

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

(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 78.º, n.º 10,

Considerando o seguinte:

- (1) A fim de garantir a elevada qualidade dos dados relativos aos derivados que são comunicados aos repositórios de transações, estes últimos devem verificar a identidade das entidades que apresentam a comunicação de informações, a integridade lógica da sequência segundo a qual os dados relativos aos derivados são comunicados e a completude e exatidão destes dados.
- (2) Pela mesma razão, os repositórios de transações devem conciliar os dados de cada comunicação de informações sobre derivados recebida quando ambas as contrapartes tiverem uma obrigação de comunicação de informações. Deve ser especificado um processo normalizado que permita aos repositórios de transações realizarem a conciliação de modo coerente e reduzirem os riscos de não conciliação dos dados dos derivados. No entanto, devido às especificidades dos sistemas tecnológicos utilizados pelas entidades que comunicam, certos dados dos derivados poderão não ser idênticos. Assim surge a necessidade de aplicar determinadas tolerâncias, de modo que a existência de pequenas diferenças nos dados de derivados comunicados não impeça as autoridades de analisarem os dados com um nível de confiança adequado.
- (3) Além disso, e sem prejuízo de outras obrigações relativas aos dados dos derivados recolhidos e registados durante o processo de conciliação, os repositórios de transações devem assegurar a confidencialidade dos dados trocados entre si e disponibilizados às contrapartes comunicam informações, às entidades responsáveis pela comunicação de informações e às entidades apresentam a comunicação de informações.
- (4) Se um evento de reestruturação empresarial resultar na alteração do identificador de entidade jurídica («LEI») de uma contraparte, os dados das entidades identificadas numa comunicação sobre derivados devem ser atualizados. A fim de garantir a integridade dessas informações, que é essencial para a monitorização dos riscos sistémicos para a estabilidade financeira, é necessário que a atualização seja efetuada de forma centralizada pelos repositórios de transações. Por esse motivo, deve ser estabelecido um procedimento para assegurar que os repositórios de transações podem atualizar o identificador da entidade de forma centralizada, garantindo assim um processo eficiente, robusto e atempado.
- (5) Porém, deve ser concedido tempo suficiente às entidades que apresentam a comunicação de informações para se adaptarem aos requisitos de comunicação, nomeadamente para evitar a acumulação de operações não conciliadas assim que a obrigação de comunicação de informações se torne aplicável. Assim, convém que, numa primeira fase, apenas um número reduzido de campos deva ser objeto de conciliação.

⁽¹⁾ JO L 201 de 27.7.2012, p. 1.

- (6) As entidades que apresentam a comunicação de informações e as entidades responsáveis pela comunicação de informações, quando aplicável, devem poder controlar o cumprimento das suas obrigações de comunicação de informações nos termos do Regulamento (UE) n.º 648/2012. Assim, para este efeito, devem poder aceder diariamente a determinadas informações relativas a essas comunicações, nomeadamente ao resultado da verificação das mesmas, igualmente no caso de ter sido emitida uma advertência, e aos progressos da conciliação dos dados comunicados. Por conseguinte, é necessário especificar as informações que um repositório de transações deve disponibilizar a estas entidades no final de cada dia útil.
- (7) O presente regulamento tem por base os projetos de normas técnicas de regulamentação apresentados à Comissão pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados.
- (8) A Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados consultou os membros do Sistema Europeu de Bancos Centrais e realizou 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, instituído nos termos do artigo 37.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho ^(?).
- (9) 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

Verificação dos derivados pelos repositórios de transações

1. Os repositórios de transações devem verificar todos os seguintes elementos nas comunicações de informações sobre derivados que recebam:
 - (a) A identidade da entidade que apresenta a comunicação de informações, tal como referido no campo 2 do quadro 1 e no campo 2 do quadro 3 do anexo do Regulamento de Execução (UE) 2022/1860 da Comissão ^(?);
 - (b) Que o modelo XML utilizado para comunicar um derivado respeita a metodologia da norma ISO 20022, em conformidade com o artigo 1.º do Regulamento de Execução (UE) 2022/1860;
 - (c) Que a entidade que apresenta a comunicação de informações, se diferente da entidade responsável pela comunicação de informações a que se refere o campo 3 do quadro 1 e o campo 3 do quadro 3 do anexo do Regulamento de Execução (UE) 2022/1860, está devidamente autorizada a comunicar em nome da contraparte 1 ou da entidade responsável pela comunicação de informações, se for diferente da contraparte 1, tal como referido no campo 4 do quadro 1 e no campo 4 do quadro 3 do anexo do Regulamento de Execução (UE) 2022/1860;
 - (d) Se o mesmo derivado não foi comunicado anteriormente;
 - (e) Se uma comunicação de derivados com o tipo de ação «Alteração», «Atualização da margem», «Avaliação», «Correção», «Erro» ou «Cessação» diz respeito a um derivado previamente comunicado;
 - (f) Se uma comunicação de derivados com o tipo de ação «Alteração» não diz respeito a um derivado que tenha sido comunicado como anulado com o tipo de ação «Erro» que não tenha sido subsequentemente comunicado com o tipo de ação «Reabertura»;
 - (g) Se a comunicação de derivados não inclui o tipo de ação «Novo» relativamente a um derivado já comunicado anteriormente;

^(?) 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).

^(?) 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 (ver página 68 do presente Jornal Oficial).

- (h) Se a comunicação de derivados não inclui o tipo de ação «Componente de posição» relativamente a um derivado já comunicado anteriormente;
 - (i) Se uma comunicação de derivados não pretende alterar os dados dos campos «Contraparte 1» ou «Contraparte 2» de um derivado anteriormente comunicado;
 - (j) Se a comunicação de derivados não pretende alterar um derivado existente especificando uma data-valor posterior à data de vencimento comunicada do derivado;
 - (k) Se um derivado comunicado com o tipo de ação «Reabertura» diz respeito a uma comunicação de derivados previamente apresentada com o tipo de ação «Erro» ou «Cessação» ou a um derivado que venceu;
 - (l) Se a comunicação de derivados está correta e completa.
2. Os repositórios de transações devem rejeitar uma comunicação de derivados que não cumpra um dos requisitos estabelecidos no n.º 1 e afetá-la a uma das categorias de rejeição indicadas no quadro 1 do anexo.
3. Os repositórios de transações devem fornecer às entidades que apresentam a comunicação informações pormenorizadas sobre os resultados da verificação dos dados a que se refere o n.º 1 no prazo de sessenta minutos após a receção de uma comunicação de derivados. Os repositórios de transações devem transmitir esses resultados num formato XML e num modelo conforme com a metodologia da norma ISO 20022. Os resultados devem especificar os motivos da rejeição de uma comunicação de derivados em conformidade com o quadro 1 do anexo.

Artigo 2.º

Procedimento de atualização dos identificadores de entidade jurídica

1. Um repositório de transações ao qual seja dirigido um pedido nos termos do artigo 8.º do Regulamento de Execução (UE) 2022/1860 deve identificar os derivados pendentes a que se refere o artigo 2.º, n.º 2, do Regulamento de Execução (UE) 2022/1860 no momento do evento de reestruturação empresarial, em que a entidade é comunicada com o identificador utilizado antes do evento de reestruturação empresarial no campo «Contraparte 1» ou «Contraparte 2», tal como consta do pedido em causa. Deve substituir o antigo identificador pelo novo identificador de entidade jurídica («LEI») nas comunicações relativas a todos esses derivados no momento do evento a que se refere o artigo 8.º do Regulamento de Execução (UE) 2022/1860 relativo a essa contraparte. Os repositórios de transações devem realizar o procedimento de atualização do identificador o mais tardar no dia da reestruturação ou no prazo de 30 dias de calendário a contar da receção do pedido, se comunicado menos de 30 dias de calendário antes da data do evento de reestruturação empresarial.
2. Os repositórios de transações devem identificar os derivados em causa a que se refere o artigo 2.º, n.º 2, do Regulamento de Execução (UE) 2022/1860 no momento do evento de reestruturação empresarial, caso a entidade seja identificada pelo identificador antigo em qualquer dos campos, e substituir esse identificador pelo novo LEI. Caso um evento de reestruturação empresarial diga respeito a uma atualização do LEI para outros campos que não «Contraparte 1» ou «Contraparte 2», o repositório de transações só deve efetuar essa atualização dos derivados em causa após uma confirmação atempada pela contraparte 1 ou pela entidade responsável pela comunicação de informações.
3. Os repositórios de transações devem realizar as seguintes ações:
- (a) Após a receção da confirmação pertinente nos termos do n.º 2, aplicar a atualização do LEI a partir da data referida no n.º 1;
 - (b) Transmitir as seguintes informações o mais rapidamente possível, o mais tardar 5 dias úteis após a receção da comunicação completa, a todos os outros repositórios de transações e às contrapartes que comunicam informações, às entidades que apresentam a comunicação de informações, às entidades responsáveis pela comunicação de informações envolvidas nos contratos de derivados abrangidos pela atualização do LEI e a terceiros a quem tenha sido concedido acesso às informações nos termos do artigo 78.º, n.º 7, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, conforme aplicável:
 - i) o(s) identificador(es) anterior(es),
 - ii) o novo identificador,
 - iii) a data a partir da qual a atualização deve ser efetuada,
 - iv) no caso de eventos empresariais que afetem um subconjunto dos derivados pendentes à data do evento, a lista dos identificadores de transação únicos (UTI) dos derivados abrangidos pela atualização do LEI;

- (c) Notificar, o mais tardar no dia útil anterior à data em que a atualização é aplicada, as entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 que têm acesso aos dados relativos aos derivados que foram atualizados, através de um ficheiro específico em formato legível por máquina:
- i) o(s) identificador(es) anterior(es),
 - ii) o novo identificador,
 - iii) a data a partir da qual a atualização deve ser efetuada,
 - iv) no caso de eventos empresariais que afetem um subconjunto dos derivados pendentes à data do evento, a lista dos UTI dos derivados abrangidos pela atualização do LEI;
- (d) Registrar a atualização do LEI no registo de comunicação de informações.
4. Os repositórios de transações não devem atualizar os LEI comunicados para derivados diferentes dos referidos no artigo 2.º, n.º 2, do Regulamento de Execução (UE) 2022/1860 no momento do evento empresarial.

Artigo 3.º

Conciliação de dados pelos repositórios de transações

1. Os repositórios de transações devem procurar conciliar os derivados comunicados seguindo as etapas enumeradas no n.º 3, 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 do derivado comunicado têm uma obrigação de comunicação de informações nos termos do artigo 9.º do Regulamento (UE) n.º 648/2012;
 - (c) O repositório de transações não recebeu uma comunicação com o tipo de ação «Erro» em relação ao derivado comunicado, a menos que essa comunicação tenha sido seguida de uma outra com o tipo de ação «Reabertura».
2. Os repositórios de transações devem dispor de mecanismos que garantam a confidencialidade dos dados aquando do intercâmbio de informações com outros repositórios de transações e da prestação de informações a contrapartes que comunicam informações, entidades que apresentam comunicações de informações, entidades responsáveis pela comunicação de informações, bem como terceiros a quem tenha sido concedido acesso a informações nos termos do artigo 78.º, n.º 7, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 sobre os valores de todos os campos sujeitos a conciliação.
3. Caso estejam preenchidas todas as condições previstas no n.º 1, os repositórios de transações devem seguir as etapas seguintes, utilizando o último valor comunicado em cada um dos campos do quadro 2 do anexo a partir do dia útil precedente:
- (a) Um repositório de transações que tenha recebido uma comunicação de derivados deve verificar se recebeu uma comunicação correspondente da outra contraparte ou em nome desta;
 - (b) Um repositório de transações que não tenha recebido a comunicação de derivados correspondente referida na alínea a) deve procurar identificar o repositório de transações que recebeu a comunicação de derivados correspondente, comunicando a todos os repositórios de transações registados os valores dos seguintes campos do derivado comunicado: «Identificador de transação único», «Contraparte 1» e «Contraparte 2»;
 - (c) Um repositório de transações que constate que outro repositório de transações recebeu a comunicação de derivados correspondente referida na alínea a) deve transmitir a esse repositório de transações os elementos do derivado comunicado num formato XML e num modelo desenvolvido em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022;

- (d) Os repositórios de transações devem tratar um derivado comunicado como conciliado se os dados desse derivado objeto de conciliação corresponderem aos dados do derivado correspondente a que se refere a alínea a) e em conformidade com os limites de tolerância aplicáveis e as datas de aplicação em causa, como estabelecido no quadro 2 do anexo;
- (e) Seguidamente, os repositórios de transações devem atribuir valores às categorias de conciliação para cada transação de derivados comunicada, como indicado no quadro 3 do anexo;
- (f) Os repositórios de transações devem concluir as etapas enunciadas nas alíneas a) a e) tão rapidamente quanto possível, não podendo efetuá-las depois da meia-noite (tempo universal coordenado) de um dado dia útil;
- (g) Os repositórios de transações que não possam conciliar um derivado comunicado devem procurar encontrar a correspondência dos dados desse derivado comunicado no dia útil seguinte. O repositório de transações deve deixar de procurar conciliar o derivado comunicado trinta dias de calendário a contar da data em que o derivado deixar de estar pendente.

4. No final de cada dia útil, os repositórios de transações devem confirmar o número total de derivados emparelhados e o número de derivados conciliados junto de cada repositório de transações com o qual tenha conciliado derivados. Os repositórios de transações devem dispor de procedimentos escritos para assegurar a resolução de todas as discrepâncias identificadas neste processo.

5. O mais tardar sessenta minutos após a conclusão do processo de conciliação previsto no n.º 3, alínea f), os repositórios de transações devem transmitir às entidades que apresentam a comunicação de informações os resultados do processo de conciliação a que submeteram os derivados comunicados. 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 4.º

Mecanismos de resposta de final de dia

1. No que diz respeito a cada dia útil, os repositórios de transações devem disponibilizar às contrapartes que comunicam informações, às entidades que apresentam a comunicação de informações, às entidades responsáveis pela comunicação de informações, bem como aos terceiros a quem tenha sido concedido acesso às informações nos termos do artigo 78.º, n.º 7, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, conforme aplicável, as seguintes informações sobre os derivados em causa, num formato XML e num modelo desenvolvido em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022:

- (a) Os derivados comunicados durante esse dia;
- (b) A situação mais recente em que se encontram as transações de derivados pendentes;
- (c) As comunicações de derivados rejeitadas durante esse dia;
- (d) O estatuto da conciliação de todos os derivados comunicados sujeitos a conciliação nos termos do artigo 3.º, n.º 1;
- (e) Os derivados pendentes relativamente aos quais não tenha sido comunicada qualquer avaliação, ou cuja avaliação comunicada tenha uma data anterior em mais de catorze dias de calendário ao dia em que a comunicação foi gerada;
- (f) Os derivados pendentes relativamente aos quais não foram comunicadas informações sobre margens, ou relativamente aos quais as informações sobre margens comunicadas tenham uma data anterior em mais de catorze dias de calendário ao dia em que a comunicação foi gerada;
- (g) Os derivados que foram recebidos nesse dia com o tipo de ação «Novo», «Componente de posição», «Alteração» ou «Correção» e cujo montante nocional é anormal para essa classe de derivados.

2. Os repositórios de transações devem fornecer essas informações o mais tardar às 6h00 (tempo universal coordenado) do dia útil seguinte ao dia a que se referem as informações previstas no n.º 1.

*Artigo 5.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 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

Motivos de rejeição de uma comunicação de derivados

Categorias de rejeição	Motivo
Esquema	— o derivado foi rejeitado em virtude da não conformidade do esquema.
Autorização	— o derivado foi rejeitado pelo facto de a entidade que apresenta a comunicação de informações não estar autorizada a comunicar em nome da contraparte que comunica as informações ou da entidade responsável pela comunicação de informações.
Lógica	— o derivado foi rejeitado pelo facto de o tipo de ação respeitante ao derivado não ser logicamente correto.
Atividade	— o derivado foi rejeitado em virtude da sua não conformidade com uma ou diversas validações de conteúdo.

Quadro 2

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
1	Partes no derivado	Data e hora da comunicação	n.a.	n.a.
2	Partes no derivado	Identificação da entidade que apresenta a comunicação de informações	n.a.	n.a.
3	Partes no derivado	Entidade responsável pela comunicação de informações	n.a.	n.a.
4	Partes no derivado	Contraparte 1 (contraparte que comunica as informações)	Igual ao campo 9 do presente quadro.	Data de início da obrigação de comunicação de informações
5	Partes no derivado	Natureza da contraparte 1	n.a.	n.a.
6	Partes no derivado	Setor empresarial da contraparte 1	n.a.	n.a.
7	Partes no derivado	Limiar de compensação da contraparte 1	n.a.	n.a.
8	Partes no derivado	Tipo de identificador da contraparte 2	n.a.	n.a.
9	Partes no derivado	Contraparte 2	Igual ao campo 4 do presente quadro.	Data de início da obrigação de comunicação de informações
10	Partes no derivado	Natureza da contraparte 2	n.a.	n.a.
11	Partes no derivado	Natureza da contraparte 2	n.a.	n.a.

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
12	Partes no derivado	Setor empresarial da contraparte 2	n.a.	n.a.
13	Partes no derivado	Limiar de compensação da contraparte 2	n.a.	n.a.
14	Partes no derivado	Obrigação de comunicação de informações da contraparte 2	n.a.	n.a.
15	Partes no derivado	Identificação do corretor	n.a.	n.a.
16	Partes no derivado	Membro compensador	n.a.	n.a.
17	Partes no derivado	Direção	Oposto	Data de início da obrigação de comunicação de informações
18	Partes no derivado	Direção da componente 1	Oposto	Data de início da obrigação de comunicação de informações
19	Partes no derivado	Direção da componente 2	Oposto	Data de início da obrigação de comunicação de informações
20	Partes no derivado	Ligação direta à atividade comercial ou à gestão de tesouraria	n.a.	n.a.
1	Secção 2A - Identificadores e ligações	UTI	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
2	Secção 2A - Identificadores e ligações	Número de referência da comunicação de informações	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
3	Secção 2A - Identificadores e ligações	UTI anterior (para as relações «uma para uma» e «uma para muitas» entre transações)	Não	Dois anos após a data de início da obrigação de comunicação de informações
4	Secção 2A - Identificadores e ligações	UTI da posição subsequente	Não	Dois anos após a data de início da obrigação de comunicação de informações
5	Secção 2A - Identificadores e ligações	Identificação da redução dos riscos pós-transação (PTRR)	n.a.	n.a.
6	Secção 2A - Identificadores e ligações	Identificador do pacote	n.a.	n.a.
7	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Número de identificação internacional de títulos (ISIN)	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
8	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Identificador único do produto (UPI)	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
9	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Classificação dos produtos	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
10	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Tipo de contrato	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
11	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Categoria de ativos	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
12	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Derivados baseados em criptoativos	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
13	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Tipo de identificação do subjacente	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
14	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Identificação do subjacente	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
15	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Indicador sobre o índice subjacente	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
16	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Nome do índice subjacente	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
17	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Código do cabaz personalizado	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
18	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Identificador dos componentes do cabaz	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
19	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Moeda de liquidação 1	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
20	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Moeda de liquidação 2	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
21	Secção 2C - Avaliação	Montante da avaliação	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
22	Secção 2C - Avaliação	Moeda da avaliação	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
23	Secção 2C - Avaliação	Data e hora da avaliação	n.a.	n.a.

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
24	Secção 2C - Avaliação	Método de avaliação	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
25	Secção 2C - Avaliação	Delta	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
26	Secção 2D - Garantias	Indicador sobre a carteira de garantias	n.a.	n.a.
27	Secção 2D - Garantias	Código da carteira de garantias	n.a.	n.a.
28	Secção 2E -Atenuação de riscos/ Comunicação de informações	Data e hora da confirmação	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
29	Secção 2E -Atenuação de riscos/ Comunicação de informações	Confirmado	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
30	Secção 2F - Compensação	Obrigação de compensação	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
31	Secção 2F - Compensação	Compensado	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
32	Secção 2F - Compensação	Data e hora da compensação	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
33	Secção 2F - Compensação	Contraparte central	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
34	Secção 2G - Pormenores da transação	Tipo de acordo-quadro	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
35	Secção 2G - Pormenores da transação	Outro tipo de acordo-quadro	n.a.	n.a.
36	Secção 2G - Pormenores da transação	Versão do acordo-quadro	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
37	Secção 2G - Pormenores da transação	Intragrupo	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
38	Secção 2G - Pormenores da transação	PTRR (<i>post-trade risk reduction</i> - redução dos riscos pós-transação)	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
39	Secção 2G - Pormenores da transação	Tipo de técnica de PTRR	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
40	Secção 2G - Pormenores da transação	Prestador de serviços de PTRR	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
41	Secção 2G - Pormenores da transação	Espaço ou organização de execução	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
42	Secção 2C - Pormenores da transação	Data e hora de execução	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
43	Secção 2C - Pormenores da transação	Data-valor	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
44	Secção 2C - Pormenores da transação	Data de termo	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
45	Secção 2C - Pormenores da transação	Data de cessação antecipada	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
46	Secção 2C - Pormenores da transação	Data final de liquidação contratual	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
47	Secção 2C - Pormenores da transação	Tipo de entrega	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
48	Secção 2G - Pormenores da transação	Preço	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
49	Secção 2G - Pormenores da transação	Moeda do preço	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
50	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor não ajustada do preço	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
51	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final não ajustada do preço	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
52	Secção 2G - Pormenores da transação	Preço em vigor entre a data-valor não ajustada e a data final	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
53	Secção 2G - Pormenores da transação	Preço de transação do pacote	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
54	Secção 2G - Pormenores da transação	Moeda do preço de transação do pacote	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
55	Secção 2G - Pormenores da transação	Montante nocional da componente 1	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
56	Secção 2G - Pormenores da transação	Moeda nocional 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
57	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor do montante nocional da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
58	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final do montante nocional da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
59	Secção 2G - Pormenores da transação	Montante nocional em vigor na data-valor associada à componente 1	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
60	Secção 2G - Pormenores da transação	Quantidade nocional total da componente 1	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
61	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor da quantidade nocional da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
62	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final da quantidade nocional da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
63	Secção 2G - Pormenores da transação	Quantidade nocional em vigor na data-valor associada à componente 1	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
64	Secção 2G - Pormenores da transação	Montante nocional da componente 2	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
65	Secção 2G - Pormenores da transação	Moeda nocional 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
66	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor do montante nocional da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
67	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final do montante nocional da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
68	Secção 2G - Pormenores da transação	Montante nocional em vigor na data-valor associada à componente 2	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
69	Secção 2G - Pormenores da transação	Quantidade nocional total da componente 2	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
70	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor da quantidade nocional da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
71	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final da quantidade nocional da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
72	Secção 2G - Pormenores da transação	Quantidade nocional em vigor na data-valor associada à componente 2	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
73	Secção 2G - Pormenores da transação	Outro tipo de pagamento	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
74	Secção 2G - Pormenores da transação	Outro montante de pagamento	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
75	Secção 2G - Pormenores da transação	Outra moeda de pagamento	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
76	Secção 2G - Pormenores da transação	Outra data de pagamento	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
77	Secção 2G - Pormenores da transação	Outro ordenante do pagamento	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
78	Secção 2G - Pormenores da transação	Outro beneficiário do pagamento	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
79	Secção 2H - Taxas de juro	Taxa fixa da componente 1 ou cupão	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
80	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias correspondentes à taxa fixa ou ao cupão da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
81	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade de pagamento à taxa fixa ou ao cupão da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
82	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa fixa ou do cupão da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
83	Secção 2H - Taxas de juro	Identificador da taxa variável da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
84	Secção 2H - Taxas de juro	Indicador sobre a taxa variável da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
85	Secção 2H - Taxas de juro	Designação da taxa variável da componente 1	n.a.	n.a.
86	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias da taxa variável da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
87	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
88	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
89	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 1 – período	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
90	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 1 – multiplicador	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
91	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
92	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 1	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
93	Secção 2H - Taxas de juro	<i>Spread</i> da componente 1	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
94	Secção 2H - Taxas de juro	Moeda do <i>spread</i> da componente 1	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
95	Secção 2H - Taxas de juro	Taxa fixa da componente 2	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
96	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias da taxa fixa da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
97	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade de pagamento à taxa fixa da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
98	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa fixa da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
99	Secção 2H - Taxas de juro	Identificador da taxa variável da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
100	Secção 2H - Taxas de juro	Indicador sobre a taxa variável da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
101	Secção 2H - Taxas de juro	Designação da taxa variável da componente 2	n.a.	n.a.
102	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias da taxa variável da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
103	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
104	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
105	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 2 – período	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
106	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 2 – multiplicador	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
107	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
108	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 2	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
109	Secção 2H - Taxas de juro	<i>Spread</i> da componente 2	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
110	Secção 2H - Taxas de juro	Moeda do <i>spread</i> da componente 2	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
111	Secção 2H - Taxas de juro	<i>Spread</i> da transação do pacote	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
112	Secção 2H - Taxas de juro	Moeda do <i>spread</i> da transação do pacote	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
113	Secção 2I - Divisas	Taxa de câmbio 1	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
114	Secção 2I - Divisas	Taxa de câmbio <i>forward</i>	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
115	Secção 2I - Divisas	Base da taxa de câmbio	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
116	Secção 2J - Mercadorias e licenças de emissão (geral)	Produto de base	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
117	Secção 2J - Mercadorias e licenças de emissão (geral)	Subproduto	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
118	Secção 2J - Mercadorias e licenças de emissão (geral)	Subproduto adicional	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
119	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Zona ou ponto de entrega	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
120	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Ponto de interconexão	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
121	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Tipo de carga	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
122	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Hora de início do intervalo de entrega	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
123	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Hora final do intervalo de entrega	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
124	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Data de início da entrega	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
125	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Data final da entrega	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
126	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Duração	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
127	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Dias da semana	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
128	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Capacidade de entrega	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
129	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Unidade de quantidade	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
130	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Preço por quantidade por intervalo de tempo	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
131	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Moeda do preço por quantidade por intervalo de tempo	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
132	Secção 2L - Opções	Tipo de opção	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
133	Secção 2L - Opções	Estilo da opção	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
134	Secção 2L - Opções	Preço de exercício	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
135	Secção 2L - Opções	Data-valor do preço de exercício	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
136	Secção 2L - Opções	Data final do preço de exercício	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
137	Secção 2L - Opções	Preço de exercício em vigor na data-valor associada	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
138	Secção 2L - Opções	Moeda/par de moedas do preço de exercício	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
139	Secção 2L - Opções	Montante do prémio da opção	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
140	Secção 2L - Opções	Moeda do prémio da opção	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
141	Secção 2L - Opções	Data de pagamento do prémio da opção	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações

	Secção	Campo	Tolerância de conciliação	Data de início da conciliação
142	Secção 2I - Opções	Data de vencimento do subjacente	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
143	Secção 2M – Derivados de crédito	Grau de prioridade	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
144	Secção 2M – Derivados de crédito	Entidade de referência	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
145	Secção 2M – Derivados de crédito	Série	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
146	Secção 2M – Derivados de crédito	Versão	Não	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
147	Secção 2M – Derivados de crédito	Fator do índice	Sim	Data de início da obrigação de comunicação de informações
148	Secção 2M – Derivados de crédito	Parcela	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações
149	Secção 2M – Derivados de crédito	Ponto de ligação do índice de swap de risco de incumprimento (CDS)	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
150	Secção 2M – Derivados de crédito	Ponto de desconexão do índice de CDS	Sim	Dois anos a contar da data de início da obrigação de comunicação de informações
151	Secção 2N - Alterações do derivado	Tipo de ação	n.a.	n.a.
152	Secção 2N - Alterações do derivado	Tipo de evento	n.a.	n.a.
153	Secção 2N - Alterações do derivado	Data do evento	n.a.	n.a.
154	Secção 2N - Alterações do derivado	Nível	Não	Data de início da obrigação de comunicação de informações

Quadro 3

Categorias de conciliação	Valores admissíveis
Requisitos de comunicação para ambas as contrapartes	Sim/Não
Tipo de comunicação	Unilateral/bilateral
Emparelhamento	Emparelhado/não emparelhado
Conciliação	Conciliado/não conciliado
Conciliação da avaliação	Conciliado/não conciliado
Reabertura	Sim/Não
Outras alterações	Sim/Não