

REGULAMENTO DELEGADO (UE) 2017/1800 DA COMISSÃO**de 29 de junho de 2017****que altera o Regulamento Delegado (UE) n.º 151/2013 que completa o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho****(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 81.º, n.º 5,

Considerando o seguinte:

- (1) A aplicação do Regulamento Delegado (UE) n.º 151/2013 da Comissão ⁽²⁾ demonstrou que a ausência de normas específicas no que diz respeito ao acesso aos dados e à agregação e comparação de dados conduz a deficiências estruturais. A ausência de dados normalizados, de uma funcionalidade uniforme e de um formato de mensagem normalizado tem dificultado o acesso direto e imediato aos dados e, por conseguinte, impedido as entidades a que se refere o artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 de avaliarem eficazmente o risco sistémico com vista ao exercício das respetivas responsabilidades e mandatos.
- (2) A fim de obviar a estas dificuldades, é necessário alterar o Regulamento Delegado (UE) n.º 151/2013, especificando melhor as normas operacionais necessárias para agregar e comparar dados entre repositórios de transações, a fim de assegurar que as entidades a que se refere o artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 podem ter acesso às informações de que necessitam para exercer as respetivas responsabilidades e mandatos.
- (3) A fim de permitir uma comparação e agregação dos dados entre os repositórios de transações eficaz e eficiente, deverão utilizar-se modelos de formato XML e mensagens XML geradas em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022, tanto para o acesso aos dados como para a comunicação entre as entidades a que se refere o artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 e os repositórios de transações. Tal não deverá excluir a possibilidade de os repositórios de transações e as entidades envolvidas acordarem entre si um formato diferente, para além de XML, para proporcionar o acesso aos dados ou para a comunicação.
- (4) Os modelos de formato XML devem ser utilizados para fornecer dados às entidades relevantes de um modo que facilita a sua agregação, enquanto as mensagens XML devem ser utilizadas para simplificar o processo de intercâmbio de dados entre os repositórios de transações e as entidades relevantes. O Regulamento (UE) n.º 151/2013 não exclui a utilização adicional, em separado, de modelos de formato não XML, como modelos em que os valores são separados por vírgulas (csv) ou ficheiros de texto (txt), na medida em que permitam às entidades relevantes exercer as suas responsabilidades e mandatos. Os repositórios de transações deverão, por conseguinte, ser autorizados a continuar a utilizar esses formatos para além, mas nunca em substituição, da utilização dos modelos de formato XML. No mínimo, devem ser utilizados modelos de formato XML e mensagens XML baseadas na metodologia da norma ISO 20022 para todos os relatórios e intercâmbios, a fim de assegurar a comparabilidade e a agregação dos dados entre repositórios de transações.
- (5) As entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 podem delegar funções e responsabilidades à ESMA nos termos do artigo 28.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010 ⁽³⁾, incluindo o acesso a dados comunicados aos repositórios de transações. O recurso a tal delegação não deverá afetar de modo algum a obrigação dos repositórios de transações de concederem às entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 o acesso direto e imediato a esses dados.
- (6) A fim de garantir a confidencialidade, todos os tipos de intercâmbios de dados entre repositórios de transações e as entidades relevantes devem ser efetuados através de uma conexão máquina-máquina segura e mediante a utilização de protocolos de cifragem de dados. Para garantir a aplicação de normas mínimas comuns, deverá ser

⁽¹⁾ JO L 201 de 27.7.2012, p. 1.

⁽²⁾ Regulamento Delegado (UE) n.º 151/2013 da Comissão, de 19 de dezembro de 2012, que completa o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho relativo aos derivados OTC, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações, no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação que especificam os dados que devem ser divulgados e disponibilizados pelos repositórios de transações, bem como normas operacionais com vista à agregação, à comparação e ao acesso a esses dados (JO L 52 de 23.2.2013, p. 33).

⁽³⁾ Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 24 de novembro de 2010, que cria uma Autoridade Europeia de Supervisão (Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados), altera a Decisão n.º 716/2009/CE e revoga a Decisão 2009/77/CE da Comissão (JO L 331 de 15.12.2010, p. 84).

utilizado um protocolo de transferência de ficheiros SSH (SFTP) entre os repositórios de transações e as entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012. Tal não deverá excluir a possibilidade de os repositórios de transações e as entidades envolvidas acordarem entre si o estabelecimento de uma conexão segura máquina-máquina com recurso a um canal adicional, separado do SFTP. Os repositórios de transações deverão, por conseguinte, ser autorizados a continuar a utilizar outras conexões seguras máquina-máquina para além, mas nunca em substituição, da utilização do SFTP.

- (7) Os dados relativos às mais recentes posições de transação dos contratos de derivados com posições em aberto é essencial para o controlo da estabilidade financeira e do risco sistémico, pelo que as entidades relevantes devem ter acesso a esses dados.
- (8) É essencial proporcionar o acesso direto e imediato a conjuntos específicos de dados e, assim, estabelecer um conjunto de pedidos *ad hoc* combináveis no que se refere às partes na transação, às condições económicas, à classificação e identificação do contrato de derivados, ao horizonte temporal da execução, da comunicação de informações e de vencimento, bem como às diferentes ocorrências associadas à atividade e ao ciclo de vida.
- (9) Os prazos em que são disponibilizados dados às entidades relevantes pelos repositórios de transações devem ser harmonizados a fim de melhorar o acesso direto e imediato aos dados dos repositórios de transações e permitir às entidades relevantes e aos repositórios de transações melhorarem a programação do seu processamento interno de dados.
- (10) Por conseguinte, o Regulamento Delegado (UE) n.º 151/2013 deve ser alterado a fim de melhor especificar, e melhorar, o quadro operacional para o acesso, a agregação e a comparação de dados entre repositórios de transações.
- (11) A aplicação do disposto no presente regulamento delegado deverá ser diferida, a fim de facilitar aos repositórios de transações a adaptação dos sistemas às especificações nele estabelecidas.
- (12) O presente regulamento tem por base os projetos de normas técnicas de regulamentação apresentados pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados à Comissão.
- (13) Em conformidade com o artigo 10.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010, a ESMA realizou consultas públicas abertas sobre os projetos de normas técnicas de regulamentação em que se baseia o presente regulamento e analisou os potenciais custos e benefícios associados. Estas consultas públicas permitiram à ESMA tomar conhecimento dos pontos de vista das autoridades relevantes e dos membros do Sistema Europeu de Bancos Centrais (SEBC), que foram apresentados pelo BCE. Além disso, a ESMA 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

Alteração do Regulamento Delegado (UE) n.º 151/2013

1. O artigo 4.º é alterado do seguinte modo:

a) o n.º 1 passa a ter a seguinte redação:

«1. Um repositório de transações deve proporcionar às entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 o acesso direto e imediato, nomeadamente caso exista uma delegação ao abrigo do artigo 28.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010, às informações pormenorizadas relativas aos contratos de derivados em conformidade com os artigos 2.º e 3.º do presente regulamento.

Para efeitos de aplicação do primeiro parágrafo, um repositório de transações deve utilizar um formato XML e um modelo elaborado de acordo com a metodologia da norma ISO 20022. Um repositório de transações pode, além disso, com o acordo da entidade envolvida, proporcionar o acesso às informações pormenorizadas relativas aos contratos de derivados sob um outro formato estabelecido de comum acordo.»

b) o n.º 2 é suprimido.

2. No artigo 5.º, são aditados os n.ºs 3 a 9:

«3. Um repositório de transações deve estabelecer e manter as disposições de natureza técnica necessárias para permitir às entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 conectarem-se através de uma interface máquina-máquina segura para apresentarem pedidos de dados e para receberem dados.

Para efeitos do primeiro parágrafo, um repositório de transações deve utilizar o protocolo de transferência de ficheiros SSH. Para comunicar através dessa interface, um repositório de transações deve utilizar mensagens XML normalizadas geradas em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022. Um repositório de transações pode, além disso, com o acordo da entidade envolvida, estabelecer uma conexão utilizando um outro protocolo estabelecido de comum acordo.

4. Em conformidade com os artigos 2.º e 3.º do presente regulamento, um repositório de transações deve proporcionar às entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 o acesso às seguintes informações:

- a) todos os relatórios relativos aos contratos de derivados;
- b) as mais recentes posições de transação dos contratos de derivados que não tenham atingido o vencimento, ou que não tenham sido objeto de um relatório com ação de tipo “E”, “C”, “P” ou “Z”, como referido no campo 93 do quadro 2 do anexo do Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012 da Comissão (*).

5. Um repositório de transações deve estabelecer e manter as disposições de natureza técnica necessárias para permitir às entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 emitirem pedidos periódicos predefinidos de acesso às informações pormenorizadas relativas aos contratos de derivados, como referidas no ponto 4, de que essas entidades necessitem para o exercício das respetivas responsabilidades e mandatos.

6. Caso lhe seja pedido, um repositório de transações deve proporcionar às entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 o acesso às informações pormenorizadas relativas aos contratos de derivados em conformidade com qualquer combinação dos seguintes campos, como referidos no anexo do Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012:

- a) data e hora da transmissão do relatório;
- b) identificação da contraparte que transmite o relatório;
- c) identificação da outra contraparte;
- d) setor empresarial da contraparte que transmite o relatório;
- e) natureza da contraparte que transmite o relatório;
- f) identificação do corretor;
- g) identificação da entidade que transmite o relatório;
- h) identificação do beneficiário;
- i) classe de ativos;
- j) classificação do produto;
- k) identificação do produto;
- l) identificação do subjacente;
- m) espaço ou organização de execução;
- n) data e hora de execução;
- o) data de vencimento;
- p) data de cessação;
- q) CCP; e
- r) tipo de ação.

7. Um repositório de transações deve estabelecer e manter a capacidade técnica para proporcionar, às entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, o acesso direto e imediato às informações pormenorizadas relativas aos contratos de derivados de que estas necessitem para o exercício das respetivas responsabilidades e mandatos. Esse acesso deve ser proporcionado do seguinte modo:

- a) se uma entidade enumerada no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 solicita o acesso a informações pormenorizadas relativas aos contratos de derivados em vigor ou aos contratos de derivados que tenham atingido o vencimento ou relativamente aos quais tenham sido apresentados relatórios com ações de tipo “E”, “C”, “Z” ou “P”, como referido no campo 93 do quadro 2 do anexo do Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012, há menos de um ano relativamente à data em que o pedido foi apresentado, um repositório de transações deve satisfazer esse pedido até às 12:00 TUC (Tempo Universal Coordenado) do primeiro dia de calendário subsequente à data em que o pedido de acesso foi apresentado.

- b) se uma entidade enumerada no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 solicita o acesso a informações pormenorizadas relativas aos contratos de derivados que tenham atingido o vencimento ou relativamente aos quais tenham sido apresentados relatórios com ações de tipo “E”, “C”, “Z” ou “P”, como referido no campo 93 do quadro 2 do anexo do Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012, há mais de um ano relativamente à data em que o pedido foi apresentado, um repositório de transações deve satisfazer esse pedido no prazo de três dias úteis a contar da data em que o pedido de acesso foi apresentado.
- c) se o pedido de acesso a dados emitido por uma entidade enumerada no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 se refere a contratos de derivados abrangidos tanto pela alínea a) como pela alínea b), um repositório de transações deve proporcionar informações pormenorizadas sobre esses contratos de derivados no prazo de três dias úteis a contar da data em que o pedido de acesso foi apresentado.

8. Um repositório de transações deve confirmar a receção e verificar a correção e completude de todos os pedidos de acesso a dados que sejam apresentados pelas entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012. Deve notificar as referidas entidades do resultado dessa verificação no prazo de sessenta minutos a contar da apresentação do pedido.

9. Um repositório de transações deve utilizar protocolos de assinatura eletrónica e encriptação de dados para assegurar a confidencialidade, integridade e proteção dos dados disponibilizados às entidades enumeradas no artigo 81.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012.

(*) Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012 da Comissão, de 19 de dezembro de 2012, que estabelece as normas técnicas de execução no que se refere ao formato e à periodicidade dos relatórios de transações a transmitir aos repositórios de transações nos termos do Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações (JO L 352 de 21.12.2012, p. 20), com a redação que lhe foi dada pelo Regulamento de Execução (UE) 2017/105 (JO L 17 de 21.1.2017, p. 17).»

Artigo 2.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 1 de novembro de 2017.

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

Feito em Bruxelas, em 29 de junho de 2017.

Pela Comissão
O Presidente
Jean-Claude JUNCKER