

**REGULAMENTO DELEGADO (UE) 2019/358 DA COMISSÃO****de 13 de dezembro de 2018****que complementa o Regulamento (UE) 2015/2365 do Parlamento Europeu e do Conselho no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação sobre a recolha, verificação, agregação, comparação e publicação de dados relativos às operações de financiamento através de valores mobiliários (OFVM) por parte dos repositórios de transações****(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) 2015/2365 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 25 de novembro de 2015, relativo à transparência das operações de financiamento através de valores mobiliários e de reutilização e que altera o Regulamento (UE) n.º 648/2012 <sup>(1)</sup>, nomeadamente o artigo 5.º, n.º 7, alínea a), e o artigo 12.º, n.º 3, alíneas a) e b),

Considerando o seguinte:

- (1) A fim de garantir a elevada qualidade dos dados das OFVM notificados aos repositórios de transações, estes últimos devem verificar a identidade das entidades notificadoras, a integridade lógica da sequência segundo a qual os dados das OFVM são notificados e a completude e correção destes dados.
- (2) Pelo mesmo motivo, os repositórios de transações devem conciliar os elementos de cada notificação de OFVM recebida. Deve ser especificado um processo normalizado que permita aos repositórios de transações realizarem a conciliação de forma coerente e reduzirem os riscos de não conciliação dos dados das OFVM. No entanto, devido às especificidades dos sistemas tecnológicos utilizados pelas entidades notificadoras, certos dados das OFVM poderão não ser idênticos, donde a necessidade de aplicar determinadas tolerâncias, de modo que a existência de pequenas diferenças nos dados de OFVM notificados não impeça as autoridades de analisarem os dados com um nível de confiança adequado.
- (3) Prevê-se que, com o passar do tempo, as entidades notificadoras melhorem as suas notificações, tanto em termos da redução do número de notificações rejeitadas como em termos de notificações conciliadas. Porém, deve-lhes ser concedido tempo suficiente para se adaptarem aos requisitos de notificação, nomeadamente para evitar a acumulação de operações não conciliadas assim que a obrigação de notificação se torne aplicável. Assim, convém que, numa primeira fase, apenas um número reduzido de campos deva ser objeto de conciliação.
- (4) As entidades notificadoras e as entidades responsáveis pela notificação, quando aplicável, devem poder controlar o cumprimento das suas obrigações de notificação nos termos do Regulamento (UE) 2015/2365. Assim, para este efeito, devem poder aceder diariamente a determinadas informações relativas a essas notificações, nomeadamente ao resultado da verificação das mesmas e aos progressos da conciliação dos dados notificados. Deste modo, é necessário especificar as informações que um repositório de transações deve disponibilizar a estas entidades no final de cada dia útil.
- (5) A fim de facilitar a integridade dos dados das OFVM, o acesso direto e imediato referido no artigo 12.º, n.º 2, do Regulamento (UE) 2015/2365 deve ser assegurado de forma harmonizada e coerente. De modo a normalizar a notificação, minimizar os custos para o setor e garantir a comparabilidade e a agregação coerente dos dados entre os repositórios de transações, convém que todas as notificações e trocas de informações sejam transmitidas em modelos de formato XML e sigam uma metodologia de utilização generalizada no setor financeiro.
- (6) O acesso aos dados a nível das posições relativamente às exposições entre duas contrapartes determinadas é fundamental para que as entidades referidas no artigo 12.º, n.º 2, do Regulamento (UE) 2015/2365 possam identificar potenciais fontes de riscos sistémicos ou não sistémicos para a estabilidade financeira.
- (7) A fim de assegurar um nível adequado de transparência perante o público relativamente às OFVM, os critérios utilizados na agregação de posições devem habilitar o público em geral a compreender o funcionamento dos

<sup>(1)</sup> JO L 337 de 23.12.2015, p. 1.

mercados de OFVM, sem comprometer a confidencialidade dos dados notificados aos repositórios de transações. A periodicidade e os elementos das posições agregadas a publicar por um repositório de transações nos termos do artigo 12.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2015/2365 devem ser especificados de forma a terem por base o quadro conexo previsto no Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho <sup>(2)</sup> no que respeita aos contratos de derivados.

- (8) O presente regulamento tem por base os projetos de normas técnicas de regulamentação apresentados pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados (ESMA) à Comissão em conformidade com o procedimento previsto no artigo 10.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho <sup>(3)</sup>.
- (9) As disposições do presente regulamento dizem respeito às normas operacionais para a recolha, agregação e comparação de dados por parte dos repositórios de transações, bem como aos procedimentos que os repositórios de transações devem aplicar para verificar se os elementos das OFVM que lhes são comunicados estão completos e corretos. A fim de garantir a coerência entre estas disposições e facilitar aos repositórios de transações uma visão global, é aconselhável incluir as normas técnicas de regulamentação conexas num único regulamento.
- (10) A ESMA conduziu consultas públicas abertas sobre os projetos de normas técnicas de regulamentação, 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 nos termos do artigo 37.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010,

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

#### Artigo 1.º

### Verificação das notificações de OFVM pelos repositórios de transações

1. Os repositórios de transações devem verificar todos os seguintes elementos, nas notificações de OFVM que recebam:
- A identidade da entidade notificadora referida no campo 2 do quadro 1 do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2019/363 da Comissão <sup>(4)</sup>;
  - Se o modelo XML utilizado para notificar uma OFVM segue a metodologia da norma ISO 20022 em conformidade com o Regulamento de Execução (UE) 2019/363;
  - Se a entidade notificadora, caso seja diferente da contraparte notificadora referida no campo 3 do quadro 1 do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2019/363, está devidamente autorizada a apresentar notificações em nome da contraparte notificadora, exceto no caso previsto no artigo 4.º, n.º 3, do Regulamento (UE) 2015/2365;
  - Se não foi apresentada anteriormente a mesma notificação de OFVM;
  - Se uma notificação de OFVM com o tipo de ação «Modificação» diz respeito a uma notificação de OFVM apresentada anteriormente;
  - Se uma notificação de OFVM com o tipo de ação «Modificação» não diz respeito a uma OFVM notificada como cancelada;
  - Se a notificação de OFVM não inclui o tipo de ação «Nova» relativamente a uma OFVM já notificada anteriormente;
  - Se a notificação de OFVM não inclui o tipo de ação «Componente de posição» relativamente a uma OFVM já notificada anteriormente;

<sup>(2)</sup> 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).

<sup>(3)</sup> 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).

<sup>(4)</sup> Regulamento de Execução (UE) 2019/363 da Comissão, de 13 de dezembro de 2018, que estabelece normas técnicas de execução no que se refere ao formato e à periodicidade das notificações dos elementos das operações de financiamento através de valores mobiliários (OFVM) aos repositórios de transações em conformidade com o Regulamento (UE) 2015/2365 do Parlamento Europeu e do Conselho e que altera o Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012 no que se refere à utilização de códigos na comunicação de informações sobre contratos de derivados (ver página 85 do presente Jornal Oficial).

- i) Se a notificação de OFVM não tem por objetivo alterar os elementos da entidade notificadora, da contraparte notificadora ou de outra contraparte numa OFVM anteriormente notificada;
- j) Se a notificação de OFVM não tem por objetivo alterar uma notificação de OFVM existente especificando uma data-valor posterior à data de vencimento notificada da OFVM;
- k) Se a notificação de OFVM está correta e completa.

2. Os repositórios de transações devem verificar se as informações sobre garantias foram comunicadas nos campos 73 a 96 do quadro 2 do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2019/363, para as OFVM relativamente às quais o campo 72, «Empréstimo de valores mobiliários sem garantia», do mesmo quadro tem a indicação de «falso». Os repositórios de transações notificam, nos termos do artigo 3.º do presente regulamento, a entidade notificadora e a contraparte notificadora, bem como a entidade responsável pela notificação, quando aplicável, do resultado da verificação.

3. Os repositórios de transações devem rejeitar uma notificação de OFVM que não cumpra um dos requisitos estabelecidos no n.º 1 e afeta-la a uma das categorias de rejeição indicadas no quadro 2 do anexo I do presente regulamento.

4. Os repositórios de transações transmitem à entidade notificadora e à contraparte notificadora, bem como à entidade responsável pela notificação, quando aplicável, informações pormenorizadas sobre os resultados da verificação de dados referida no n.º 1, num prazo de sessenta minutos após a receção de uma notificação de OFVM. Os repositórios de transações transmitem esses resultados num formato XML e num modelo desenvolvido em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022. Os resultados devem incluir, sempre que aplicável, os motivos específicos que justificam a rejeição de uma notificação de OFVM em conformidade com o n.º 3.

## Artigo 2.º

### Conciliação de dados pelos repositórios de transações

1. Os repositórios de transações devem procurar conciliar uma OFVM notificada seguindo as etapas enumeradas no n.º 2, desde que estejam preenchidas todas as condições seguintes:

- a) Os repositórios de transações concluíram as verificações previstas no artigo 1.º, n.ºs 1 e 2;
- b) Ambas as contrapartes na OFVM notificada estão sujeitas a uma obrigação de notificação;
- c) Os repositórios de transações não receberam uma notificação subsequente com o tipo de ação «Erro» relativamente à OFVM notificada.

2. Caso estejam preenchidas todas as condições previstas no n.º 1, os repositórios de transações devem seguir as etapas seguintes, utilizando o último valor notificado em cada um dos campos do quadro 1 do anexo I do presente regulamento:

- a) Um repositório de transações que tenha recebido uma notificação de OFVM deve verificar se recebeu uma notificação de OFVM correspondente, de, ou em nome da, outra contraparte;
- b) Um repositório de transações que não tenha recebido a notificação de OFVM correspondente referida na alínea a) deve procurar identificar o repositório de transações que recebeu a notificação de OFVM correspondente, comunicando a todos os repositórios de transações registados os valores dos seguintes campos da OFVM notificada: «Identificador único da operação», «Contraparte notificadora», «Outra contraparte» e «Tipo de acordo-quadro»;
- c) Um repositório de transações que estabeleça que outro repositório de transações recebeu a notificação de OFVM correspondente referida na alínea a) deve trocar com esse repositório de transações os elementos da OFVM notificada num formato XML e num modelo desenvolvido em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022;
- d) Sob reserva do disposto na alínea e), um repositório de transações deve tratar uma OFVM notificada como conciliada caso os dados dessa OFVM coincidam com os dados da notificação de OFVM correspondente referida na alínea a) do presente número;
- e) O repositório de transações deve procurar determinar separadamente a correspondência entre os campos relativos ao empréstimo e os campos relativos aos dados das garantias de uma OFVM notificada, em conformidade com os limites de tolerância e as datas de aplicação pertinentes indicadas no quadro 1 do anexo I do presente regulamento;

- f) Seguidamente, o repositório de transações deve atribuir valores às categorias de conciliação para cada OFVM notificada, como indicado no quadro 3 do anexo I do presente regulamento;
- g) O repositório de transações deve concluir as etapas enunciadas nas alíneas a) a f) do presente número tão rapidamente quanto possível, não podendo efetua-las depois das 18:00 (Tempo Universal Coordenado) de cada dia útil;
- h) Um repositório de transações que não possa conciliar uma OFVM notificada deve procurar encontrar a correspondência dos dados dessa OFVM no dia útil seguinte. O repositório de transações deve deixar de procurar conciliar a OFVM notificada trinta dias de calendário após a data de vencimento da OFVM ou depois de ter recebido uma notificação sobre a mesma com o tipo de ação «Cessação» ou «Componente de posição».
3. No final de cada dia útil, os repositórios de transações devem confirmar o número total de OFVM notificadas conciliadas junto de cada repositório de transações com o qual tenha conciliado OFVM notificadas.
4. O mais tardar sessenta minutos após a conclusão do processo de conciliação previsto no n.º 2, alínea g), os repositórios de transações devem transmitir à entidade notificadora e à contraparte notificadora, bem como à entidade responsável pela notificação, quando aplicável, os resultados do processo de conciliação a que submeteram as OFVM notificadas. Os repositórios de transações devem transmitir estes resultados num formato XML e num modelo desenvolvido em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022, incluindo informações sobre os campos que não foram objeto de conciliação.

### Artigo 3.º

#### Mecanismos de resposta no final do dia

No final de cada dia útil, o repositório de transações disponibiliza à entidade notificadora e à contraparte notificadora, bem como à entidade responsável pela notificação, quando aplicável, num formato XML e num modelo desenvolvido em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022, as informações seguintes sobre as OFVM pertinentes:

- a) As OFVM notificadas durante esse dia;
- b) Os últimos valores das OFVM que não tenham vencido ou que não tenham sido objeto de notificações com os tipos de ação «Erro», «Cessação» ou «Componente de posição»;
- c) Os identificadores de transação únicos (UTI) das OFVM relativamente às quais o campo 72 do quadro 2 do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2019/363 tenha a indicação de «falso» e as informações sobre garantias nos campos 73 a 96 do mesmo quadro não tenham ainda sido comunicadas;
- d) As notificações de OFVM rejeitadas durante esse dia;
- e) O estado de conciliação de todas as OFVM notificadas, exceto as OFVM que tenham expirado ou relativamente às quais tenham sido recebidas notificações de OFVM com o tipo de ação «Cessação» ou «Componente de posição» mais de um mês antes desse dia útil.

### Artigo 4.º

#### Acesso aos dados das OFVM

O repositório de transações concede às entidades enumeradas no artigo 12.º, n.º 2, do Regulamento (UE) 2015/2365 acesso direto e imediato, incluindo em caso de delegação nos termos do artigo 28.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010, aos dados das OFVM, em formato eletrónico de leitura automática em conformidade com Regulamento Delegado (UE) 2019/357 da Comissão <sup>(5)</sup>.

Para efeitos do primeiro parágrafo, o repositório de transações deve utilizar um formato XML e um modelo desenvolvido em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022.

<sup>(5)</sup> Regulamento Delegado (UE) 2019/357 da Comissão, de 13 de dezembro de 2018, que complementa o Regulamento (UE) 2015/2365 do Parlamento Europeu e do Conselho relativo às normas técnicas de regulamentação que especificam o acesso aos dados sobre operações de financiamento através de valores mobiliários (OFVM) conservados nos repositórios de transações (ver página 22 do presente Jornal Oficial).

## Artigo 5.º

**Cálculo dos dados a nível das posições e acesso aos mesmos**

1. O repositório de transações calcula os dados a nível das posições das exposições entre contrapartes em termos de empréstimo e garantia. O cálculo dos dados a nível das posições deve basear-se nos seguintes critérios:
  - a) Os valores das categorias de conciliação, de acordo com o quadro 3 do anexo I do presente regulamento;
  - b) O tipo de OFVM;
  - c) O setor das contrapartes;
  - d) O estado em termos de compensação;
  - e) Se a transação tem ou não lugar numa plataforma de negociação;
  - f) O tipo de garantia;
  - g) A moeda da componente de numerário;
  - h) O escalão de maturidade;
  - i) O escalão de fator de desconto;
  - j) Os repositórios de transações aos quais a outra contraparte notificou elementos de OFVM.
2. O repositório de transações deve assegurar às entidades enumeradas no artigo 12.º, n.º 2, do Regulamento (UE) 2015/2365 o acesso aos dados a nível das posições em conformidade com o acesso aos dados especificados em Regulamento Delegado (UE) 2019/357.
3. Os dados a nível das posições referidos no n.º 1 devem ser transmitidos num formulário eletrónico e de leitura automática, bem como num formato XML e num modelo desenvolvido em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022.
4. O acesso a que se refere o n.º 2 é concedido tão rapidamente quanto possível e o mais tardar no dia útil seguinte ao da receção de uma notificação de OFVM nos termos do artigo 4.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2015/2365.
5. O repositório de transações concede às entidades referidas no artigo 12.º, n.º 2, do Regulamento (UE) 2015/2365 o acesso a dados agregados, em conformidade com o acesso aos dados especificados no Regulamento Delegado (UE) 2019/357 e calculados de acordo com as normas e processos definidos de comum acordo para a recolha e agregação globais dos dados relativos a OFVM.

## Artigo 6.º

**Cálculo dos dados de posição agregados para publicação**

1. O repositório de transações deve agregar os dados sobre posições em conformidade com os critérios enunciados nos n.ºs 2 e 3, no que se refere aos seguintes valores:
  - a) O montante de capital das operações de venda com acordo de recompra, das operações de compra/revenda ou de venda/recompra, a quantidade agregada de valores mobiliários ou mercadorias cedidos ou tomados em empréstimo e o montante de empréstimos com imposição de margem;
  - b) O número de UTI correspondentes às OFVM relevantes;
  - c) O valor de mercado da garantia.
2. O repositório de transações deve agregar os dados sobre posições relativos a todas as OFVM notificadas com o tipo de ação «Nova» entre as 00:00:00 UTC de sábado e as 23:59:59 UTC de sexta-feira, com base nos critérios seguintes e nos respetivos valores constantes do quadro 1 do anexo II do presente regulamento:
  - a) A localização da contraparte notificadora ou, quando aplicável, da sucursal relevante;
  - b) A localização da outra contraparte ou, quando aplicável, da sucursal relevante;
  - c) O tipo de OFVM;
  - d) O estado da OFVM em termos de conciliação, como indicado no quadro 3 do anexo I do presente regulamento;

- e) O tipo de plataforma de negociação em que a OFVM foi concluída;
  - f) Se a OFVM foi ou não objeto de compensação;
  - g) O método de transferência da garantia;
  - h) Cada índice utilizado como referência numa OFVM que é negociada numa plataforma de negociação diferente de «XXXX», caso o valor nominal agregado notificado ao repositório de transações no índice seja superior a 5 mil milhões de EUR e existam pelo menos seis contrapartes diferentes que tenham notificado as OFVM relevantes ao repositório de transações.
3. O repositório de transações deve agregar os dados sobre posições relativos a todas as OFVM que não tenham vencido ou relativamente às quais não tenham sido recebidos notificações com os tipos de ação «Erro», «Cessação», «Componente de posição» até às 23:59:59 UTC de sexta-feira, com base nos critérios seguintes e nos respetivos valores constantes do quadro 1 do anexo II do presente regulamento:
- a) A localização da contraparte notificadora ou, quando aplicável, da sucursal relevante;
  - b) A localização da outra contraparte ou, quando aplicável, da sucursal relevante;
  - c) O tipo de OFVM;
  - d) O estado de conciliação da OFVM, indicado no quadro 3 do anexo I do presente regulamento;
  - e) O tipo de plataforma de negociação em que a OFVM foi concluída;
  - f) Se a OFVM foi ou não objeto de compensação;
  - g) O método de transferência da garantia;
  - h) Cada índice utilizado como referência numa OFVM que é negociada numa plataforma de negociação diferente de «XXXX», caso o valor nominal agregado notificado ao repositório de transações no índice seja superior a 5 mil milhões de EUR e existam pelo menos seis contrapartes diferentes que tenham notificado as OFVM relevantes ao repositório de transações.
4. O repositório de transações deve dispor de um procedimento para identificar valores extraordinários relativos aos dados de posição agregados.
5. O repositório de transações deve dispor de um procedimento para executar e notificar correções dos dados de posição agregados, incluindo os decorrentes de notificações com o tipo de ação «Erro», e publicar os dados agregados iniciais e corrigidos.

#### Artigo 7.º

##### **Publicação dos dados de posição agregados**

1. O repositório de transações deve publicar no respetivo sítio Web, com uma periodicidade semanal e o mais tardar até ao meio-dia de terça-feira, os dados de posição agregados, calculados nos termos do artigo 6.º, das OFVM notificadas até às 23:59:59 UTC da sexta-feira anterior.
2. O repositório de transações deve publicar todos os dados de posição agregados em EUR e utilizar as taxas de câmbio publicadas no sítio Web do BCE na sexta-feira anterior à publicação desses dados.
3. O repositório de transações deve assegurar a publicação dos dados de posição agregados sob forma de quadro, como indicado no anexo II do presente regulamento, e que permita o teledescarregamento dos dados.
4. Os dados de posição agregados publicados pelo repositório de transações no respetivo sítio Web devem nele permanecer durante pelo menos 104 semanas.

#### Artigo 8.º

##### **Entrada em vigor**

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

É obrigatório em todos os seus elementos e diretamente aplicável em todos os Estados-Membros.

Feito em Bruxelas, em 13 de dezembro de 2018.

*Pela Comissão*  
*O Presidente*  
Jean-Claude JUNCKER

---

## ANEXO I

## Quadro 1

## Campos relativos à conciliação, níveis de tolerância e data de início da fase de conciliação

Quadro	Secção	Campo	Tolerância	Data de início referida no:
Dados relativos às contrapartes	NA	Contraparte notificadora	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos às contrapartes	NA	Lado em que se situa a contraparte	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos às contrapartes	NA	Outra contraparte	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Identificador de Transação Único («UTI»)	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Tipo de OFVM	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Compensada	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Data e hora de compensação	Uma hora	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Contraparte central	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Plataforma de negociação	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Tipo de acordo-quadro	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Data e hora de execução	Uma hora	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Data-valor (data de início)	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Data de vencimento (data do final)	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Data de cessação	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Prazo mínimo de pré-aviso	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Primeira data de reembolso mediante pedido ( <i>call back</i> )	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Indicador de garantia geral	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses

Quadro	Secção	Campo	Tolerância	Data de início referida no:
Dados relativos à operação	Empréstimo	Indicador de entrega pelo valor ( <i>delivery by value — DBV</i> )	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Método utilizado para fornecer a garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Prazo de vencimento aberto	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Opção de cessação	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Taxa fixa	Até ao terceiro decimal	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Convenção sobre a contagem de dias	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Taxa variável	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Período de referência da taxa variável — unidade de tempo	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Período de referência da taxa variável — multiplicador	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Frequência de pagamento correspondente à taxa variável — unidade de tempo	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Frequência de pagamento correspondente à taxa variável — multiplicador	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Frequência de revisão da taxa variável — unidade de tempo	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Frequência de revisão da taxa variável — multiplicador	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Diferencial ( <i>spread</i> )	Até ao terceiro decimal	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Montante monetário do empréstimo com imposição de margem	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Moeda do empréstimo com imposição de margem	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365

Quadro	Secção	Campo	Tolerância	Data de início referida no:
Dados relativos à operação	Empréstimo	Taxa ajustada	Até ao terceiro decimal	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Data de aplicação da taxa	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Montante do capital na data-valor	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Montante do capital na data de vencimento	0,0005 %	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Moeda do montante do capital	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Tipo de ativo	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Identificador do valor mobiliário	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Classificação do valor mobiliário	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Mercadoria	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Subproduto	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Subproduto ulterior	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Quantidade ou montante nominal	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Unidade de medida	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Moeda ou montante nominal	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Preço do valor mobiliário ou mercadoria	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Moeda do preço	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Qualidade do valor mobiliário	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Prazo de vencimento do valor mobiliário	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365

Quadro	Secção	Campo	Tolerância	Data de início referida no:
Dados relativos à operação	Empréstimo	Jurisdição do emitente	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	LEI do emitente	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Tipo de valor mobiliário	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Valor do empréstimo	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Valor de mercado	0,0005 %	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Taxa de desconto fixa	Até ao terceiro decimal	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Taxa de desconto variável	Até ao terceiro decimal	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Período de referência da taxa de desconto variável — unidade de tempo	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Período de referência da taxa de desconto variável — multiplicador	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Frequência de pagamento correspondente à taxa de desconto variável — unidade de tempo	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Frequência de pagamento correspondente à taxa de desconto variável — multiplicador	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Frequência de revisão da taxa de desconto variável — unidade de tempo	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Frequência de revisão da taxa de desconto variável — multiplicador	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Diferencial ( <i>spread</i> ) da taxa de desconto	Até ao terceiro decimal	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Comissão de empréstimo	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365

Quadro	Secção	Campo	Tolerância	Data de início referida no:
Dados relativos à operação	Empréstimo	Acordos de exclusividade	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Empréstimo	Empréstimo com imposição de margem em curso	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Moeda de base do empréstimo com imposição de margem em curso	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Valor de mercado das posições curtas	0,0005 %	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Código sinalético («SL») para empréstimo de valores mobiliários sem garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Cobertura de exposição líquida	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Data-valor da garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Tipo de componente da garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Montante das garantias em numerário	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Moeda das garantias em numerário	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Identificação de um valor mobiliário utilizado como garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Classificação de um valor mobiliário utilizado como garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Mercadoria	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Garantias	Subproduto	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Garantias	Subproduto ulterior	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea iv), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Garantias	Quantidade ou montante nominal da garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Unidade de medida da garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses

Quadro	Secção	Campo	Tolerância	Data de início referida no:
Dados relativos à operação	Garantias	Moeda do montante nominal da garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Moeda do preço	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Garantias	Preço por unidade	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Garantias	Valor de mercado da garantia	0,0005 %	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365 + 24 meses
Dados relativos à operação	Garantias	Fator de desconto ou margem	Até ao terceiro decimal	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Qualidade da garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Data de vencimento do valor mobiliário	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Jurisdição do emitente	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	LEI do emitente	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Tipo de garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Possibilidade de reutilização da garantia	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Garantias	Identificador do cabaz de garantias	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365
Dados relativos à operação	Empréstimo	Nível	Não	Artigo 33.º, n.º 2, alínea a), subalínea i), do Regulamento (UE) 2015/2365

Quadro 2

**Motivos para a rejeição de uma notificação de OFVM**

Categorias de rejeição	Motivo
Esquema	— a OFVM foi rejeitada em virtude da não conformidade do esquema
Autorização	— a OFVM foi rejeitada pelo facto de a entidade que apresenta a notificação não estar autorizada a notificar em nome da contraparte notificadora
Lógica	— a OFVM foi rejeitada pelo facto de o tipo de ação respeitante à OFVM não ser logicamente correto
Atividade	— a OFVM foi rejeitada em virtude da não conformidade com uma ou diversas validações de conteúdo.

## Quadro 3

**Resultados do processo de conciliação**

Categorias de conciliação	Valores de conciliação
Tipo de notificação	Unilateral/Bilateral
Requisitos de notificação de ambas as contrapartes	Sim/Não
Estado em termos de emparelhamento	Emparelhado/Não emparelhado
Estado em termos de conciliação dos empréstimos	Conciliado/Não conciliado
Estado em termos de conciliação das garantias	Conciliado/Não conciliado
Outras alterações	Sim/Não

## Dados públicos

Quadro A. Agregação

Data	Repositório de transações	Tipo de agregação	Tipo de plataforma de negociação	Localização da contraparte notificadora	Localização da outra contraparte	Conciliação	Tipo de OFVM	Compen-sada	Método de transferência de garantia	Índices utilizados como referência <sup>(1)</sup>	Montante total emprestado	Número agregado de operações	Valor agregado das garantias
20161007	Repositório de transações da UE	Notificado	XXXX	EEE	EEE	Bilateral, empréstimo conciliado, garantias não conciliadas	Acordo de recompra ( <i>repo</i> )	Sim	TTCA (acordo de garantia financeira com transferência de titularidade)		...		...
...	...	Em curso	XOFF	Não - EEE	Não - EEE	Bilateral, empréstimo conciliado, garantias conciliadas	BSB/SBB	Não	SICA		...		...
...	...	...	MIC do EEE	...	...	Unilateral EEE, empréstimo conciliado, garantias conciliadas	Operação de concessão ou de contração de empréstimo de valores mobiliários ou de mercadorias	...	SIUR		...		...
...	...	...	MIC não EEE	...	...	...	Empréstimo com imposição de margem	...			...		...
...	...	...	...	...	...	...	...	...	...		...		...

<sup>(1)</sup> A preencher com os índices relevantes inseridos no campo 25 do quadro 2 «Dados relativos aos empréstimos e às garantias» do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2019/363.