéricos, incluindo até 13 casas decimais. Se o valor tiver mais de 13 casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima. — Se o preço de transação do pacote for expresso em percentagem - qualquer valor até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso em percentagem (por exemplo, 2,57 em vez de 2,57 %). Se o valor tiver mais de 10 casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima. O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
54	Secção 2G - Pormenores da transação	Moeda do preço de transação do pacote	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
55	Secção 2G – Pormenores da transação	Montante nocional da componente 1	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
56	Secção 2G – Pormenores da transação	Moeda nocional 1	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
	Os campos 57 a 59 são reprodu-tíveis e devem ser preenchi-dos no caso de derivados que envolvam tabelas de montantes nocionais		
57	Secção 2G – Pormenores da transação	Data-valor do montante nocional da componente 1	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD
58	Secção 2G – Pormenores da transação	Data final do montante nocional da componente 1	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD

	Secção	Campo	Formato
59	Secção 2G – Pormenores da transação	Montante nocional em vigor na data-valor associada à componente 1	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
60	Secção 2G – Pormenores da transação	Quantidade nocional total da componente 1	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
	Os campos 61 a 63 são reprodu-tíveis e devem ser preen-chidos no caso de derivados que envolvam tabelas de quanti-dades nocionais		
61	Secção 2G – Pormenores da transação	Data-valor da quantidade nocional da componente 1	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD
62	Secção 2G – Pormenores da transação	Data final da quantidade nocional da componente 1	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD
63	Secção 2G – Pormenores da transação	Quantidade nocional em vigor na data-valor associada à componente 1	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
64	Secção 2G – Pormenores da transação	Montante nocional da componente 2	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
65	Secção 2G – Pormenores da transação	Moeda nocional 2	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos

	Secção	Campo	Formato
	Os campos 66 a 68 são reprodu-tíveis e devem ser preen-chidos no caso de derivados que envolvam tabelas de montantes nocionais.		
66	Secção 2G – Porme-nores da transação	Data-valor do montante nocional da componente 2	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD
67	Secção 2G – Porme-nores da transação	Data final do montante nocional da componente 2	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD
68	Secção 2G – Porme-nores da transação	Montante nocional em vigor na data-valor associada à componente 2	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
69	Secção 2G – Porme-nores da transação	Quantidade nocional total da componente 2	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
	Os campos 70 a 72 são reprodu-tíveis e devem ser preen-chidos no caso de derivados que envolvam tabelas de quanti-dades nocionais		
70	Secção 2G – Porme-nores da transação	Data-valor da quantidade nocional da componente 2	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD
71	Secção 2G – Porme-nores da transação	Data final da quantidade nocional da componente 2	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD
72	Secção 2G – Porme-nores da transação	Quantidade nocional em vigor na data-valor associada à componente 2	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.

	Secção	Campo	Formato
	A secção dos campos 73 a 78 é reprodu-tível		
73	Secção 2G – Pormenores da transação	Outro tipo de pagamento	4 caracteres alfabéticos: UFRO = Pagamento antecipado, ou seja, o pagamento inicial efetuado por uma das contrapartes para fazer corresponder uma transação ao justo valor, ou por qualquer outro motivo que possa estar na origem de uma transação fora do mercado UWIN = Liquidação ou cessação total, ou seja, o pagamento de liquidação final efetuado quando uma transação é liquidada antes da sua data final; Pagamentos que possam resultar da cessação total da(s) transação(ões) de derivados PEXH = Permuta principal, ou seja, permuta de valores nocionais de *swaps* de divisas cruzadas
74	Secção 2G – Pormenores da transação	Outro montante de pagamento	Até 25 carateres numéricos, incluindo um máximo de 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. Admite-se qualquer valor superior ou igual a zero.
75	Secção 2G – Pormenores da transação	Outra moeda de pagamento	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
76	Secção 2G – Pormenores da transação	Outra data de pagamento	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.
77	Secção 2G – Pormenores da transação	Outro ordenante do pagamento	— Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation, ou código de até 72 caracteres alfanuméricos para pessoas singulares que atuam na qualidade de particulares que não são elegíveis para um LEI de acordo com a Declaração ROC. O código que identifica uma pessoa singular é composto pelo LEI da contraparte 1 seguido de um identificador único atribuído e mantido de forma coerente pela contraparte 1 para essa(s) pessoa(s) singular(es) para efeitos de comunicação de informações regulamentares.
78	Secção 2G – Pormenores da transação	Outro beneficiário do pagamento	— Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation, ou código de até 72 caracteres alfanuméricos para pessoas singulares que atuam na qualidade de particulares que não são elegíveis para um LEI de acordo com a Declaração ROC.

	Secção	Campo	Formato
			O código que identifica uma pessoa singular é composto pelo LEI da contraparte 1 seguido de um identificador único atribuído e mantido de forma coerente pela contraparte 1 para essa(s) pessoa(s) singular(es) para efeitos de comunicação de informações regulamentares.
79	Secção 2H - Taxas de juro	Taxa fixa da componente 1 ou cupão	• Valores positivos ou negativos até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expressos em percentagem (por exemplo, 2,57 em vez de 2,57 %). O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
80	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias correspondentes à taxa fixa ou ao cupão da componente 1	4 caracteres alfanuméricos: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrativa
81	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade de pagamento à taxa fixa ou ao cupão da componente 1	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diário WEEK = semanal MNTH = mensal YEAR = anual ADHO = *ad hoc* aplicável quando os pagamentos são irregulares EXPI = pagamento no vencimento

	Secção	Campo	Formato
82	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa fixa ou do cupão da componente 1	Qualquer valor inteiro maior ou igual a zero, até 3 caracteres numéricos.
83	Secção 2H - Taxas de juro	Identificador da taxa variável da componente 1	Se a taxa variável tiver um ISIN, o código ISIN para essa taxa.
84	Secção 2H - Taxas de juro	Indicador sobre a taxa variável da componente 1	Indicação do índice da taxa variável. 4 caracteres alfabéticos: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = *SWAP* EONIA EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA PFAN = *Pfandbriefe* TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Tresouro SWAP = *SWAP* FUSW = Futuro *SWAP* EFFR = Taxa efetiva federal dos fundos (*Effective Federal Funds Rate*) OBFR = Taxa de financiamento bancário a um dia (*Overnight Bank Funding Rate*) CZNA = CZEONIA (índice médio da taxa checa a um dia)

	Secção	Campo	Formato
85	Secção 2H - Taxas de juro	Designação da taxa variável da componente 1	Até 50 caracteres alfanuméricos. São permitidos caracteres especiais se fizerem parte do nome completo do índice.
86	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias da taxa variável da componente 1	4 caracteres alfanuméricos: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrativa
87	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 1	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diário WEEK = semanal MNTH = mensal YEAR = anual ADHO = *ad hoc* aplicável quando os pagamentos são irregulares EXPI = pagamento no vencimento
88	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 1	Qualquer valor inteiro maior ou igual a zero, até 3 caracteres numéricos.
89	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 1 – período	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diário WEEK = semanal MNTH = mensal YEAR = anual ADHO = *ad hoc* aplicável quando os pagamentos são irregulares EXPI = pagamento no vencimento

	Secção	Campo	Formato
90	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 1 – multiplicador	Qualquer valor inteiro maior ou igual a zero, até 3 caracteres numéricos.
91	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 1	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diário WEEK = semanal MNTH = mensal YEAR = anual ADHO = *ad hoc* aplicável quando os pagamentos são irregulares EXPI = pagamento no vencimento
92	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 1	Qualquer valor inteiro maior ou igual a zero, até 3 caracteres numéricos.
93	Secção 2H - Taxas de juro	*Spread* da componente 1	— Se o *spread* for expresso como valor monetário - qualquer valor até 18 caracteres numéricos, incluindo até 13 casas decimais. — Se o *spread* for expresso em percentagem - qualquer valor até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso em percentagem (por exemplo, 2,57 em vez de 2,57 %). — Se o *spread* for expresso como pontos de base - qualquer valor inteiro até 5 caracteres numéricos, expresso em pontos de base (por exemplo, 257 em vez de 2,57 %).
94	Secção 2H - Taxas de juro	Moeda do *spread* da componente 1	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
95	Secção 2H - Taxas de juro	Taxa fixa da componente 2	• Valores positivos ou negativos até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expressos em percentagem (por exemplo, 2,57 em vez de 2,57 %). O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
96	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias da taxa fixa da componente 2	4 caracteres alfanuméricos: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA

	Secção	Campo	Formato
			A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252 A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrativa
97	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade de pagamento à taxa fixa da componente 2	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diário WEEK = semanal MNTH = mensal YEAR = anual ADHO = *ad hoc* aplicável quando os pagamentos são irregulares EXPI = pagamento no vencimento
98	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa fixa da componente 2	Qualquer valor inteiro maior ou igual a zero, até 3 caracteres numéricos.
99	Secção 2H - Taxas de juro	Identificador da taxa variável da componente 2	Se a taxa variável tiver um ISIN, o código ISIN para essa taxa.
100	Secção 2H - Taxas de juro	Indicador sobre a taxa variável da componente 2	Indicação do índice da taxa variável. 4 caracteres alfabéticos: ESTR = €STR SONA = SONIA SOFR = SOFR EONA = EONIA EONS = *SWAP* EONIA EURI = EURIBOR EUUS = EURODOLLAR EUCH = EuroSwiss GCFR = GCF REPO ISDA = ISDAFIX LIBI = LIBID LIBO = LIBOR MAAA = Muni AAA

	Secção	Campo	Formato
			PFAN = *Pfandbriefe* TIBO = TIBOR STBO = STIBOR BBSW = BBSW JIBA = JIBAR BUBO = BUBOR CDOR = CDOR CIBO = CIBOR MOSP = MOSPRIM NIBO = NIBOR PRBO = PRIBOR TLBO = TELBOR WIBO = WIBOR TREA = Tresouro SWAP = *SWAP* FUSW = Futuro *SWAP* EFFR = Taxa efetiva federal dos fundos (*Effective Federal Funds Rate*) OBFR = Taxa de financiamento bancário a um dia (*Overnight Bank Funding Rate*) CZNA = CZEONIA (índice médio da taxa checa a um dia)
101	Secção 2H - Taxas de juro	Designação da taxa variável da componente 2	Até 50 caracteres alfanuméricos. São permitidos caracteres especiais se fizerem parte do nome completo do índice.
102	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias da taxa variável da componente 2	4 caracteres alfanuméricos: A001 = IC30360ISDAor30360AmericanBasicRule A002 = IC30365 A003 = IC30Actual A004 = Actual360 A005 = Actual365Fixed A006 = ActualActualICMA A007 = IC30E360orEuroBondBasismodel1 A008 = ActualActualISDA A009 = Actual365LorActuActubasisRule A010 = ActualActualAFB A011 = IC30360ICMAor30360basicrule A012 = IC30E2360orEurobondbasismodel2 A013 = IC30E3360orEurobondbasismodel3 A014 = Actual365NL A015 = ActualActualUltimo A016 = IC30EPlus360 A017 = Actual364 A018 = Business252

	Secção	Campo	Formato
			A019 = Actual360NL A020 = 1/1 NARR = Narrativa
103	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 2	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diário WEEK = semanal MNTH = mensal YEAR = anual ADHO = *ad hoc* aplicável quando os pagamentos são irregulares EXPI = pagamento no vencimento
104	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 2	Qualquer valor inteiro maior ou igual a zero, até 3 caracteres numéricos.
105	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 2 – período	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diário WEEK = semanal MNTH = mensal YEAR = anual ADHO = *ad hoc* aplicável quando os pagamentos são irregulares EXPI = pagamento no vencimento
106	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 2 – multiplicador	Qualquer valor inteiro maior ou igual a zero, até 3 caracteres numéricos.
107	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 2	4 caracteres alfabéticos: DAIL = diário WEEK = semanal MNTH = mensal YEAR = anual ADHO = *ad hoc* aplicável quando os pagamentos são irregulares EXPI = pagamento no vencimento
108	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 2	Qualquer valor inteiro maior ou igual a zero, até 3 caracteres numéricos.

	Secção	Campo	Formato
109	Secção 2H - Taxas de juro	*Spread* da componente 2	— Se o *spread* for expresso como valor monetário - qualquer valor até 18 caracteres numéricos, incluindo até 13 casas decimais. — Se o *spread* for expresso em percentagem - qualquer valor até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso em percentagem (por exemplo, 2,57 em vez de 2,57 %). — Se o *spread* for expresso como pontos de base - qualquer valor inteiro até 5 caracteres numéricos, expresso em pontos de base (por exemplo, 257 em vez de 2,57 %).
110	Secção 2H - Taxas de juro	Moeda do *spread* da componente 2	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
111	Secção 2H - Taxas de juro	*Spread* da transação do pacote	— Se o *spread* de transação do pacote for expresso como valor monetário - valor positivo ou negativo até 18 caracteres numéricos, incluindo até 13 casas decimais. Se o valor tiver mais de 13 casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima. — Se o *spread* de transação do pacote for expresso em percentagem - valor positivo ou negativo até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso em percentagem (por exemplo, 2,57 em vez de 2,57 %). Se o valor tiver mais de 10 casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima. — Se o *spread* de transação do pacote for expresso como pontos de base - qualquer valor inteiro até 5 caracteres numéricos, expresso em pontos de base (por exemplo, 257 em vez de 2,57 %). O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
112	Secção 2H - Taxas de juro	Moeda do *spread* da transação do pacote	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
113	Secção 2I - Divisas	Taxa de câmbio 1	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 18 caracteres numéricos, incluindo até 13 casas decimais. O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
114	Secção 2I - Divisas	Taxa de câmbio *forward*	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 18 caracteres numéricos, incluindo até 13 casas decimais. O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.

	Secção	Campo	Formato
115	Secção 2I - Divisas	Base da taxa de câmbio	7 caracteres que representam dois códigos de moeda com base na norma ISO 4217 separados por «/» sem restringir a ordem do par de moedas. O primeiro código de moeda indica a unidade monetária e o segundo a moeda cotada.
116	Secção 2J – Mercadorias e licenças de emissão (geral)	Produto de base	Apenas são admitidos valores na coluna «Produto de base» da classificação dos derivados sobre mercadorias.
117	Secção 2J – Mercadorias e licenças de emissão (geral)	Subproduto	Apenas são admitidos valores na coluna «Subproduto» da classificação dos derivados sobre mercadorias.
118	Secção 2J - Mercadorias e licenças de emissão (geral)	Subproduto adicional	Apenas são admitidos valores em «Subproduto ulterior» da classificação dos derivados sobre mercadorias.
119	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Zona ou ponto de entrega	Código EIC com 16 caracteres alfanuméricos Este campo pode ser repetido.
120	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Ponto de interconexão	Código EIC com 16 caracteres alfanuméricos
121	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Tipo de carga	BSLD = Carga de base PKLD = Pico de carga OFFP = Períodos mortos HABH = Horário/Blocos horários SHPD = Moldado GASD = Dia de gás OTHR = Outro
	A secção dos campos 122 a 131 é reprodutível		
122	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Hora de início do intervalo de entrega	hh:mm:ssZ
123	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Hora final do intervalo de entrega	hh:mm:ssZ

	Secção	Campo	Formato
124	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Data de início da entrega	Data com base na norma ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
125	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Data final da entrega	Data com base na norma ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
126	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Duração	MNUT = Minutos HOUR = Hora DASD = Dia WEEK = Semana MNTH = Mês QURT = Trimestre SEAS = Estação YEAR= Anual OTHR=Outro
127	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Dias da semana	WDAY = Dias da semana WEND = Fim de semana MOND = Segunda TUED = Terça WEDD = Quarta THUD = Quinta FRID = Sexta SATD = Sábado SUND = Domingo XBHL - Excluindo feriados IBHL - Incluindo feriados Podem ser indicados múltiplos valores
128	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Capacidade de entrega	Até 20 caracteres numéricos, incluindo casas decimais O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
129	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Unidade de quantidade	KWAT = KW KWHH = KWh/h KWHD = KWh/d MWAT = MW MWHH = MWh/h MWHD = MWh/d GWAT = GW

	Secção	Campo	Formato
			GWHH = GWh/h GWHD = GWh/d THMD = Therm/d KTMD = Ktherm/d MTMD = Mtherm/d CMPD = cm/d MCMD = mcm/d BTUD = Btu/d MBTD = MMBtu/d MJDD = MJ/d HMJD = 100MJ/d MMJD = MMJ/d GJDD = GJ/d
130	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Preço por quantidade por intervalo de tempo	Até 20 caracteres numéricos, incluindo casas decimais. O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
131	Secção 2K – Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Moeda do preço por quantidade por intervalo de tempo	Código de moeda segundo a norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
132	Secção 2L - Opções	Tipo de opção	4 carácter alfabético: PUTO = Opção de venda CALL = Opção de compra OTHR = Quando não é possível determinar se se trata de uma opção de compra ou de venda
133	Secção 2L - Opções	Estilo da opção	4 caracteres alfabéticos: AMER = Americano BERM = Bermudas EURO = Europeu
134	Secção 2L - Opções	Preço de exercício	— Se o preço de exercício for expresso como montante monetário: qualquer valor até 18 carateres numéricos, incluindo até 13 casas decimais (por exemplo, 6,39 USD expresso como 6,39) para opções sobre ações, opções sobre mercadorias, opções sobre divisas e produtos análogos. Se o valor tiver mais de 13 casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima.

	Secção	Campo	Formato
			— Se o preço de exercício for expresso em percentagem: qualquer valor até 11 carateres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso em percentagem (por exemplo, 2,1 em vez de 2,1 %) para opções sobre taxas de juro, opções sobre *swaps* de taxas de juro e de crédito cotadas em *spread* e produtos análogos. O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
	Os campos 135 a 137 são reprodu-tíveis e devem ser preen-chidos no caso de derivados que envolvam tabelas de preços de exercício		
135	Secção 2L - Opções	Data-valor do preço de exercício	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.
136	Secção 2L - Opções	Data final do preço de exercício	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.
137	Secção 2L - Opções	Preço de exercício em vigor na data-valor associada	— Se o preço de exercício for expresso como montante monetário: qualquer valor até 18 carateres numéricos, incluindo até 13 casas decimais (por exemplo, 6,39 USD expresso como 6,39) para opções sobre ações, opções sobre mercadorias, opções sobre divisas e produtos análogos. Se o valor tiver mais de 13 casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima. — Se o preço de exercício for expresso em percentagem: qualquer valor até 11 carateres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso em percentagem (por exemplo, 2,1 em vez de 2,1 %) para opções sobre taxas de juro, opções sobre *swaps* de taxas de juro e de crédito cotadas em *spread* e produtos análogos. O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto. O sinal negativo, se for utilizado, não conta como um carater numérico.
138	Secção 2L - Opções	Moeda/par de moedas do preço de exercício	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos; ou para as opções sobre divisas: 7 caracteres que representam dois códigos de moeda com base na norma ISO 4217 separados por «/» sem restringir a ordem do par de moedas. O primeiro código de moeda indica a moeda de base e o segundo a moeda da oferta.

	Secção	Campo	Formato
139	Secção 2L - Opções	Montante do prémio da opção	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
140	Secção 2L - Opções	Moeda do prémio da opção	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
141	Secção 2L - Opções	Data de pagamento do prémio da opção	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.
142	Secção 2I - Opções	Data de vencimento do subjacente	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.
143	Secção 2M – Derivados de crédito	Grau de prioridade	4 caracteres alfabéticos: SNDB = Prioritário, como por exemplo dívida prioritária não garantida (de empresas/do setor financeiro), dívida soberana em moeda estrangeira (de Estados), SBOD = Subordinado, como por exemplo dívida subordinada ou de nível 2 inferior (do setor bancário), dívida não prioritária subordinada ou de nível 2 superior (do setor bancário), OTHR = Outros, como por exemplo ações preferenciais ou capital de nível 1 (do setor bancário) ou outros derivados de crédito
144	Secção 2M – Derivados de crédito	Entidade de referência	Código de país segundo a norma ISO 3166 com 2 caracteres, ou Código de país de 2 caracteres segundo a norma ISO 3166-2 seguido de travessão «-» e do código de subdivisão de país com até 3 carateres alfanuméricos, ou Código Identificador de Entidade Jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 com 20 caracteres alfanuméricos
145	Secção 2M – Derivados de crédito	Série	Campo de número inteiro com um máximo de 5 caracteres
146	Secção 2M – Derivados de crédito	Versão	Campo de número inteiro com um máximo de 5 caracteres
147	Secção 2M – Derivados de crédito	Fator do índice	Qualquer valor até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso como fração decimal (por exemplo, 0,05 em vez de 5 %) entre 0 e 1 (incluindo 0 e 1). O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.

	Secção	Campo	Formato
148	Secção 2M – Derivados de crédito	Parcela	Valor booliano: VERDADEIRO = em parcelas FALSO = sem parcelas
149	Secção 2M – Derivados de crédito	Ponto de ligação do índice de *swap* de derivado de crédito	Qualquer valor até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso como fração decimal (por exemplo, 0,05 em vez de 5 %) entre 0 e 1 (incluindo 0 e 1). O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
150	Secção 2M – Derivados de crédito	Ponto de desconexão do índice de CDS	Qualquer valor até 11 caracteres numéricos, incluindo até 10 casas decimais, expresso como fração decimal (por exemplo, 0,05 em vez de 5 %) entre 0 e 1 (incluindo 0 e 1). O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
151	Secção 2N - Alterações do derivado	Tipo de ação	4 caracteres alfabéticos: NEWT = Novo MODI = Alteração CORR = Correção TERM = Cessação EROR = Erro REVI = Reabertura VALU = Avaliação POSC = Componente de posição
152	Secção 2N - Alterações do derivado	Tipo de evento	4 caracteres alfabéticos: TRAD = Transação NOVA = Transferência COMP = PTRR (redução dos riscos pós-transação, ou *post-trade risk reduction*) ETRM = Cessação antecipada CLRG = Compensação EXER = Exercício ALOC = Afetação CREV = Evento de crédito CORP = Evento empresarial INCP = Inclusão em posição UPDT = Atualização
153	Secção 2N - Alterações do derivado	Data do evento	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.

	Secção	Campo	Formato
154	Secção 2N - Alterações do derivado	Nível	4 caracteres alfabéticos: TCTN = Transação PSTN = Posição

Quadro 3

	Secção	Campo	Formato
1	Partes no derivado	Data e hora da comunicação	Data segundo a norma ISO 8601 em tempo universal coordenado (UTC) no formato AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
2	Partes no derivado	Identificação da entidade que apresenta a comunicação de informações	Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation.
3	Partes no derivado	Entidade responsável pela comunicação de informações	Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation. O LEI deve ser devidamente renovado de acordo com as condições de qualquer uma das unidades operacionais locais acreditadas do Sistema Mundial de Identificação de Entidades Jurídicas.
4	Partes no derivado	Contraparte 1 (contraparte que comunica as informações)	Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation. O LEI deve ser devidamente renovado de acordo com as condições de qualquer uma das unidades operacionais locais acreditadas do Sistema Mundial de Identificação de Entidades Jurídicas.
5	Partes no derivado	Tipo de identificador da contraparte 2	Valor booliano: — VERDADEIRO — FALSO, para as pessoas singulares que atuam na qualidade de particulares que não são elegíveis para um LEI de acordo com a Declaração ROC.
6	Partes no derivado	Contraparte 2	— Código de 20 caracteres alfanuméricos do identificador de entidade jurídica (LEI) segundo a norma ISO 17442 incluído nos dados do LEI, como publicado pela Global LEI Foundation, ou código de até 72 caracteres alfanuméricos para pessoas singulares que atuam na qualidade de particulares que não são elegíveis para um LEI de acordo com a Declaração ROC. O código que identifica uma pessoa singular é composto pelo LEI da contraparte 1 seguido de um identificador único atribuído e mantido de forma coerente pela contraparte 1 para essa(s) pessoa(s) singular(es) para efeitos de comunicação de informações regulamentares.
7	Garantia	Data e hora da garantia	Data com base na norma ISO 8601 no formato «tempo universal coordenado» (UTC) AAAA-MM-DDThh:mm:ssZ
8	Garantia	Indicador sobre a carteira de garantias	Valor booliano: VERDADEIRO = garantido numa base de carteira FALSO = não faz parte de uma carteira

	Secção	Campo	Formato
9	Garantia	Código da carteira de garantias	Até 52 caracteres alfanuméricos Não são permitidos caracteres especiais
10	Garantia	UTI	Até 52 caracteres alfanuméricos, só são permitidos os caracteres alfabéticos em maiúsculas A a Z e os algarismos 0 a 9.
11	Garantia	Categoria de constituição de garantias	4 caracteres alfabéticos: UNCL = sem garantia PRC1 = garantia parcial: contraparte 1 apenas PRC2 = garantia parcial: contraparte 2 apenas PRCL = garantia parcial OWC1 = garantia unilateral: contraparte 1 apenas OWC2 = garantia unilateral: contraparte 2 apenas OWP1 = garantia parcial ou unilateral: contraparte 1 OWP2 = garantia parcial ou unilateral: contraparte 2 FLCL = garantia total Preencher de acordo com o artigo 5.º do presente regulamento
12	Garantia	Margem inicial fornecida pela contraparte 1 (pré-margem de avaliação)	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
13	Garantia	Margem inicial fornecida pela contraparte 1 (pós-margem de avaliação)	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
14	Garantia	Moeda da margem inicial fornecida	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
15	Garantia	Margem de variação fornecida pela contraparte 1 (pré-margem de avaliação)	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.

	Secção	Campo	Formato
16	Garantia	Margem de variação fornecida pela contraparte 1 (pós-margem de avaliação)	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
17	Garantia	Moeda das margens de variação fornecidas	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
18	Garantia	Garantias excedentárias fornecidas pela contraparte 1	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
19	Garantia	Moeda das garantias excedentárias fornecidas	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
20	Garantia	Margem inicial cobrada pela contraparte 1 (pré-margem de avaliação)	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
21	Garantia	Margem inicial cobrada pela contraparte 1 (pós-margem de avaliação)	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
22	Garantia	Moeda da margem inicial cobrada	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
23	Garantia	Margem de variação cobrada pela contraparte 1 (pré-margem de avaliação)	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.

	Secção	Campo	Formato
24	Garantia	Margem de variação cobrada pela contraparte 1 (pós-margem de avaliação)	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
25	Garantia	Moeda da margem de variação cobrada	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
26	Garantia	Garantias excedentárias cobradas pela contraparte 1	Qualquer valor maior ou igual a zero, até 25 caracteres numéricos, incluindo até 5 casas decimais. Se o valor tiver mais de cinco casas decimais, as contrapartes que comunicam as informações devem arredondar para cima O separador decimal não conta como um caráter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
27	Garantia	Moeda das garantias excedentárias cobradas	Código de moeda com base na norma ISO 4217 com 3 caracteres alfabéticos
28	Garantia	Tipo de ação	«MARU» - Atualização da margem «CORR» - Correção
29	Garantia	Data do evento	Data com base na norma ISO 8601 no formato UTC AAAA-MM-DD.

Quadro 4

Classificação das mercadorias

Produto de base	Subproduto	Subproduto ulterior
«AGRI» - Agrícola	«GROS» - Sementes e frutos oleaginosos	«FWHT» - Trigo forrageiro «SOYB» - Soja «CORN» - Milho «RPSD» - Colza «RICE» - Arroz «OTHR» - Outros
	«SOFT» - Produtos agrícolas perecíveis	«CCOA» - Cacau «ROBU» - Café Robusta «WHSG» - Açúcar branco «BRWN» - Açúcar bruto «OTHR» - Outros
	«POTA» - Batata	
	«OOLI» - Azeite	«LAMP» - Azeite lampante «OTHR» - Outros

Produto de base	Subproduto	Subproduto ulterior
	«DIRY» - Laticínios	
	«FRST» - Silvicultura	
	«SEAF» - Marisco	
	«LSTK» - Gado	
	«GRIN» - Cereais	«MWHT» - Trigo para moagem «OTHR» - Outros
	«OTHR» - Outros	
«NRGY» - Energia	«ELEC» - Eletricidade	«BSLD» - Carga de base «FITR» - Direitos financeiros de transporte «PKLD» - Pico de carga «OFFP» - Períodos mortos «OTHR» - Outros
	«NGAS» - Gás natural	«GASP» - GASPOOL «LNGG» - Gás natural liquefeito (GNL) «NBPG» - National Balancing Point (NBP) «NCGG» - NetConnect Germany (NCG) «TTFG» - Title Transfer Facility (TTF) «OTHR» - Outros
	«OILP» - Petróleo	«BAKK» - Bakken «BDSL» - Biodiesel «BRNT» - Brent «BRNX» - Brent NX «CNDA» - Canadiano «COND» - Condensado «DSEL» - Diesel «DUBA» - Dubai «ESPO» - ESPO «ETHA» - Etanol «FUEL» - Fuel «FOIL» - Fuelóleo «GOIL» - Gasóleo «GSLN» - Gasolina «HEAT» - Petróleo para aquecimento «JTFL» - Combustível para motores a jato «KERO» - Querosene «LLSO» - Light Louisiana Sweet (LLS) «MARS» - Mars «Naph» — Naphta «NGLO» - NGL «TAPI» - Tapis

Produto de base	Subproduto	Subproduto ulterior
		«URAL» - Urais «WTIO» - WTI «OTHR» - Outros
	«COAL» - Carvão «INRG» - Interenergia «RNNG» - Energia renovável «LGHT» - Produtos de cauda leves «DIST» - Destilados «OTHR» - Outros	
«ENVR» - Ambiental	«EMIS» - Emissões	«CERE» - CER «ERUE» - ERU «EUAE» - EUA «EUAA» - EUAA «OTHR» - Outros
	«WTHR» - Meteorologia «CRBR» - Relacionado com o carbono «OTHR» - Outros	
«FRGT» - Transporte de mercadorias	«WETF» - Carga líquida	«TNKR» - Navios-cisterna «OTHR» - Outros
	«DRYF» - Carga sólida	«DBCR» - Navios graneleiros sólidos «OTHR» - Outros
	«CSHP» - Porta-contentores	
	«OTHR» - Outros	
«FRTL» - Fertilizantes	«AMMO» - Amónia «DAPH» - Fosfato diamónico «PTSH» - Potassa «SLPH» - Enxofre «UREA» - Ureia «UAAN» - UNA (ureia e nitrato de amónio) «OTHR» - Outros	
«INDP» - Produtos industriais	«CSTR» - Construção «MFTG» - Indústria transformadora	

Produto de base	Subproduto	Subproduto ulterior
«METL» - Metais	«NPRM» - Não preciosos	«ALUM» - Alumínio
		«ALUA» - Liga de alumínio
		«CBLT» - Cobalto
		«COPR» - Cobre
		«IRON» - Minério de ferro
		«LEAD» - Chumbo
		«MOLY» - Molibdénio
		«NASC» - NASAAC
		«NICK» - Níquel
		«STEL» - Aço
		«TINN» - Estanho
		«ZINC» - Zinco
		«OTHR» - Outros
	«PRME» - Preciosos	«GOLD» - Ouro
		«SLVR» - Prata
		«PTNM» - Platina
		«PLDM» - Paládio
		«OTHR» - Outros
«MCEX» - Diversas mercadorias exóticas		
«PAPR» - Papel	«CBRD» - Cartão de embalagem	
	«NSPT» - Papel de jornal	
	«PULP» - Pasta de papel	
	«RCVP» - Papel reciclado	
	«OTHR» - Outros	
«POLY» - Polipropileno	«PLST» - Plástico	
	«OTHR» - Outros	
«INFL» - Inflação		
«OEST» - Estatísticas económicas oficiais		
«OTHC» - Outros derivados C10 na aceção do quadro 10.1 do anexo III do Regulamento Delegado (UE) 2017/583 da Comissão ([1])		
«OTHR» - Outros		

([1]) Regulamento Delegado (UE) 2017/583 da Comissão, de 14 de julho de 2016, que complementa o Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, relativo aos mercados de instrumentos financeiros, no que respeita às normas técnicas de regulamentação sobre os requisitos de transparência para as plataformas de negociação e empresas de investimento em matéria de obrigações, produtos financeiros estruturados, licenças de emissão e instrumentos derivados (JO L 87 de 31.3.2017, p. 229).