

REGULAMENTO DELEGADO (UE) 2016/909 DA COMISSÃO**de 1 de março de 2016****que completa o Regulamento (UE) n.º 596/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho no que respeita às normas técnicas de regulamentação aplicáveis ao conteúdo das notificações a apresentar às autoridades competentes e à compilação, publicação e manutenção da lista de notificações****(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 596/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 16 de abril de 2014, relativo ao abuso de mercado (Regulamento Abuso de Mercado) e que revoga a Diretiva 2003/6/CE do Parlamento Europeu e do Conselho e as Diretivas 2003/124/CE, 2003/125/CE e 2004/72/CE da Comissão ⁽¹⁾, em particular o artigo 4.º, n.º 4, terceiro parágrafo,

Considerando o seguinte:

- (1) O Regulamento Delegado da Comissão a adotar em conformidade com o artigo 27.º, n.º 3, terceiro parágrafo, do Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho ⁽²⁾ requer a apresentação contínua de dados de referência identificadores dos instrumentos financeiros admitidos à negociação. Por outro lado, o artigo 4.º do Regulamento (UE) n.º 596/2014 requer que as plataformas de negociação notifiquem às respetivas autoridades competentes, apenas uma vez, os dados relativos aos instrumentos financeiros objeto de um pedido de admissão à negociação, admitidos à negociação ou negociados e uma vez posteriormente, quando um instrumento financeiro deixa de ser negociado ou admitido à negociação. Sob reserva da diferença supracitada nas obrigações em matéria de comunicação previstas no Regulamento (UE) n.º 596/2014 e no regulamento delegado supramencionado, as obrigações em matéria de comunicação previstas neste regulamento devem ser harmonizadas com as obrigações em matéria de comunicação previstas no regulamento delegado supramencionado, de modo a reduzir os encargos administrativos para as entidades sujeitas a essas obrigações.
- (2) A fim de permitir a utilização eficaz e eficiente da lista de notificações de instrumentos financeiros, as plataformas de negociação devem notificar os instrumentos financeiros de forma completa e exata. Pelos mesmos motivos, as autoridades competentes devem acompanhar e avaliar as notificações de instrumentos financeiros recebidas das plataformas de negociação e informá-las imediatamente caso seja identificada alguma falha de informação ou imprecisão. Do mesmo modo, a Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados (ESMA) deve acompanhar e avaliar a exaustividade e a exatidão das notificações recebidas das autoridades competentes e informá-las de imediato caso seja identificada alguma falha de informação ou imprecisão.
- (3) A lista de notificações de instrumentos financeiros deve ser publicada pela ESMA em formato eletrónico, de leitura ótica e transferível, a fim de facilitar a eficiente utilização e troca de dados.
- (4) O presente regulamento tem por base os projetos de normas técnicas de regulamentação apresentados pela ESMA à Comissão. A ESMA conduziu consultas públicas abertas sobre os projetos de normas técnicas de regulamentação que servem de base ao presente regulamento, analisou os seus potenciais custos e benefícios e solicitou o parecer do Grupo de Interessados do Setor dos Valores Mobiliários e dos Mercados, criado pelo artigo 37.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho ⁽³⁾.
- (5) Para garantir o bom funcionamento dos mercados financeiros, é necessário que o presente regulamento entre em vigor urgentemente e que as suas disposições sejam aplicáveis a partir da mesma data que as previstas no Regulamento (UE) n.º 596/2014,

⁽¹⁾ JO L 173 de 12.6.2014, p. 1.

⁽²⁾ Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 15 de maio de 2014, relativo aos mercados de instrumentos financeiros e que altera o Regulamento (UE) n.º 648/2012 (JO L 173 de 12.6.2014, p. 84).

⁽³⁾ 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).

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

Artigo 1.º

As notificações de instrumentos financeiros nos termos do artigo 4.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 596/2014 devem incluir todos os dados mencionados no Quadro 2 do anexo ao presente regulamento que pertencem aos instrumentos financeiros em causa.

Artigo 2.º

1. As autoridades competentes devem acompanhar e avaliar, utilizando processos automatizados, se as notificações recebidas nos termos do artigo 4.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 596/2014 cumprem os requisitos previstos no artigo 1.º do presente regulamento e no artigo 2.º do Regulamento de Execução (UE) 2016/378 ⁽¹⁾.
2. Os operadores das plataformas de negociação devem ser informados, utilizando processos automatizados e de imediato, de qualquer falha de informação nas notificações recebidas, bem como de impossibilidade de entrega das notificações antes do prazo previsto no artigo 1.º do Regulamento de Execução (UE) 2016/378.
3. As autoridades competentes devem, utilizando processos automatizados, notificar os instrumentos financeiros à ESMA de forma completa e exata nos termos do artigo 1.º.

No dia seguinte ao da receção das notificações dos instrumentos financeiros em conformidade com o artigo 4.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 596/2014, a ESMA deve, utilizando processos automatizados, consolidar as notificações recebidas de cada autoridade competente.

4. A ESMA deve, utilizando processos automatizados, acompanhar e avaliar se as notificações recebidas das autoridades competentes estão completas e são exatas e se respeitam as normas e os formatos aplicáveis especificados no Quadro 3 do anexo ao Regulamento de Execução (UE) 2016/378.
5. A ESMA deve, utilizando processos automatizados e de imediato, informar as autoridades competentes de quaisquer falhas de informação nas notificações transmitidas e de eventuais impossibilidades de entrega das notificações antes do prazo previsto no artigo 1.º, n.º 3, do Regulamento de Execução (UE) 2016/378.
6. A ESMA deve, utilizando processos automatizados, publicar no seu sítio a lista completa das notificações em formato eletrónico, transferível e de leitura ótica.

Artigo 3.º

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

O presente regulamento é aplicável a partir de 3 de julho de 2016.

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

Feito em Bruxelas, em 1 de março de 2016.

Pela Comissão
O Presidente
Jean-Claude JUNCKER

⁽¹⁾ Regulamento de Execução (UE) 2016/378 da Comissão, de 11 de março de 2016, que estabelece normas técnicas de execução relativas à data, ao formato e ao modelo da apresentação das notificações às autoridades competentes em conformidade com o Regulamento (UE) n.º 596/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho (JO L 72 de 17.3.2016, p. 1).

ANEXO

**Notificação dos instrumentos financeiros nos termos do artigo 4.º, n.º 1, do Regulamento (UE)
n.º 596/2014**

Quadro 1

Classificação de derivados de mercadorias e licenças de emissão para o Quadro 2 (campos 35-37)

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» — Matérias-primas agrícolas	«CCOA» — Cacau «ROBU» — Café Robusta «WHSG» — Açúcar branco «BRWN» — Açúcar bruto «OTHR» — Outros
	«POTA» — Batata	
	«OOLI» — Azeite	«LAMP» — Lampante
	«DIRY» — Laticínios	
	«FRST» — Silvicultura	
	«SEAF» — Marisco	
	«LSTK» — Animais	
	«GRIN» — Cereais	«MWHT» — Trigo para moagem
«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 «LNNG» — Gás natural liquefeito (GNL) «NBPG» — National Balancing Point (NBP) «NCGG» — NetConnect Germany (NCG) «TTFG» — Title Transfer Facility (TTF)

Produto de base	Subproduto	Subproduto ulterior
	«OILP» — Petróleo	«BAKK» — Bakken «BDSL» — Biodiesel «BRNT» — Brent «BRNX» — Brent NX «CNDA» — Canadano «COND» — Condensado «DSEL» — Diesel «DUBA» — Dubai «ESPO» — ESPO «ETHA» — Etanol «FUEL» — Fuel «FOIL» — Fuelóleo «GOIL» — Gasóleo «GSLN» — Gasolina «HEAT» — Gasóleo de aquecimento «JTFL» — Combustível para motores a jato «KERO» — Querosene «LLSO» — Light Louisiana Sweet (LLS) «MARS» — Mars «NAPH» — Naptha «NGLO» — NGL «TAPI» — Tapis «URAL» — Urais «WTIO» — WTI
	«COAL» — Carvão «INRG» — Interenergias «RNNG» — Energias renováveis «LGHT» — Produtos de cauda leves «DIST» — Destilados	
«ENVR» — Ambiental	«EMIS» — Emissões	«CERE» — Reduções certificadas de emissões (RCE) «ERUE» — Unidades de redução de emissões (URE) «EUAE» — Quotas de emissão UE «EUAA» — Quotas de emissão do setor de aviação UE «OTHR» — Outros
	«WTHR» — Meteorologia «CRBR» — Carbono	
«FRGT» — Transporte de mercadorias	«WETF» — Carga líquida	«TNKR» — Navios-cisterna
	«DRYF» — Carga sólida	«DBCR» — Graneleiros
	«CSHP» — Porta-contentores	

Produto de base	Subproduto	Subproduto ulterior
«FRTL» — Fertilizantes	«AMMO» — Amoníaco «DAPH» — Fosfato diamónico «PTSH» — Potassa «SLPH» — Enxofre «UREA» — Ureia «UAAN» — UNA (ureia e nitrato de amónio)	
«INDP» — Produtos industriais	«CSTR» — Construção «MFTG» — Indústria transformadora	
«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 compacto «NSPT» — Papel de jornal «PULP» — Pasta de papel «RCVP» — Papel reciclado	
«POLY» — Polipropileno	«PLST» — Plástico	
«INFL» — Inflação		
«OEST» — Estatísticas económicas oficiais		

Produto de base	Subproduto	Subproduto ulterior
«OTHC» — Outros C10 na aceção do Quadro 10.1, secção «Outros derivados C10», do anexo III do Regulamento Delegado da Comissão que completa o Regulamento (UE) n.º 600/2014 no que respeita às normas técnicas de regulamentação sobre os requisitos de transparência relativos às plataformas de negociação e empresas de investimento para obrigações, produtos financeiros estruturados, licenças de emissão e derivados.	«DLVR» — Entregáveis «NDLV» — Não entregáveis	
«OTHR» — Outros		

Quadro 2

Conteúdo das notificações a apresentar às autoridades competentes em conformidade com o artigo 4.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 596/2014

N.º	Campo	Conteúdo a notificar
Campos gerais		
1	Código de identificação do instrumento	Código utilizado para identificar o instrumento financeiro.
2	Nome completo do instrumento	Designação completa do instrumento financeiro.
3	Classificação do instrumento	Taxonomia utilizada para classificar o instrumento financeiro. Deverá ser fornecido um código CFI completo e exato.
4	Indicador de derivados de mercadorias	Indicar se o instrumento financeiro é abrangido pela definição de derivados de mercadorias prevista no artigo 2.º, n.º 1, ponto 30, do Regulamento (UE) n.º 600/2014.
Campos relacionados com o emitente		
5	Identificador do emitente ou operador da plataforma de negociação	Identificador de entidade jurídica (LEI) do emitente ou operador da plataforma de negociação.
Campos relacionados com a plataforma		
6	Plataforma de negociação	Caso disponível, código de identificação do segmento de mercado (<i>segment</i> MIC) da plataforma de negociação ou do internalizador sistemático ou, na sua ausência, código MIC de exploração (<i>operating</i> MIC).
7	Designação curta do instrumento financeiro	Designação curta do instrumento financeiro de acordo com a norma ISO 18774.
8	Pedido de admissão à negociação pelo emitente	Se o emitente do instrumento financeiro pediu ou aprovou a negociação ou admissão à negociação dos seus instrumentos financeiros numa plataforma de negociação.

N.º	Campo	Conteúdo a notificar
9	Data da aprovação da admissão à negociação	Data e hora em que o emitente aprovou a admissão à negociação ou a negociação dos seus instrumentos financeiros numa plataforma de negociação.
10	Data do pedido de admissão à negociação	Data e hora do pedido de admissão à negociação na plataforma de negociação.
11	Data de admissão à negociação ou data da primeira negociação	Data e hora da admissão à negociação na plataforma de negociação ou data e hora em que o instrumento foi negociado pela primeira vez ou em que uma ordem ou um preço foi recebido pela primeira vez pela plataforma de negociação.
12	Data de cessação	Data e hora em que o instrumento financeiro deixa de ser negociado ou de estar admitido à negociação na plataforma de negociação. Se a data e hora não estiverem disponíveis, o campo não deve ser preenchido.

Campos relacionados com aspetos nocionais

13	Moeda nocional 1	Moeda em que o nocional está denominado. No caso de um contrato de derivados de taxas de juro ou divisas, trata-se da moeda nocional da componente 1 ou a divisa 1 do par. No caso de opções sobre swaps em que o swap subjacente é denominado numa moeda única, esta será a moeda nocional do swap subjacente. Para opções sobre swaps em que o swap subjacente é denominado em várias divisas, trata-se da moeda nocional da componente 1 do swap.
----	------------------	--

Campos relacionados com obrigações ou outras formas de títulos de dívida

14	Valor nominal total emitido	Valor nominal total emitido, expresso em valor monetário.
15	Data de vencimento	Data de vencimento do instrumento financeiro notificado. O campo aplica-se a instrumentos de dívida com prazo de vencimento definido.
16	Moeda do valor nominal	Moeda do valor nominal dos instrumentos de dívida.
17	Valor nominal por unidade/valor mínimo negociado	Valor nominal de cada instrumento. Caso não esteja disponível, indicar o valor mínimo negociado.
18	Taxa fixa	Percentagem de rendimento a taxa fixa de um instrumento de dívida quando detido até à data de vencimento, expresso em percentagem.
19	Identificador do índice/índice de referência de uma obrigação a taxa variável	Se existir um identificador.
20	Nome do índice/índice de referência de uma obrigação a taxa variável	O nome do índice, caso não exista um identificador.
21	Vigência do índice/índice de referência de uma obrigação a taxa variável.	Vigência do índice/índice de referência de uma obrigação a taxa variável. A vigência deve ser expressa em dias, semanas, meses ou anos.
22	Diferencial em pontos de base do índice/índice de referência de uma obrigação a taxa variável	Número de pontos de base acima ou abaixo do índice utilizado para calcular um preço.

N.º	Campo	Conteúdo a notificar
23	Prioridade da obrigação	Identificar o tipo de obrigação: dívida prioritária, mezzanine ou dívida subordinada (<i>junior debt</i>).
Campos relacionados com derivados e derivados titularizados		
24	Prazo de validade	Prazo de validade do instrumento financeiro. O campo só é aplicável aos instrumentos derivados com um prazo de validade específico.
25	Multiplicador de preço	Número de unidades do instrumento subjacente representadas por um único contrato de derivados. Para um futuro ou opção sobre um índice, indicar o montante por ponto do índice. Para as margens financeiras definidas (<i>spread bets</i>), indicar a flutuação do preço do instrumento subjacente em que as margens financeiras definidas se baseiam.
26	Código do instrumento subjacente	Código ISIN (<i>International Securities Identification Number</i> — número internacional de identificação dos valores mobiliários) do instrumento subjacente. Para os certificados americanos que atestam o depósito de valores mobiliários (ADR), os certificados mundiais que atestam o depósito de valores mobiliários (GDR) e instrumentos semelhantes, indicar o código ISIN do instrumento financeiro em que estes instrumentos se baseiam. Para as obrigações convertíveis, indicar o código ISIN do instrumento em que a obrigação pode ser convertida. Para os derivados ou outros instrumentos baseados num subjacente, indicar o código ISIN do instrumento subjacente, se este último for admitido à negociação ou negociado numa plataforma de negociação. Quando for um dividendo sobre ações, indicar o código do instrumento da ação conexas que confere direito aos dividendos subjacentes. Para <i>swaps</i> de risco de incumprimento, indicar o código ISIN da obrigação de referência. Se o subjacente for um índice e detiver um ISIN, indicar o código ISIN desse índice. Se o subjacente for um cabaz, indicar os códigos ISIN de cada constituinte do cabaz que seja admitido à negociação ou negociado numa plataforma de negociação. Os campos 26 e 27 devem, portanto, ser preenchidos o número de vezes que for necessário para enumerar todos os instrumentos do cabaz.
27	Emitente do subjacente	Caso o instrumento se refira a um emitente e não a um instrumento único, indicar o código LEI do emitente.
28	Nome do índice subjacente	Caso o subjacente seja um índice, indicar o nome do índice.
29	Vigência do índice subjacente	Caso o subjacente seja um índice, indicar o período de vigência do índice.
30	Tipo de opção	Indicar se o contrato de derivados é uma opção de compra (direito a comprar um ativo subjacente específico) ou uma opção de venda (direito a vender um ativo subjacente específico) ou se é impossível determinar se se trata de uma opção de compra ou de venda no momento da execução. No que respeita às opções de <i>swaps</i> (<i>swaptions</i>), trata-se de uma: — «opção de venda» no caso de uma opção sobre <i>swaps</i> a receber (<i>receiver swaption</i>), em que o comprador tem o direito de celebrar um contrato de <i>swaps</i> enquanto beneficiário a taxa fixa; — «opção de compra» no caso de uma opção sobre <i>swaps</i> a pagar (<i>payer swaption</i>), em que o comprador tem o direito de celebrar um contrato de <i>swaps</i> enquanto pagador a taxa fixa. No caso de limites e patamares, trata-se de uma: — «opção de venda», se for previsto um patamar; — «opção de compra», se for previsto um limite. Este campo apenas se aplica aos derivados que sejam opções ou títulos de subscrições (<i>warrants</i>).

N.º	Campo	Conteúdo a notificar
31	Preço de exercício	Preço predeterminado a que o titular terá de comprar ou vender o instrumento subjacente, ou uma indicação de que o preço não pode ser determinado no momento da execução. O campo apenas se aplica às opções ou aos títulos de subscrição (<i>warrants</i>) cujo preço de exercício possa ser determinado no momento da execução. Quando o preço não estiver ainda disponível, o valor a indicar deve ser «PNDG» (pendente). Quando o preço de exercício não é aplicável, o campo não deve ser preenchido.
32	Moeda do preço de exercício	A moeda do preço de exercício.
33	Modalidades de exercício da opção	Indicar se a opção pode ser exercida apenas numa data fixa (opção europeia e asiática), em diferentes datas predeterminadas (opção bermudense) ou a qualquer momento durante o período de vigência do contrato (opção americana). O campo só é aplicável às opções, aos títulos de subscrição (<i>warrants</i>) e aos certificados de direitos (<i>entitlement certificates</i>).
34	Modalidades de entrega	Indicar se o instrumento financeiro é liquidado mediante entrega física ou pagamento em numerário. Quando não é possível determinar o tipo de entrega no momento da execução, o valor a indicar deve ser «OPTL». Este campo só é aplicável aos instrumentos derivados.

Derivados de mercadorias e licenças de emissão

35	Produto de base	Produto de base da classe do ativo subjacente conforme especificado no quadro de classificação dos derivados de mercadorias e licenças de emissão.
36	Subproduto	O subproduto da classe do ativo subjacente conforme especificado no quadro de classificação dos derivados de mercadorias e licenças de emissão. Este campo requer um produto de base.
37	Subproduto ulterior	O subproduto ulterior da classe do ativo subjacente conforme especificado no quadro de classificação dos derivados de mercadorias e licenças de emissão. Este campo requer um subproduto.
38	Tipo de operação	Tipo de operação conforme especificado pela plataforma de negociação.
39	Tipo de preço final	Tipo de preço final conforme especificado pela plataforma de negociação.

Derivados de taxas de juro

— Os campos nesta secção apenas devem ser preenchidos no caso de instrumentos que tenham como ativo subjacente um instrumento não-financeiro sobre taxas de juro.

40	Taxa de referência	Nome da taxa de referência.
41	Vigência do contrato (taxa de juro)	Se a classe de ativos incidir sobre taxas de juro, este campo indica a vigência do contrato. A vigência deverá ser expressa em dias, semanas, meses ou anos.

N.º	Campo	Conteúdo a notificar
42	Moeda nocional 2	Em caso de <i>swaps</i> em várias divisas ou em divisas cruzadas, indicar a moeda em que é denominada a componente 2 do contrato. Para opções sobre <i>swaps</i> em que o subjacente é denominado em várias divisas, a moeda em que é denominada a componente 2 do swap.
43	Taxa fixa da componente 1	Indicar a taxa fixa da componente 1 utilizada, se aplicável.
44	Taxa fixa da componente 2	Indicar a taxa fixa da componente 2 utilizada, se aplicável.
45	Taxa variável da componente 2	Indicar a taxa de juros utilizada, se aplicável.
46	Vigência do contrato da componente 2 (taxa de juro)	Indicar o período de referência da taxa de juro que é fixada com intervalos predefinidos em função de uma taxa de referência do mercado. A vigência deve ser expressa em dias, semanas, meses ou anos.

Derivados de taxas de câmbio

— Os campos desta secção apenas devem ser preenchidos no caso de instrumentos que tenham como ativo subjacente um instrumento não-financeiro cambial.

47	Moeda nocional 2	Este campo deve ser preenchido com a moeda subjacente 2 do par de divisas (a moeda 1 será indicada no campo 13 — moeda nocional 1).
48	Tipo de taxa de câmbio	Tipo de moeda subjacente.