

REGULAMENTO DELEGADO (UE) 2017/585 DA COMISSÃO**de 14 de julho de 2016**

que complementa o Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho no que se refere às normas técnicas de regulamentação aplicáveis em termos de normas e formatos dos dados de referência sobre os instrumentos financeiros e às medidas técnicas em relação com as medidas a adotar pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados e pelas autoridades competentes

(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 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 ⁽¹⁾, nomeadamente o artigo 27.º, n.º 3, terceiro parágrafo,

Considerando o seguinte:

- (1) Para assegurar uma efetiva monitorização do mercado pelas autoridades competentes, os dados de referência respeitantes aos instrumentos financeiros devem ser apresentados num formato coerente e de acordo com normas uniformes.
- (2) A comunicação e publicação de dados de referência em modelo e formato eletrónico, legível por máquina e passível de descarregamento facilita uma utilização e um intercâmbio eficientes desses dados.
- (3) A rápida receção dos dados de referência em relação a todos os instrumentos financeiros que estejam admitidos à negociação ou sejam negociados numa plataforma de negociação ou através de um internalizador sistemático permitirá às autoridades competentes e à Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados (ESMA) assegurar a qualidade dos dados e uma efetiva monitorização do mercado, contribuindo assim para a sua integridade.
- (4) A fim de assegurar que as plataformas de negociação e os internalizadores sistemáticos apresentem dados de referência completos e exatos e que as autoridades competentes possam efetivamente receber e utilizar esses dados de forma atempada, devem ser estabelecidos prazos apropriados para a respetiva apresentação. Deve ser previsto um período adequado para identificar eventuais imprecisões ou lacunas antes da publicação. A fim de assegurar que os dados de referência apresentados são coerentes com as informações correspondentes comunicadas em conformidade com o artigo 26.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014, os dados de referência respeitantes a um determinado dia deverão ser utilizados pelas autoridades competentes para validar e proceder ao intercâmbio de comunicações das transações executadas nesse mesmo dia.
- (5) Em conformidade com o artigo 27.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 600/2014, os remetentes e os destinatários dos dados de referência têm de assegurar a efetiva receção, o intercâmbio eficiente e a qualidade dos dados, bem como a respetiva coerência com as correspondentes comunicações de transações previstas no artigo 26.º do referido regulamento. As plataformas de negociação e os internalizadores sistemáticos devem, portanto, fornecer dados de referência completos e exatos e informar imediatamente as autoridades competentes quando constatarem que dados que já tenham sido transmitidos são incompletos ou inexatos. Devem também manter sistemas e controlos adequados para efeitos de um fornecimento exato, completo e atempado dos dados de referência.
- (6) Para efeitos de uma utilização e um intercâmbio eficientes dos dados de referência, bem como para assegurar que os dados de referência são coerentes com os dados correspondentes fornecidos nas comunicações de transações, as plataformas de negociação e os internalizadores sistemáticos devem basear a identificação dos instrumentos financeiros e das entidades jurídicas a incluir nos dados de referência em normas uniformes e previamente aceites. Em particular, e a fim de assegurar que os dados de referência têm a devida correspondência nas comunicações de transações, as plataformas de negociação e os internalizadores sistemáticos devem obter os códigos ISIN (Número Internacional de Identificação de Títulos) em conformidade com a norma ISO 6166 dos instrumentos financeiros que são objeto da comunicação e incluí-los nos dados comunicados.
- (7) Por motivos de coerência e para garantir o bom funcionamento dos mercados financeiros, é necessário que as disposições previstas pelo presente regulamento e as disposições previstas pelo Regulamento (UE) n.º 600/2014 sejam aplicáveis a partir da mesma data.

⁽¹⁾ JO L 173 de 12.6.2014, p. 84.

- (8) O presente regulamento tem por base os projetos de normas técnicas de regulamentação apresentados pela ESMA à Comissão.
- (9) A ESMA realizou consultas públicas abertas sobre os projetos de normas técnicas de regulamentação que servem de base ao presente regulamento, analisou os potenciais custos e benefícios conexos 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 ⁽¹⁾,

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

Artigo 1.º

Conteúdo, normas, modelos e formatos dos dados de referência

As plataformas de negociação e os internalizadores sistemáticos devem fornecer às autoridades competentes, de forma detalhada, os dados de referência sobre o instrumento financeiro («dados de referência») referidos no quadro 3 do anexo que dizem respeito ao instrumento financeiro em causa. Todos os dados devem ser apresentados de acordo com as normas e formatos especificados no quadro 3 do anexo, em formato eletrónico que permita a leitura por máquina e de acordo com um modelo XML comum, em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022.

Artigo 2.º

Calendário para a apresentação de dados de referência às autoridades competentes

1. As plataformas de negociação e os internalizadores sistemáticos devem apresentar às autoridades competentes, até às 21:00 CET de cada dia em que estejam abertos para negociação, os dados de referência relativos a todos os instrumentos financeiros que estão admitidos à negociação ou são negociados, mesmo nos casos em que as ordens ou ofertas de preços sejam colocadas através do seu sistema, antes das 18:00 horas CET do dia em causa.
2. Quando um instrumento financeiro estiver admitido à negociação ou for negociado, mesmo nos casos em que a ordem ou oferta de preços é colocada pela primeira vez, depois das 18:00 CET de um dia em que a plataforma de negociação ou o internalizador sistemático está aberto para negociação, os dados de referência referentes ao instrumento financeiro em causa devem ser apresentados até às 21:00 CET do próximo dia em que a plataforma de negociação ou o internalizador sistemático em causa estiverem abertos para negociação.

Artigo 3.º

Identificação dos instrumentos financeiros e das entidades jurídicas

1. Antes do início da negociação de um instrumento financeiro numa plataforma de negociação ou num internalizador sistemático, essa plataforma de negociação ou internalizador sistemático deve obter o código ISIN (Número Internacional de Identificação de Títulos) de acordo com a norma ISO 6166 desse instrumento financeiro.
2. As plataformas de negociação e os internalizadores sistemáticos devem assegurar que os códigos de identificação das entidades jurídicas incluídos nos dados de referência que apresentam sejam conformes com a norma ISO 17442:2012, sejam respeitantes ao emitente em causa e estejam incluídos na base de dados do Sistema Mundial de Identificação de Entidades Jurídicas gerido pela Unidade Operacional Central designada pelo Comité de Supervisão Regulamentar do Sistema Mundial de Identificação de Entidades Jurídicas.

Artigo 4.º

Medidas destinadas a assegurar a efetiva receção dos dados de referência

1. As autoridades competentes devem monitorizar e avaliar o carácter exaustivo dos dados de referência que recebem de uma plataforma de negociação ou de um internalizador sistemático, bem como a conformidade desses dados com as normas e formatos especificados no quadro 3 do anexo.

⁽¹⁾ 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).

2. Na sequência da receção dos dados de referência relativos a cada dia em que as plataformas de negociação e internalizadores sistemáticos estão abertos para negociação, as autoridades competentes notificam essas plataformas de negociação e internalizadores sistemáticos de quaisquer lacunas desses dados ou da não entrega de dados de referência dentro dos prazos estabelecidos no artigo 2.º.
3. A ESMA deve monitorizar e avaliar o carácter exaustivo dos dados de referência que recebe das autoridades competentes, bem como a conformidade desses dados com as normas e formatos especificados no quadro 3 do anexo.
4. Na sequência da receção de dados de referência provenientes das autoridades competentes, a ESMA deve notificar essas autoridades de quaisquer lacunas desses dados ou da não entrega de dados de referência dentro dos prazos fixados no artigo 7.º, n.º 1.

Artigo 5.º

Medidas destinadas a assegurar a qualidade dos dados de referência

As autoridades competentes devem realizar avaliações da qualidade no que se refere ao conteúdo e exatidão dos dados de referência recebidos nos termos do artigo 27.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 600/2014, pelo menos numa base trimestral.

Artigo 6.º

Métodos e mecanismos para a apresentação dos dados de referência

1. As plataformas de negociação e os internalizadores sistemáticos devem assegurar-se de que fornecem dados de referência completos e exatos às suas autoridades competentes nos termos dos artigos 1.º e 3.º.
2. As plataformas de negociação e os internalizadores sistemáticos devem estabelecer métodos e mecanismos que lhes permitam identificar os dados de referência anteriormente apresentados que estejam incompletos ou não sejam exatos. Uma plataforma de negociação ou um internalizador sistemático que constate que apresentou dados de referência incompletos ou inexatos deve notificar imediatamente desse facto a autoridade competente e transmitir-lhe os dados de referência relevantes numa forma completa e exata, sem demora injustificada.

Artigo 7.º

Medidas para um intercâmbio e publicação eficientes dos dados de referência

1. As autoridades competentes devem transmitir à ESMA dados de referência completos e exatos cada dia até às 23:59 CET, utilizando o canal de comunicação eletrónico seguro estabelecido para o efeito entre as autoridades competentes e a ESMA.
2. No dia seguinte ao da receção dos dados de referência em conformidade com o n.º 1, a ESMA deve consolidar os dados recebidos de cada autoridade competente.
3. A ESMA deve disponibilizar os dados consolidados a todas as autoridades competentes até às 08:00 CET do dia seguinte ao da sua receção, utilizando os canais de comunicação eletrónicos seguros referidos no n.º 1.
4. As autoridades competentes devem utilizar os dados consolidados referentes a um determinado dia para validar as comunicações das transações executadas nesse dia e comunicadas nos termos do artigo 26.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014.
5. Cada autoridade competente deve utilizar os dados consolidados para um determinado dia para o intercâmbio das comunicações de transações apresentadas nesse dia em conformidade com o artigo 26.º, n.º 1, segundo parágrafo, do Regulamento (UE) n.º 600/2014.
6. A ESMA deve publicar os dados de referência num formato eletrónico, passível de descarregamento e legível por máquina.

Artigo 8.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 da data mencionada no artigo 55.º, segundo parágrafo, do Regulamento (UE) n.º 600/2014.

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

Feito em Bruxelas, em 14 de julho de 2016.

Pela Comissão
O Presidente
Jean-Claude JUNCKER

ANEXO

Quadro 1

Legenda do quadro 3

SÍMBOLO	TIPO DE DADOS	DEFINIÇÃO
{ALPHANUM-n}	Até n caracteres alfanuméricos	Campo para texto livre.
{CFI_CODE}	6 caracteres	Código ISO 10962 CFI
{COUNTRYCODE_2}	2 caracteres alfanuméricos	Código de país de duas letras, conforme definido pela norma ISO 3166-1 alfa-2
{CURRENCYCODE_3}	3 caracteres alfanuméricos	Código de moeda de 3 letras, conforme definido pela norma ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Formato de data e hora da norma ISO 8601	<ul style="list-style-type: none"> — Data e hora, no seguinte formato: YYYY-MM-DDThh:mm:ss.dzzzzzzZ. — «YYYY» é o ano; — «MM» é o mês; — «DD» é o dia; — «T» — significa que tem de ser utilizada a letra «T» — «hh» é a hora; — «mm» são os minutos; — «ss.dzzzzzz» são os segundos e frações de segundos; — Z é a hora UTC. As datas e as horas têm de ser comunicadas em UTC.
{DATEFORMAT}	Formato de data de acordo com a norma ISO 8601	As datas devem estar formatadas do seguinte modo: YYYY-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Número decimal até um total de n dígitos, dos quais até m dígitos podem ser casas decimais	Campo numérico para valores tanto positivos como negativos. <ul style="list-style-type: none"> — O separador decimal é «.» (ponto); — os números negativos são prefixados com «-» (sinal negativo); — os valores são arredondados e não são truncados.
{INDEX}	4 caracteres alfabéticos	«EONA» — EONIA «EONS» — EONIA SWAP «EURI» — EURIBOR «EUUS» — EURODOLLAR «EUCH» — EuroSwiss «GCFR» — GCF REPO «ISDA» — ISDAFIX «LIBI» — LIBID «LIBO» — LIBOR «MAAA» — Muni AAA «PFAN» — Pfandbriefe «TIBO» — TIBOR «STBO» — STIBOR «BBSW» — BBSW «JIBA» — JIBAR «BUBO» — BUBOR

SÍMBOLO	TIPO DE DADOS	DEFINIÇÃO
		«CDOR» — CDOR «CIBO» — CIBOR «MOSP» — MOSPRIM «NIBO» — NIBOR «PRBO» — PRIBOR «TLBO» — TELBOR «WIBO» — WIBOR «TREA» — Treasury «SWAP» — SWAP «FUSW» — Future SWAP
{INTEGER-n}	Número inteiro até um total de n dígitos	Campo numérico para valores inteiros positivos e negativos.
{ISIN}	12 caracteres alfanuméricos	Código ISIN, conforme definido na norma ISO 6166
{LEI}	20 caracteres alfanuméricos	Identificador de entidade jurídica, conforme definido na norma ISO 17442.
{MIC}	4 caracteres alfanuméricos	Identificador de mercado, conforme definido na norma ISO 10383
{FISN}	35 caracteres alfanuméricos	Código FISN, conforme definido na norma ISO 18774.

Quadro 2

Classificação de derivados sobre mercadorias e licenças de emissão para o quadro 3 (campos 35 a 37)

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

Produto de base	Subproduto	Subproduto ulterior
	«SEAF» — Marisco	
	«LSTK» — Gado	
	«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 «LNGG» — Gás natural liquefeito (GNL) «NBPG» — National Balancing Point (NBP) «NCGG» — NetConnect Germany (NCG) «TTFG» — Title Transfer Facility (TTF)
	«OILP» — Petróleo	«BAKK» — Bakken «BDSL» — Biodiesel «BRNT» — Brent «BRNX» — Brent NX «CNDA» — Canadiano «COND» — Condensado «DSEL» — Diesel «DUBA» — Dubai «ESPO» — ESPO «ETHA» — Etanol «FUEL» — Fuel «FOIL» — Fuelóleo «GOIL» — Gasóleo «GSLN» — Gasolina «HEAT» — Petróleo para aquecimento «JTFL» — Combustível para motores a jato «KERO» — Querosene «LLSO» — Light Louisiana Sweet (LLS) «MARS» — Mars «NAPH» — Naptha «NGLO» — NGL «TAPI» — Tapis «URAL» — Urais «WTIO» — WTI
	«COAL» — Carvão «INRG» — Interenergias «RNGG» — Energias renováveis «LGHT» — Produtos de cauda leves «DIST» — Destilados	

Produto de base	Subproduto	Subproduto ulterior
«ENVR» — Ambiental	«EMIS» — Emissões	«CERE» — RCE «ERUE» — URE «EUAE» — Quotas de emissão UE «EUAA» — Quotas de emissão do setor de aviação UE «OTHR» — Outros
	«WTHR» — Meteorologia «CRBR» — Relacionado com o carbono	
«FRGT» — Transporte de mercadorias	«WETF» — Carga líquida	«TNKR» — Navios-cisterna
	«DRYF» — Carga sólida	«DBCR» — Navios graneleiros sólidos
	«CSHP» — Porta-contentores	
«FRTL» — Fertilizantes	«AMMO» — Amónia «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

Produto de base	Subproduto	Subproduto ulterior
«MCEX» — Diversas mercadorias exóticas		
«PAPR» — Papel	«CBRD» — Cartão de embalagem «NSPT» — Papel de jornal «PULP» — Pasta de papel «RCVP» — Papel reciclado	
«POLY» — Polipropileno	«PLST» — Plástico	
«INFL» — Inflação		
«OEST» — Estatísticas económicas oficiais		
«OTHC» — Outros C10 na aceção do Quadro 10.1, secção 10, do anexo III do Regulamento Delegado (UE) 2017/583 da Comissão ⁽¹⁾		
«OTHR» — Outros		

⁽¹⁾ Regulamento Delegado (UE) 2017/583 da Comissão, de 14 de julho de 2016, que completa o Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho 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 (ver página 229 do presente Jornal Oficial).

Quadro 3

Dados a comunicar como dados de referência dos instrumentos financeiros

N.	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
Campos gerais			
1	Código de identificação dos instrumentos	Código utilizado para identificar o instrumento financeiro.	{ISIN}
2	Nome completo do instrumento	Designação completa do instrumento financeiro.	{ALPHANUM-350}
3	Classificação do instrumento	Taxonomia utilizada para classificar o instrumento financeiro. Deverá ser fornecido um código CFI completo e exato.	{CFI_CODE}
4	Indicador de derivados de mercadorias ou licenças de emissão	Indicação sobre se o instrumento financeiro é abrangido pela definição de derivado de mercadorias ao abrigo do artigo 2.º, n.º 1, ponto 30, do Regulamento (UE) n.º 600/2014 ou é um derivado relativo a licenças de emissão referido no ponto 4, secção C, do anexo I da Diretiva 2014/65/UE.	«true» — Sim «false» — Não
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.	{LEI}

N.	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
Campos relacionados com a plataforma			
6	Plataforma de negociação	Caso disponível, código de identificação do segmento de mercado (<i>segment MIC</i>) da plataforma de negociação ou do internalizador sistemático ou, na sua ausência, código MIC de exploração (<i>operating MIC</i>).	{MIC}
7	Nome abreviado do instrumento financeiro	Designação abreviada do instrumento financeiro de acordo com a norma ISO 18774.	{FISN}
8	Pedido de admissão à negociação pelo emitente	Indicação sobre se o emitente do instrumento financeiro pediu ou aprovou a negociação ou admissão à negociação do seu instrumento financeiro numa plataforma de negociação.	«true» — Sim «false» — Não
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.	{DATE_TIME_FORMAT}
10	Data do pedido de admissão à negociação	Data e hora do pedido de admissão à negociação na plataforma de negociação.	{DATE_TIME_FORMAT}
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 uma oferta de preço foi recebida pela primeira vez pela plataforma de negociação.	{DATE_TIME_FORMAT}
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.	{DATE_TIME_FORMAT}
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 moeda 1 do par. No caso de opções sobre <i>swaps</i> em que o <i>swap</i> subjacente é denominado numa única moeda, esta será a moeda nocional do <i>swap</i> subjacente. Para opções sobre <i>swaps</i> em que o <i>swap</i> subjacente é denominado em várias moedas, trata-se da moeda nocional da componente 1 do <i>swap</i> .	{CURRENCYCODE_3}
Campos relacionados com obrigações ou outras formas de dívida titularizada			
14	Valor nominal total emitido	Valor nominal total emitido, expresso em valor monetário.	{DECIMAL-18/5}
15	Data de vencimento	Data de vencimento do instrumento financeiro. O campo aplica-se a instrumentos de dívida com prazo de vencimento definido.	{DATEFORMAT}
16	Moeda do valor nominal	Moeda do valor nominal dos instrumentos de dívida.	{CURRENCYCODE_3}
17	Valor nominal por unidade/valor mínimo negociado	Valor nominal de cada instrumento. Caso não esteja disponível, indicar o valor mínimo negociado.	{DECIMAL-18/5}

N.	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
18	Taxa fixa	Percentagem de rendimento a taxa fixa de um instrumento de dívida quando detido até à data de vencimento, expresso em percentagem.	{DECIMAL-11/10} Expresso em percentagem (por exemplo, 7.0 significa 7 % e 0.3 significa 0,3 %)
19	Identificador do índice/índice de referência de uma obrigação a taxa variável	Se existir um identificador.	{ISIN}
20	Nome do índice/índice de referência de uma obrigação a taxa variável	O nome do índice, caso não exista um identificador.	{INDEX} Ou {ALPHANUM-25} — se o nome do índice não estiver incluído na lista {INDEX}
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 deverá ser expressa em dias, semanas, meses ou anos.	{INTEGER-3}+«DAYS» — dias {INTEGER-3}+«WEEK» — semanas {INTEGER-3}+«MNTN» — meses {INTEGER-3}+«YEAR» — anos
22	Spread de 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	{INTEGER-5}
23	Prioridade da obrigação	Identificar o tipo de obrigação: dívida prioritária, <i>mezzanine</i> , dívida subordinada ou dívida com uma prioridade de grau inferior (<i>junior</i>).	«SNDB» — Dívida com uma prioridade de primeiro grau (senior) «MZZD» — <i>Mezzanine</i> «SBOD» — Dívida subordinada «JUND» — Dívida com uma prioridade de grau inferior (junior)

Campos relacionados com derivados e derivados titularizados

24	Data de vencimento	Data de vencimento do instrumento financeiro. Este campo só é aplicável aos instrumentos derivados com uma data de vencimento pré-definida.	{DATEFORMAT}
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.	{DECIMAL-18/17}
26	Código do instrumento subjacente	Código ISIN 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 as obrigações podem ser convertidas. Para os derivados ou outros instrumentos baseados num subjacente, indicar o código ISIN do instrumento subjacente, se este estiver admitido à negociação ou for negociado numa plataforma de negociação. Quando o subjacente for um dividendo sobre ações, indicar o código ISIN da ação conexa que confere direito aos dividendos subjacentes.	{ISIN}

N.	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
		<p>Para os <i>swaps</i> de risco de incumprimento, indicar o código ISIN da obrigação de referência.</p> <p>Se o subjacente for um índice e tiver um ISIN, indicar o código ISIN desse índice.</p> <p>Se o subjacente for um cabaz, indicar os códigos ISIN de cada constituinte do cabaz que esteja admitido à negociação ou seja negociado numa plataforma de negociação. Os campos 26 e 27 devem ser preenchidos tantas vezes quanto necessário para enumerar todos os instrumentos do cabaz.</p>	
27	Emitente do subjacente	Caso o instrumento se refira a um emitente e não a um determinado instrumento, indicar o código LEI do emitente.	{LEI}
28	Nome do índice subjacente	Caso o subjacente seja um índice, indicar o nome do índice.	{INDEX} Ou {ALPHANUM-25} — se o nome do índice não estiver incluído na lista {INDEX}
29	Vigência do índice subjacente	Caso o subjacente seja um índice, indicar o período de vigência do índice.	{INTEGER-3}+«DAYS» — dias {INTEGER-3}+«WEEK» — semanas {INTEGER-3}+«MNTH» — meses {INTEGER-3}+«YEAR» — anos
30	Tipo de opção	<p>Indicar se o contrato de derivados é uma opção de compra (direito a comprar um ativo subjacente específico, <i>call</i>) ou uma opção de venda (direito a vender um ativo subjacente específico, <i>put</i>) 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 sobre <i>swaps</i> (<i>swaptions</i>), trata-se de uma:</p> <ul style="list-style-type: none"> — «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>swap</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>swap</i> enquanto pagador a taxa fixa. <p>No que respeita a limites e patamares, trata-se de uma:</p> <ul style="list-style-type: none"> — «Opção de venda», se for previsto um patamar. — «Opção de venda», se for previsto um patamar. Este campo apenas se aplica aos derivados que sejam opções ou títulos de subscrições (<i>warrants</i>). 	«PUTO» — Opção de venda «CALL» — Opção de compra «OTHR» — Quando não é possível determinar se se trata de uma opção de compra ou de venda
31	Preço de exercício	<p>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.</p> <p>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.</p> <p>Quando o preço não estiver ainda disponível, o valor a indicar deve ser «PNDG» (pendente).</p> <p>Quando não é aplicável um preço de exercício, o campo não deve ser preenchido.</p>	{DECIMAL-18/13} caso o preço seja expresso em valor monetário {DECIMAL-11/10} caso o preço seja expresso em percentagem ou rendimento {DECIMAL-18/17} caso o preço seja expresso em pontos de base «PNDG» caso o preço não esteja disponível
32	Moeda do preço de exercício	A moeda do preço de exercício.	{CURRENCYCODE_3}

N.	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
33	Estilo 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>).	«EURO» — Europeu «AMER» — Americano «ASIA» — Asiático «BERM» — Bermudense «OTHR» — Qualquer outro tipo
34	Tipo de entrega	Indicar se o instrumento financeiro é liquidado mediante entrega física ou em dinheiro. Quando não for 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.	«PHYS» — Liquidado mediante entrega física «CASH» — Liquidado em dinheiro «OPTN» — Opcional para a contraparte ou se determinado por um terceiro

Derivados sobre mercadorias e licenças de emissão

35	Produto de base	Produto de base da categoria do ativo subjacente conforme especificado no quadro de classificação dos derivados de mercadorias e licenças de emissão.	Apenas são admitidos valores da coluna «Produto de base» da classificação dos derivados sobre mercadorias.
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.	Apenas são admitidos valores da coluna «Produto de base» da classificação dos derivados sobre mercadorias.
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.	Apenas são admitidos valores da coluna «Subproduto ulterior» da classificação dos derivados sobre mercadorias.
38	Tipo de operação	Tipo de operação conforme especificado pela plataforma de negociação.	«FUTR» — Futuros «OPTN» — Opções «TAPO» — TAPOS «SWAP» — SWAPS «MINI» — Minis «OTCT» — Mercado de balcão «ORIT» — Definitivas «CRCK» — <i>Crack</i> «DIFF» — Diferencial «OTHR» — Outros
39	Tipo de preço final	Tipo de preço final conforme especificado pela plataforma de negociação.	«ARGM» — Argus/McCloskey «BLTC» — Báltico «EXOF» — Exchange «GBCL» — GlobalCOAL «IHSM» — IHS McCloskey «PLAT» — Platts «OTHR» — Outros

N.	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
Derivados sobre taxas de juro			
— Os campos desta secção apenas devem ser preenchidos para instrumentos que tenham como ativo subjacente instrumentos não financeiros como taxas de juro.			
40	Taxa de referência	Nome da taxa de referência	{INDEX} Ou {ALPHANUM-25} — se a taxa de referência não estiver incluída na lista {INDEX}
41	Vigência do contrato de taxa de juro	Se a classe de ativos incidir sobre taxas de juro, este campo deve indicar a vigência do contrato. A vigência deverá ser expressa em dias, semanas, meses ou anos.	{INTEGER-3}+«DAYS» — dias {INTEGER-3}+«WEEK» — semanas {INTEGER-3}+«MNTH» — meses {INTEGER-3}+«YEAR» — anos
42	Moeda nacional 2	Em caso de <i>swaps</i> em várias moedas ou em moedas 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 moedas, a moeda em que é denominada a componente 2 do <i>swap</i> .	{CURRENCYCODE_3}
43	Taxa fixa da componente 1	Indicar a taxa fixa da componente 1 utilizada, se aplicável.	{DECIMAL -11/10} Expresso em percentagem (por exemplo, 7.0 significa 7 % e 0.3 significa 0,3 %)
44	Taxa fixa da componente 2	Indicar a taxa fixa da componente 2 utilizada, se aplicável.	{DECIMAL -11/10} Expresso em percentagem (por exemplo, 7.0 significa 7 % e 0.3 significa 0,3 %)
45	Taxa variável da componente 2	Indicar a taxa de juro utilizada, se aplicável.	{INDEX} Ou {ALPHANUM-25} — se a taxa de referência não estiver incluída na lista {INDEX}
46	Vigência do contrato de taxa de juro da componente 2	Indicar o período de referência da taxa de juro, fixada a intervalos predeterminados em função de uma taxa de referência do mercado. A vigência deverá ser expressa em dias, semanas, meses ou anos.	{INTEGER-3}+«DAYS» — dias {INTEGER-3}+«WEEK» — semanas {INTEGER-3}+«MNTH» — meses {INTEGER-3}+«YEAR» — anos

Derivados cambiais

— Os campos desta secção apenas devem ser preenchidos para instrumentos que tenham como ativo subjacente instrumentos não financeiros como instrumentos cambiais.

47	Moeda nacional 2	Este campo deve ser preenchido com a moeda subjacente 2 do par de moedas (a moeda 1 será indicada no campo 13 — moeda nacional 1).	{CURRENCYCODE_3}
48	Tipo de moeda estrangeira	Tipo de moeda subjacente	«FXCR» — Taxas cruzadas de moeda estrangeira «FXEM» — Mercados emergentes de moeda estrangeira «FXMJ» — <i>Majors</i>