REGULAMENTO DELEGADO (UE) 2017/590 DA COMISSÃO

de 28 de julho de 2016

que complementa o Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho no que respeita às normas técnicas de regulamentação para a comunicação de informações sobre as transações às 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 26.º, n.º 9, terceiro parágrafo,

Considerando o seguinte:

(1) Para efeitos de uma análise eficaz dos dados por parte das autoridades competentes, deve ser assegurada a coerência das normas e dos formatos utilizados na comunicação de informações sobre as transações.

(2) Tendo em contas as práticas de mercado, a experiência de supervisão e a evolução do mercado, o significado de uma transação para efeitos de comunicação de informações deve ser lato. Deve abranger as compras e vendas de instrumentos de comunicação obrigatória, bem como outros casos de aquisição ou alienação de instrumentos de comunicação obrigatória, uma vez que podem também suscitar preocupações em termos de abuso de mercado. Além disso, as alterações do valor nocional podem suscitar preocupações sobre um possível abuso de mercado, uma vez que podem, por natureza, ser vistas como similares a transações de compra ou de venda adicionais. Para que as autoridades competentes possam distinguir essas alterações de outras operações de compra ou de venda, as informações sobre essas alterações devem ser especificamente incluídas nas comunicações de transações.

(3) O conceito de uma transação não deve incluir atos ou acontecimentos que não tenham de ser comunicados às autoridades competentes para efeitos de fiscalização do mercado. A fim de assegurar que as comunicações de transações não incluem informações sobre tais atos e acontecimentos, estes devem ser especificamente excluídos da definição de uma transação.

(4) A fim de esclarecer quais as empresas de investimento que são obrigadas a comunicar transações, devem ser especificados os serviços ou as atividades que conduzem a uma transação. Por conseguinte, deve considerar-se que uma empresa de investimento está a executar uma transação sempre que preste um serviço ou realize uma atividade a que se referem os números 1, 2 e 3 da secção A do anexo I da Diretiva 2014/65/UE do Parlamento Europeu e do Conselho ([2]), tome a decisão de investimento em conformidade com um mandato discricionário conferido por um cliente ou transfira instrumentos financeiros de ou para contas, desde que, em cada caso, esses serviços ou atividades tenham resultado numa transação. Contudo, em conformidade com o artigo 26.º, n.º 4, do Regulamento (UE) n.º 600/2014, as empresas de investimento que se considera terem transmitido ordens que resultem em transações não devem ser consideradas como tendo executado essas transações.

(5) A fim de evitar a não comunicação ou a dupla comunicação de informações pelas empresas de investimento que transmitem ordens entre si, a empresa de investimento que tenciona transmitir a ordem deve acordar com a empresa que recebe a ordem se esta irá reportar todos os pormenores da transação resultante ou se irá transmitir a ordem a outra empresa de investimento. Na ausência de um acordo, a ordem deve ser considerada não transmitida e cada empresa de investimento deve apresentar a sua própria comunicação de transação incluindo [em todos os casos] as informações que dizem respeito à transação que cada empresa de investimento está a comunicar. Além disso, as informações relacionadas com a ordem a transmitir entre firmas devem ser especificadas, a fim de garantir que as autoridades competentes recebem informações relevantes, precisas e completas.

(6) A fim de garantir a identificação certa e eficiente das empresas de investimento responsáveis pela execução das transações, essas empresas devem garantir que estão identificadas na comunicação de transação apresentada por força da sua obrigação de comunicação de transações, utilizando identificadores de entidade jurídica (LEI) validados, emitidos e devidamente renovados.

([1]) JO L 173 de 12.6.2014, p. 84.
([2]) Diretiva 2014/65/UE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 15 de maio de 2014, relativa aos mercados de instrumentos financeiros e que altera a Diretiva 2002/92/CE e a Diretiva 2011/61/UE (JO L 173 de 12.6.2014, p. 349).

(7) Para garantir uma identificação coerente e sólida das pessoas singulares referidas nas comunicações de transações, estas devem ser identificadas através da concatenação do país da sua nacionalidade com os identificadores atribuídos por esse país de nacionalidade a essas pessoas. Se esses identificadores não estiverem disponíveis, as pessoas singulares devem ser identificadas por identificadores criados a partir da concatenação da sua data de nascimento com o seu nome.

(8) Para facilitar a fiscalização do mercado, a identificação dos clientes deve ser coerente, única e sólida. As comunicações de transações devem, assim, incluir o nome completo e a data de nascimento dos clientes que são pessoas singulares e devem identificar os clientes que são entidades jurídicas através dos respetivos LEI.

(9) As pessoas ou os algoritmos informáticos que tomam decisões de investimento podem ser responsáveis por situações de abuso de mercado. Por conseguinte, a fim de garantir uma fiscalização eficaz do mercado, quando as decisões de investimento são tomadas por uma pessoa que não seja o cliente ou por um algoritmo informático, essa pessoa ou algoritmo devem ser identificados na comunicação de transação através de identificadores únicos, sólidos e coerentes. Quando a decisão de investimento for tomada por mais do que uma pessoa numa empresa de investimento, a pessoa que assume a responsabilidade principal pela decisão deve ser identificada na comunicação.

(10) As pessoas ou os algoritmos responsáveis por determinar a plataforma de acesso ou uma empresa de investimento à qual as ordens serão transmitidas ou quaisquer outras condições relacionadas com a execução da ordem podem, por isso, ser responsáveis por situações de abuso de mercado. Por conseguinte, a fim de garantir uma fiscalização eficaz do mercado, uma pessoa ou um algoritmo informático da empresa de investimento que seja responsável por tais atividades devem ser identificados na comunicação de transação. Quando estiverem envolvidos tanto uma pessoa como um algoritmo informático, ou mais de uma pessoa ou algoritmo, a empresa de investimento deve determinar, de forma consistente e de acordo com critérios predeterminados, qual é a pessoa ou o algoritmo que é o principal responsável por essas atividades.

(11) Para permitir um controlo eficaz do mercado, as comunicações de transações devem incluir informações exatas sobre qualquer alteração da posição de uma empresa de investimento ou do seu cliente que resultou de uma transação de comunicação obrigatória no momento em que essa transação ocorreu. As empresas de investimento devem, por conseguinte, comunicar de forma consistente os campos relacionados numa determinada comunicação de transação e devem comunicar uma transação ou os diferentes segmentos de uma transação de forma que as suas comunicações, coletivamente, forneçam uma imagem global clara que reflita com exatidão as mudanças de posição.

(12) As operações de venda a descoberto devem ser especificamente assinaladas como tal, independentemente de constituírem uma operação de venda a descoberto total ou parcial.

(13) Uma fiscalização eficaz do mercado no caso de uma transação de uma combinação de instrumentos financeiros apresenta desafios específicos para a fiscalização do mercado. A autoridade competente precisa de ter uma perspetiva global e de conseguir ver separadamente as transações relativamente a cada instrumento financeiro integrado numa transação em que esteja envolvido mais do que um instrumento financeiro. Por conseguinte, as empresas de investimento que executem transações com uma combinação de instrumentos financeiros devem comunicar a transação de cada instrumento financeiro separadamente e relacionar essas comunicações através de um identificador único ao nível da empresa para o grupo de comunicações de transações relativas a essa execução.

(14) A fim de salvaguardar a eficácia da fiscalização dos abusos de mercado por pessoas coletivas, os Estados-Membros devem garantir o desenvolvimento dos códigos LEI, a atribuir e manter de acordo com os princípios consagrados internacionalmente de forma a assegurar que as pessoas coletivas sejam identificadas de forma consistente e exclusiva. As empresas de investimento devem obter os LEI dos seus clientes antes de prestarem serviços que acarretem obrigações de comunicação no que respeita a transações efetuadas em nome desses clientes e utilizar esses LEI nas suas comunicações de transações.

(15) A fim de assegurar a eficiência e a eficácia do controlo do mercado, as comunicações de transações só devem ser apresentadas uma vez e a uma única autoridade competente, que as poderá encaminhar para outras autoridades competentes relevantes. Por conseguinte, sempre que uma empresa de investimento executa uma transação, deve apresentar a comunicação à autoridade competente do seu Estado-Membro de origem, independentemente de haver ou não uma sucursal envolvida ou de a empresa que apresenta a comunicação ter executado ou não a transação por intermédio de uma sucursal noutro Estado-Membro. Além disso, quando uma transação é executada, no todo ou em parte, por intermédio de uma sucursal de uma empresa de investimento localizada noutro Estado-Membro, a comunicação só deve ser apresentada uma vez, à autoridade competente do Estado-Membro de origem da empresa de investimento, salvo decisão em contrário das autoridades competentes do Estado-Membro de origem e do Estado-Membro de acolhimento. A fim de assegurar que as autoridades competentes do Estado-Membro de acolhimento possam supervisionar os serviços prestados por sucursais no seu território, será preciso que recebam comunicações das transações celebradas no quadro das atividades das sucursais. Por este motivo, e para permitir o encaminhamento das comunicações de transações para todas as autoridades competentes relevantes no que respeita às sucursais que participam nessas transações, é necessário incluir nas já referidas comunicações dados granulares sobre a atividade das sucursais.

(16) A existência de dados completos e exatos sobre as comunicações de transações será essencial para a supervisão dos abusos de mercado. As plataformas de negociação e as empresas de investimento deverão, por conseguinte, dispor de métodos e disposições para assegurar a apresentação de comunicações de transações completas e exatas às autoridades competentes. Os ARM não devem ser abrangidos pelo presente regulamento, uma vez que estão sujeitos a um regime próprio especificado no Regulamento Delegado (UE) 2017/571 da Comissão ([1]) e são objeto de requisitos análogos para assegurar o caráter exaustivo e a exatidão dos dados.

(17) Para conseguir acompanhar as anulações ou correções, a empresa de investimento deve conservar as informações sobre as correções e anulações que lhe são prestadas pelo ARM nos casos em que o ARM, de acordo com as instruções da empresa de investimento, anule ou corrija uma comunicação de transação apresentada em nome de uma empresa de investimento.

(18) A determinação do mercado mais relevante em termos de liquidez permite o encaminhamento de comunicações de transações para outras autoridades competentes e permite que os investidores identifiquem as autoridades competentes a quem deverão comunicar as suas posições curtas por força dos artigos 5.º, 7.º e 8.º do Regulamento (UE) n.º 236/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho ([2]). As regras para determinar a autoridade competente relevante nos termos da Diretiva 2004/39/CE do Parlamento Europeu e do Conselho ([3]) têm funcionado de forma eficaz para a maioria dos instrumentos financeiros e devem, por isso, permanecer inalteradas. Contudo, devem ser introduzidas novas regras, sobretudo para os instrumentos que não são abrangidos pela Diretiva 2004/39/CE, nomeadamente os instrumentos de dívida emitidos por uma entidade de um país terceiro, as licenças de emissão e os derivados cujo subjacente imediato não possua um identificador global, ou seja um cabaz ou um índice exterior ao EEE.

(19) Por razões de coerência e a fim de assegurar o funcionamento eficiente dos mercados financeiros, é necessário que as disposições do presente regulamento e as disposições do Regulamento (UE) n.º 600/2014 sejam aplicáveis a partir da mesma data.

(20) O presente regulamento tem por base os projetos de normas técnicas de regulamentação apresentados pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados (ESMA) à Comissão.

(21) A ESMA conduziu consultas públicas abertas sobre os projetos de normas técnicas de regulamentação que servem de base ao presente regulamento, analisou os seus potenciais custos e benefícios e solicitou o parecer do Grupo de Interessados do Setor dos Valores Mobiliários e dos Mercados criado pelo artigo 37.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho ([4]),

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

Artigo 1.º

Normas e formatos dos dados para a comunicação de transações

Uma comunicação de transação deve incluir todos os dados referidos no quadro 2 do anexo I que sejam referentes aos instrumentos financeiros em causa. Todas as informações a incluir nas comunicações de transações devem ser apresentadas em conformidade com as normas e os formatos especificados no quadro 2 do anexo I, num formato eletrónico e que permita a leitura por máquina e num modelo XML comum em conformidade com a metodologia da norma ISO 20022.

Artigo 2.º

Significado de transação

1. Para efeitos do artigo 26.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014, a conclusão de uma aquisição ou alienação de um instrumento financeiro referido no artigo 26.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 600/2014 constitui uma transação.

([1]) Regulamento Delegado (UE) 2017/571 da Comissão, de 2 de junho de 2016, que complementa a Diretiva 2014/65/UE do Parlamento Europeu e do Conselho no que respeita às normas técnicas de regulamentação sobre a autorização, requisitos de organização e a publicação de transações no que respeita aos prestadores de serviços de comunicação de dados (ver página 126 do presente Jornal Oficial).

([2]) Regulamento (UE) n.º 236/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 14 de março de 2012, relativo às vendas a descoberto e a certos aspetos dos *swaps* de risco de incumprimento (JO L 86 de 24.3.2012, p. 1).

([3]) Diretiva 2004/39/CE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 21 de abril de 2004, relativa aos mercados de instrumentos financeiros, que altera as Diretivas 85/611/CEE e 93/6/CEE do Conselho e a Diretiva 2000/12/CE do Parlamento Europeu e do Conselho e que revoga a Diretiva 93/22/CEE do Conselho (JO L 145 de 30.4.2004, p. 1).

([4]) 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. Uma aquisição referida no n.º 1 inclui as seguintes operações:

a) A compra de um instrumento financeiro;

b) A celebração de um contrato de derivados;

c) Um aumento do valor nocional de um contrato de derivados.

3. Uma alienação referida no n.º 1 inclui as seguintes operações:

a) A venda de um instrumento financeiro;

b) O encerramento de um contrato de derivados;

c) Uma diminuição do valor nocional de um contrato de derivados.

4. Para efeitos do artigo 26.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014, uma transação inclui igualmente uma aquisição e uma alienação simultâneas de um instrumento financeiro em que não há mudança de propriedade desse instrumento financeiro, mas relativamente às quais a publicação pós-negociação é obrigatória nos termos dos artigos 6.º, 10.º, 20.º ou 21.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014.

5. Para efeitos do artigo 26.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014, uma transação não inclui as seguintes operações:

a) Operações de financiamento através de valores mobiliários, tal como definido no artigo 3.º, n.º 11, do Regulamento (UE) 2015/2365 do Parlamento Europeu e do Conselho ([1]);

b) Um contrato exclusivamente celebrado para fins de compensação ou de liquidação;

c) Uma liquidação de obrigações recíprocas entre as partes, em que a obrigação líquida é prorrogada;

d) Uma aquisição ou alienação que resulta apenas de uma atividade de custódia;

e) Uma cessão ou novação pós-negociação de um contrato de derivados, em que uma das partes no contrato de derivados é substituída por um terceiro;

f) Uma compressão de carteiras;

g) A criação ou o reembolso de unidades de um organismo de investimento coletivo pelo administrador desse organismo de investimento coletivo;

h) O exercício de um direito embutido num instrumento financeiro, ou a conversão de uma obrigação convertível e a transação resultante sobre o instrumento financeiro subjacente;

i) A criação, expiração ou o resgate de um instrumento financeiro em resultado de cláusulas contratuais predeterminadas ou em resultado de eventos obrigatórios que escapam ao controlo do investidor, em que o investidor não toma qualquer decisão de investimento no momento da criação, expiração ou do reembolso do instrumento financeiro;

j) Uma diminuição ou um aumento do valor nocional de um contrato de derivados em resultado de cláusulas contratuais predeterminadas ou eventos obrigatórios, em que o investidor não toma qualquer decisão de investimento no momento da alteração do valor nocional;

k) Uma alteração na composição de um índice ou cabaz, que ocorre após a execução de uma transação;

l) Uma aquisição no âmbito de um plano de reinvestimento de dividendos;

m) Uma aquisição ou alienação no âmbito de um plano de atribuição de ações aos trabalhadores, ou decorrente da gestão de um fundo de ativos não reclamado, ou de direitos sobre quotas-partes residuais na sequência de eventos societários ou como parte de programas de redução das participações, sempre que estiverem preenchidos todos os seguintes critérios:

   i) as datas de aquisição ou alienação são predeterminadas e publicadas previamente,

([1]) Regulamento (UE) 2015/2365 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 25 de novembro de 2015, relativo à transparência das operações de financiamento através de valores mobiliários e de reutilização e que altera o Regulamento (UE) n.º 648/2012 (JO L 337 de 23.12.2015, p. 1).

ii) a decisão de investimento relativa à aquisição ou alienação que é tomada pelo investidor é equivalente a uma escolha do investidor no sentido de efetuar a transação sem qualquer possibilidade de alterar unilateralmente os termos da mesma,

iii) ocorre um prazo de pelo menos dez dias úteis entre a decisão de investimento e o momento da execução,

iv) o valor da transação é limitado ao equivalente a 1 000 EUR para uma transação pontual do investidor em causa com o instrumento em causa ou, se o acordo der origem a transações, o valor acumulado da transação é limitado ao equivalente a 500 EUR para o investidor em causa com o instrumento em causa por mês civil,

n) Uma oferta de troca e de aquisição sobre uma obrigação ou outra forma de dívida titularizada, sempre que os termos e as condições da oferta forem predeterminados e publicados previamente e a decisão de investimento for equivalente a uma escolha do investidor no sentido de efetuar a transação sem qualquer possibilidade de alterar unilateralmente os termos da mesma;

o) Uma aquisição ou alienação que resulta unicamente da transferência de uma garantia.

A exclusão prevista na alínea a) do primeiro parágrafo não é aplicável às operações de financiamento através de valores mobiliários nas quais uma das contrapartes seja um membro do Sistema Europeu de Bancos Centrais.

A exclusão prevista na subalínea i) do primeiro parágrafo não é aplicável a ofertas públicas iniciais ou a ofertas ou colocações públicas secundárias, nem à emissão de dívida.

Artigo 3.º

Significado de execução de uma transação

1. Considera-se que uma empresa de investimento executou uma transação na aceção do artigo 2.º quando prestar qualquer um dos seguintes serviços ou realizar qualquer uma das seguintes atividades que resultam numa transação:

a) Receção e transmissão de ordens relativas a um ou mais instrumentos financeiros;

b) Execução de ordens em nome de clientes;

c) Negociação por conta própria;

d) Tomar uma decisão de investimento em conformidade com um mandato discricionário conferido por um cliente;

e) Transferência de instrumentos financeiros de e para contas.

2. Não se considera que uma empresa de investimento executou uma transação quando tiver transmitido uma ordem em conformidade com o artigo 4.º.

Artigo 4.º

Transmissão de uma ordem

1. Uma empresa de investimento que transmite uma ordem nos termos do artigo 26.º, n.º 4, do Regulamento (UE) n.º 600/2014 (empresa transmissora) só é considerada como tendo transmitido essa ordem se estiverem preenchidas as seguintes condições:

a) A ordem foi recebida do seu cliente ou resulta da sua decisão de adquirir ou alienar um instrumento financeiro específico em conformidade com um mandato discricionário que lhe foi conferido por um ou mais clientes;

b) A empresa transmissora transmitiu os detalhes da ordem referida no n.º 2 a outra empresa de investimento (empresa recetora);

c) A empresa recetora está abrangida pelo artigo 26.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 600/2014 e aceita comunicar a transação resultante da ordem em causa ou transmitir os pormenores da ordem, em conformidade com o presente artigo, a outra empresa de investimento.

Para efeitos da alínea c) do primeiro parágrafo, o acordo deve especificar o prazo para o fornecimento dos dados da ordem pela empresa transmissora à empresa recetora e estipular que a empresa recetora deve verificar se os detalhes da ordem recebidos contêm erros ou omissões óbvios antes de apresentar uma comunicação de transação ou de transmitir a ordem em conformidade com o presente artigo.

2. Os seguintes detalhes da ordem devem ser transmitidos em conformidade com o n.º 1, na medida em que tal seja pertinente para uma determinada ordem:

a) O código de identificação do instrumento financeiro;

b) Se a ordem se destina à aquisição ou alienação do instrumento financeiro;

c) O preço e a quantidade indicados na ordem;

d) A designação e os dados do cliente da empresa transmissora para efeitos da ordem;

e) A designação e os dados do decisor em nome do cliente, quando a decisão de investimento é tomada por via de poderes de representação;

f) Uma designação para identificar uma venda a descoberto;

g) Uma designação para identificar uma pessoa ou um algoritmo responsável pela decisão de investimento dentro da empresa transmissora;

h) O país da sucursal da empresa de investimento que supervisiona a pessoa responsável pela decisão de investimento e o país da sucursal da empresa de investimento que recebeu a ordem do cliente ou que tomou uma decisão de investimento em nome de um cliente em conformidade com um mandato discricionário que lhe é conferido por esse cliente;

i) No caso de uma ordem relacionada com derivados de mercadorias, uma indicação sobre se a transação se destina a reduzir o risco de uma forma objetivamente mensurável em conformidade com o artigo 57.º da Diretiva 2014/65/UE;

j) O código que identifica a empresa transmissora.

Para efeitos da alínea d) do primeiro parágrafo, quando o cliente for uma pessoa singular deve ser designado em conformidade com o artigo 6.º.

Para efeitos da alínea j) do primeiro parágrafo, quando a ordem transmitida foi recebida de uma outra empresa que não transmitiu anteriormente a ordem em conformidade com as condições estabelecidas no presente artigo, o código deve corresponder ao código que identifica a empresa transmissora. Quando a ordem transmitida foi recebida de uma outra empresa que já transmitiu a ordem anterior em conformidade com as condições estabelecidas no presente artigo, o código fornecido nos termos da alínea j) referido no primeiro parágrafo deve ser o código que identifica a empresa transmissora anterior.

3. Caso exista mais do que uma empresa transmissora em relação a uma determinada ordem, os detalhes da ordem referidos nas alíneas d) a i) do primeiro parágrafo do n.º 2 devem ser transmitidos em relação ao cliente da primeira empresa transmissora.

4. Sempre que a ordem seja agregada para vários clientes, as informações referidas no n.º 2 devem ser transmitidas em relação a cada cliente.

Artigo 5.º

Identificação da empresa de investimento que executa uma transação

1. Uma empresa de investimento que executa uma transação deve garantir que é identificada com um código identificador da entidade jurídica ISO 17442 validado, emitido e devidamente renovado na comunicação de transação apresentada por força do artigo 26.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 600/2014.

2. Uma empresa de investimento que executa uma transação deve assegurar que os dados de referência relacionados com o seu identificador de entidade jurídica são renovados em conformidade com os termos de quaisquer unidades operacionais locais acreditadas do Sistema Mundial de Identificação de Entidades Jurídicas.

Artigo 6.º

Designação para identificar pessoas singulares

1. Uma pessoa singular deve ser identificada numa comunicação de transação utilizando a designação resultante da concatenação do código ISO 3166-1 alfa-2 (código de país de duas letras) da nacionalidade da pessoa com o identificador de cliente nacional constante do anexo II com base na nacionalidade da pessoa.

2. O identificador de cliente nacional referido no n.º 1 deve ser atribuído em conformidade com os níveis de prioridade previstos no anexo II, utilizando o identificador de maior prioridade que uma pessoa tenha, independentemente de que esse identificador já seja ou não do conhecimento da empresa de investimento.

3. Quando uma pessoa singular for nacional de mais de um país do Espaço Económico Europeu (EEE), deve ser utilizado o código de país da primeira nacionalidade por ordem alfabética do respetivo código ISO 3166-1 alfa-2 e o identificador dessa nacionalidade atribuído em conformidade com o n.º 2. Quando uma pessoa singular tem uma nacionalidade que não pertence ao EEE, deve ser utilizado o identificador de maior prioridade em conformidade com o campo referente a «Todos os outros países» constante do anexo II. Quando uma pessoa singular tem uma nacionalidade do EEE e uma nacionalidade que não pertence ao EEE, deve ser utilizado o código de país da nacionalidade do EEE e o identificador de maior prioridade dessa nacionalidade atribuído em conformidade com o n.º 2.

4. Quando o identificador atribuído em conformidade com o n.º 2 incluir a referência CONCAT, a pessoa singular deve ser identificada pela empresa de investimento através da concatenação dos seguintes elementos pela seguinte ordem:

a) A data de nascimento da pessoa no formato AAAAMMDD;

b) Os cinco primeiros carateres do nome próprio;

c) Os cinco primeiros carateres do apelido.

5. Para efeitos do disposto no n.º 4, os prefixos dos nomes devem ser excluídos e aos nomes próprios e apelidos com menos de cinco carateres devem ser acrescentados «#» de modo a garantir que as referências aos nomes e apelidos nos termos do n.º 4 contêm cinco carateres. Todos os carateres devem estar em maiúsculas. Não devem ser utilizados apóstrofos, acentos, hífenes, sinais de pontuação ou espaços.

Artigo 7.º

Dados de identidade do cliente e identificador e dados do decisor

1. Uma comunicação de transação relacionada com uma transação executada em nome de um cliente que seja uma pessoa singular deve incluir o nome completo e a data de nascimento do cliente, tal como especificado nos campos 9, 10, 11, 18, 19 e 20 do quadro 2 do anexo I.

2. Se o cliente não for a pessoa que toma a decisão de investimento em relação a essa transação, a comunicação de transação deve identificar a pessoa que toma tal decisão em nome do cliente, tal como especificado nos campos 12 a 15 e nos campos 21 a 24 do quadro 2 do anexo I, respetivamente, para o comprador e para o vendedor.

Artigo 8.º

Identificação da pessoa ou do algoritmo informático responsável pela decisão de investimento

1. Quando uma pessoa ou um algoritmo informático numa empresa de investimento toma a decisão de investimento de adquirir ou de alienar um instrumento financeiro específico, essa pessoa ou algoritmo informático deve ser identificado tal como especificado no campo 57 do quadro 2 do anexo I. A empresa de investimento só deve identificar tal pessoa ou algoritmo informático quando essa decisão de investimento for tomada em nome da própria empresa de investimento ou em nome de um cliente em conformidade com um mandato discricionário que lhe é conferido por um cliente.

2. Se a decisão de investimento for tomada por mais do que uma pessoa da empresa de investimento, a empresa de investimento deve determinar qual é a pessoa que tem a responsabilidade principal por tal decisão. A pessoa que tem a responsabilidade principal pela decisão de investimento deve ser determinada em conformidade com critérios predeterminados estabelecidos pela empresa de investimento.

3. Se o responsável pela decisão de investimento em conformidade com o n.º 1 for um algoritmo informático da empresa de investimento, a empresa de investimento deve atribuir uma designação para identificar o algoritmo informático numa comunicação de transação. Essa designação deve preencher as seguintes condições:

a) É única para cada conjunto de códigos ou estratégias de negociação que constituem o algoritmo, independentemente dos instrumentos financeiros ou dos mercados aos quais o algoritmo é aplicável;

b) É utilizada de forma coerente quando é feita referência ao algoritmo ou à versão do algoritmo aos quais foi atribuída;

c) É única ao longo do tempo.

Artigo 9.º

Identificação da pessoa ou do algoritmo informático responsável pela execução de uma transação

1. Se for uma pessoa ou um algoritmo informático da empresa de investimento que executa uma transação a determinar a que plataforma de negociação, internalizador sistemático ou plataforma de negociação organizada localizada fora da União irá aceder, a que empresas irá transmitir ordens ou quaisquer outras condições relacionadas com a execução de uma ordem, essa pessoa ou algoritmo informático devem ser identificados no campo 59 do quadro 2 do anexo I.

2. Se o responsável pela execução da transação for uma pessoa da empresa de investimento, a empresa de investimento deve atribuir uma designação para identificar essa pessoa numa comunicação de transação em conformidade com o artigo 6.º.

3. Se o responsável pela execução da transação for um algoritmo informático da empresa de investimento, a empresa de investimento deve atribuir uma designação para identificar o algoritmo informático em conformidade com o artigo 8.º, n.º 3.

4. Se a execução da transação envolver uma ou mais pessoas e um ou mais algoritmos informáticos, a empresa de investimento deve determinar que pessoa ou algoritmo informático é o principal responsável pela execução da transação. A pessoa ou o algoritmo informático que tem a responsabilidade principal pela execução deve ser determinado em conformidade com critérios predeterminados estabelecidos pela empresa de investimento.

Artigo 10.º

Designação para identificar uma dispensa aplicável

As comunicações de transações devem identificar a dispensa aplicável por força do artigo 4.º ou do artigo 9.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014 ao abrigo do qual a transação executada ocorreu em conformidade com o campo 61 do quadro 2 do anexo I do presente regulamento.

Artigo 11.º

Designação para identificar uma venda a descoberto

1. As comunicações de transações devem identificar as transações que, no momento da sua execução, são transações de venda a descoberto ou parcialmente a descoberto, em conformidade com o campo 62 do quadro 2 do anexo I.

2. Uma empresa de investimento deve determinar, na base do «melhor esforço», as operações de venda a descoberto nas quais o seu cliente é o vendedor, nomeadamente quando agrega ordens de vários clientes. A empresa de investimento deve identificar essas transações de venda a descoberto na sua comunicação de transação em conformidade com o campo 62 do quadro 2 do anexo I.

3. Se uma empresa de investimento executar uma operação de venda a descoberto em seu próprio nome, deve indicar na sua comunicação de transação se a transação de venda a descoberto foi realizada na qualidade de atividade de criação de mercado ou de corretor principal ao abrigo de uma isenção prevista no artigo 17.º do Regulamento (UE) n.º 236/2012.

Artigo 12.º

Comunicação de uma execução relativa a uma combinação de instrumentos financeiros

Se uma empresa de investimento executar uma transação que envolva dois ou mais instrumentos financeiros, a empresa de investimento deve comunicar a transação relativa a cada instrumento financeiro separadamente e deve relacionar essas comunicações através de um identificador único ao nível da empresa para o grupo de comunicações de transação relativas a essa execução tal como especificado no campo 40 do quadro 2 do anexo I.

Artigo 13.º

Condições em que os identificadores de entidades jurídicas devem ser elaborados, atribuídos e mantidos

1. Os Estados-Membros devem assegurar que os identificadores de entidades jurídicas são elaborados, atribuídos e mantidos em conformidade com os seguintes princípios:

a) Caráter único;

b) Exatidão;

c) Consistência;

d) Neutralidade;

e) Fiabilidade;

f) Fonte aberta;

g) Flexibilidade;

h) Caráter modulável;

i) Acessibilidade.

Os Estados-Membros devem também assegurar que os identificadores de entidades jurídicas são elaborados, atribuídos e mantidos através de normas operacionais uniformes a nível mundial, estão sujeitos ao quadro de governação do Comité de Supervisão Regulamentar do Sistema Mundial de Identificação de Entidades Jurídicas e estão disponíveis a um custo razoável.

2. Uma empresa de investimento não deve prestar um serviço que desencadeie a obrigação de apresentar uma comunicação de transação relativa a uma transação realizada em nome de um cliente elegível para o código identificador de pessoa jurídica antes de obter o código identificador de pessoa jurídica desse cliente.

3. A empresa de investimento deve garantir que o comprimento e a construção do código são conformes com a norma ISO 17442 e que o código está incluído na base de dados do Sistema Mundial de Identificação de Entidades Jurídicas mantida pela unidade operacional central nomeada pelo Comité de Supervisão Regulamentar do Sistema Mundial de Identificação de Entidades Jurídicas e pertence ao cliente em causa.

Artigo 14.º

Comunicação de transações executadas por sucursais

1. Uma empresa de investimento deve comunicar as transações total ou parcialmente executadas por intermédio de uma sua sucursal à autoridade competente do Estado-Membro de origem da empresa de investimento, salvo acordo em contrário entre as autoridades competentes dos Estados-Membros de origem e de acolhimento.

2. Se uma empresa de investimento executar total ou parcialmente uma transação por intermédio de uma sua sucursal, só deve comunicar a transação uma vez.

3. Nos casos em que é necessário incluir na comunicação de transação os dados do código de país relativo à sucursal de uma empresa de investimento, em conformidade com os campos 8, 17, 37, 58 ou 60 do quadro 2 do anexo I, devido à execução parcial ou total de uma transação por intermédio dessa sucursal, a empresa de investimento deve indicar na comunicação de transação o código de país ISO 3166 relativo à sucursal em causa em todos os seguintes casos:

a) Se a sucursal tiver recebido a ordem de um cliente ou tiver tomado uma decisão de investimento em nome de um cliente em conformidade com um mandato discricionário que lhe foi conferido pelo cliente;

b) Se a sucursal tiver a responsabilidade de supervisão pela pessoa responsável pela decisão de investimento em causa;

c) Se a sucursal tiver responsabilidades de supervisão da pessoa responsável pela execução da transação;

d) Se a transação tiver sido executada numa plataforma de negociação ou numa plataforma de negociação organizada localizada fora da União através da filiação da sucursal nessa plataforma de negociação ou plataforma de negociação organizada.

4. Quando um ou mais dos casos indicados no n.º 3 não se aplicarem a uma sucursal da empresa de investimento, os campos relevantes do quadro 2 do anexo I devem ser preenchidos com o código de país ISO do Estado-Membro de origem da empresa de investimento, ou, no caso de uma empresa de um país terceiro, com o código do país onde a empresa estabeleceu a sua sede ou sede social.

5. A sucursal de uma empresa de um país terceiro deve apresentar a comunicação de transação à autoridade competente que autorizou a sucursal. A sucursal de uma empresa de um país terceiro deve preencher os campos relevantes do quadro 2 do anexo I com o código de país ISO do Estado-Membro da autoridade competente que emitiu a autorização.

Se uma empresa de um país terceiro tiver aberto sucursais em mais do que um Estado-Membro da União, essas sucursais devem escolher conjuntamente uma das autoridades competentes dos Estados-Membros à qual deverão ser enviadas as comunicações de transações por força dos n.os 1 a 3.

Artigo 15.º

Métodos e mecanismos para a comunicação de transações financeiras

1. Os métodos e mecanismos através dos quais as comunicações de transações são geradas e apresentadas pelas plataformas de negociação e empresas de investimento devem incluir:

a) Sistemas para garantir a segurança e a confidencialidade dos dados comunicados;

b) Mecanismos para autenticar a fonte da comunicação de transação;

c) Medidas cautelares para permitir o rápido reatamento das comunicações de transações em caso de falha do sistema de comunicação;

d) Mecanismos para a identificação de erros e omissões nas comunicações de transações;

e) Mecanismos para evitar a comunicação de notificações de transações duplicadas, nomeadamente quando uma empresa de investimento depende de uma plataforma de negociação para comunicar os dados das transações executadas pela empresa de investimento através dos sistemas da plataforma de negociação em conformidade com o artigo 26.º, n.º 7, do Regulamento (UE) n.º 600/2014;

f) Mecanismos para assegurar que a plataforma de negociação só apresenta comunicações em nome das empresas de investimento que tenham optado por recorrer à plataforma de negociação para enviar comunicações em seu nome relativamente a transações concluídas através dos sistemas da plataforma de negociação;

g) Mecanismos para evitar a comunicação de qualquer transação para a qual não existe qualquer obrigação de comunicação nos termos do artigo 26.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 600/2014, quer porque não existe qualquer transação na aceção do artigo 2.º do presente regulamento quer porque o instrumento objeto da transação em causa não se insere no âmbito de aplicação do artigo 26.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 600/2014;

h) Mecanismos para identificar transações não comunicadas relativamente às quais existe uma obrigação de comunicação nos termos do artigo 26.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014, incluindo os casos em que as comunicações de transações rejeitadas pela autoridade competente em causa não voltaram a ser apresentadas com êxito.

2. Se a plataforma de negociação ou a empresa de investimento tomar conhecimento de qualquer erro ou omissão numa comunicação de transação apresentada a uma autoridade competente, de qualquer caso em que não foi apresentada uma comunicação de transação relativa a uma transação cuja comunicação é obrigatória, incluindo não voltar a apresentar uma comunicação de transação rejeitada, ou da comunicação de uma transação relativamente à qual a comunicação não era obrigatória, deve notificar imediatamente esse facto à autoridade competente em causa.

3. As empresas de investimento devem dispor de mecanismos para garantir que as suas comunicações de transações são completas e exatas. Esses mecanismos devem incluir testes do seu processo de comunicação e uma conciliação regular dos registos de negociação do *front-office* com amostras de dados que lhes são fornecidas pelas respetivas autoridades competentes para esse efeito.

4. Se as autoridades competentes não fornecerem amostras de dados, as empresas de investimento devem conciliar os seus registos de negociação do front-office com as informações contidas nas comunicações de transações que tenham apresentado às autoridades competentes, ou nas comunicações de transações que os ARM ou as plataformas de negociação apresentaram em seu nome. A conciliação deve incluir a verificação da transmissão atempada da comunicação, a exatidão e a integralidade dos campos de dados individuais e a sua conformidade com as normas e os formatos especificados no quadro 2 do anexo I.

5. As empresas de investimento devem dispor de mecanismos para garantir que as suas comunicações de transações, quando consideradas em conjunto, refletem todas as alterações da sua posição e da posição dos seus clientes nos instrumentos financeiros em causa no momento em que as transações com os instrumentos financeiros são executadas.

6. Se um ARM, de acordo com as instruções da empresa de investimento, anular ou corrigir uma comunicação de transação apresentada em nome de uma empresa de investimento, a empresa de investimento deve conservar os pormenores das correções e anulações que lhe forem fornecidos pelo ARM.

7. Os relatórios referidos no artigo 26.º, n.º 5, do Regulamento (UE) n.º 600/2014 devem ser enviados à autoridade competente do Estado-Membro de origem da plataforma de negociação.

8. As autoridades competentes devem utilizar canais de comunicação eletrónicos seguros para a troca de comunicações de transações entre si.

Artigo 16.º

Determinação do mercado mais relevante em termos de liquidez

1. No caso de um valor mobiliário na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 44, alínea a), da Diretiva 2014/65/UE, de uma licença de emissão ou de uma unidade num organismo de investimento coletivo, o mercado mais relevante em termos de liquidez desse instrumento financeiro (o mercado mais relevante) é determinado uma vez por ano civil com base nos dados do ano civil anterior, desde que o instrumento financeiro se encontrasse admitido à negociação ou fosse negociado no início do ano civil anterior, do seguinte modo:

a) No caso de instrumentos admitidos à negociação num ou mais mercados regulamentados, o mercado mais relevante será o mercado regulamentado no qual o volume de negócios, na aceção do artigo 17.º, n.º 4, do Regulamento Delegado (UE) 2017/587 da Comissão ([1]), relativo ao ano civil anterior e para esse instrumento, é mais elevado;

b) No caso dos instrumentos não admitidos à negociação em mercados regulamentados, o mercado mais relevante será o MTF no qual o volume de negócios, relativo ao ano civil anterior e para esse instrumento, é mais elevado;

c) Para efeitos das alíneas a) e b), o volume de negócios mais elevado é calculado excluindo todas as transações que beneficiam de dispensas da obrigação de transparência pré-negociação por força do artigo 4.º, n.º 1, alíneas a), b) ou c), do Regulamento (UE) n.º 600/2014.

([1]) Regulamento Delegado (UE) 2017/587 da Comissão, de 14 de julho de 2016, que complementa o Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho relativo aos mercados de instrumentos financeiros no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação relativas aos requisitos de transparência aplicáveis às plataformas de negociação e às empresas de investimento relativamente a ações, certificados de depósito, fundos de índices cotados, certificados e outros instrumentos financeiros similares e às obrigações de execução das transações de certas ações numa plataforma de negociação ou por um internalizador sistemático (ver página 387 do presente Jornal Oficial).

2. Em derrogação do n.º 1 do presente artigo, se um valor mobiliário na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 44, alínea a), da Diretiva 2014/65/UE, uma licença de emissão ou uma unidade num organismo de investimento coletivo não estava admitido à negociação ou não tinha sido negociado no início do ano civil anterior ou se os dados forem insuficientes ou inexistentes para calcular o volume de negócios ou para calcular o volume de negócios em conformidade com o n.º 1, alínea c), do presente artigo para efeitos de determinação do mercado mais relevante desse instrumento financeiro, o mercado mais relevante para o instrumento financeiro será o mercado do Estado-Membro onde um pedido de admissão à negociação tiver sido apresentado pela primeira vez ou onde o instrumento tiver sido negociado pela primeira vez.

3. No caso de um valor mobiliário na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 44, alínea b), da Diretiva 2014/65/UE ou de um instrumento do mercado monetário cujo emitente esteja estabelecido na União, o mercado mais relevante será o mercado do Estado-Membro onde está situada a sede social do emitente.

4. No caso de um valor mobiliário na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 44, alínea b), da Diretiva 2014/65/UE ou de um instrumento do mercado monetário cujo emitente esteja estabelecido fora da União, o mercado mais relevante será o mercado do Estado-Membro onde o pedido de admissão à negociação do referido instrumento financeiro tiver sido apresentado pela primeira vez ou onde o instrumento financeiro tiver sido negociado pela primeira vez numa plataforma de negociação.

5. No caso de um instrumento financeiro que seja um contrato de derivados ou um contrato sobre diferenças ou um valor mobiliário na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 44, alínea c), da Diretiva 2014/65/UE, o mercado mais relevante será determinado do seguinte modo:

a) Se o subjacente do instrumento financeiro for um valor mobiliário na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 44, alínea a), da Diretiva 2014/65/UE ou uma licença de emissão admitida à negociação num mercado regulamentado ou negociado num MTF, o mercado mais relevante será o mercado considerado o mercado mais relevante para o título subjacente em conformidade com o n.º 1 ou 2 do presente artigo;

b) Se o subjacente de um instrumento financeiro for um valor mobiliário na aceção do artigo 4.º, n.º 1, ponto 44, alínea b), da Diretiva 2014/65/UE ou um instrumento do mercado monetário admitido à negociação num mercado regulamentado ou negociado num MTF ou num OTF, o mercado mais relevante será o mercado considerado o mercado mais relevante para o instrumento financeiro subjacente em conformidade com o n.º 3 ou 4 do presente artigo;

c) Se o subjacente de um instrumento financeiro for um cabaz que contenha instrumentos financeiros, o mercado mais relevante será o mercado do Estado-Membro no qual o instrumento financeiro tiver sido admitido pela primeira vez à negociação ou negociado pela primeira vez numa plataforma de negociação;

d) Se o subjacente de um instrumento financeiro for um índice que contenha instrumentos financeiros, o mercado mais relevante é o mercado do Estado-Membro no qual o instrumento financeiro tiver sido admitido pela primeira vez à negociação ou negociado pela primeira vez numa plataforma de negociação;

e) Se o subjacente do instrumento financeiro for um derivado admitido à negociação ou negociado numa plataforma de negociação, o mercado mais relevante será o mercado do Estado-Membro no qual esse derivado está admitido à negociação ou é negociado numa plataforma de negociação.

6. Para os instrumentos financeiros não abrangidos pelos n.ºs 1 a 5, o mercado mais relevante será o mercado do Estado-Membro da plataforma de negociação que admitiu pela primeira vez esse instrumento financeiro à negociação ou no qual esse instrumento financeiro foi negociado pela primeira vez.

Artigo 17.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 3 de janeiro de 2018.

Contudo, o segundo parágrafo do artigo 2.º, n.º 5, é aplicável 12 meses após a data de entrada em vigor do ato delegado adotado pela Comissão em aplicação do artigo 4.º, n.º 9, do Regulamento (UE) 2015/2365.

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

Feito em Bruxelas, em 28 de julho de 2016.

Pela Comissão

O Presidente

Jean-Claude JUNCKER

ANEXO I

Quadro 1

Legenda do Quadro 2

SÍMBOLO	TIPO DE DADOS	DEFINIÇÃO
{ALPHANUM-n}	Até n carateres alfanuméricos	Campo de texto livre.
{CFI_CODE}	6 carateres	Código ISO 10962 CFI
{COUNTRYCODE_2}	2 carateres alfanuméricos	Código de país de duas letras, conforme definido pela norma ISO 3166-1 alfa-2
{CURRENCYCODE_3}	3 carateres alfanuméricos	Código de divisa de 3 letras, conforme definido pela norma ISO 4217
{DATE_TIME_FORMAT}	Formato de data e hora da norma ISO 8601	Data e hora, no seguinte formato: AAAA-MM-DDThh:mm:ss.dddddd Z. — «YYYY» é o ano; — «MM» é o mês; — «DD» é dia; — «T» — significa que tem de ser utilizada a letra «T»; — «hh» é a hora; — «mm» são os minutos; — «ss.dddddd» são os segundos e frações de segundo; — Z é a hora UTC. As datas e as horas devem ser comunicadas em UTC.
{DATEFORMAT}	Formato de data de acordo com a norma ISO 8601	As datas devem estar formatadas do seguinte modo: AAAA-MM-DD.
{DECIMAL-n/m}	Número decimal até um total de n dígitos, dos quais até m dígitos podem ser fracionários	Campo numérico para valores positivos e negativos. — O separador decimal é «.» (ponto); — os números negativos são prefixados com «–» (sinal negativo); Os valores são arredondados e não são truncados.
{INDEX}	4 carateres 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» — Tesouro «SWAP» — SWAP «FUSW» — Futuro SWAP
{INTEGER-n}	Número inteiro até um total de n dígitos	Campo numérico para valores inteiros positivos e negativos.
{ISIN}	12 carateres alfanuméricos	Código ISIN, tal como definido na norma ISO 6166
{LEI}	20 carateres alfanuméricos	Identificador de entidade jurídica, tal como definido na norma ISO 17442
{MIC}	4 carateres alfanuméricos	Identificador do mercado, tal como definido na norma ISO 10383
{NATIONAL_ID}	35 carateres alfanuméricos	O identificador é determinado em conformidade com o artigo 6.º e com o quadro do anexo II.

Quadro 2

Informações a incluir nas comunicações de transações

Todos os campos são obrigatórios, salvo indicação em contrário.

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
1	Estado da comunicação	Indicação sobre se a comunicação de transação é nova ou é um cancelamento.	«NEWT» — Nova «CANC» — Cancelamento
2	Número de referência da transação	Número de identificação que é único para a empresa que executa a transação, para cada comunicação de transação. Se, por força do artigo 26.º, n.º 5, do Regulamento (UE) n.º 600/2014, uma plataforma de negociação apresentar uma comunicação de transação em nome de uma empresa que não se encontre sujeita ao Regulamento (UE) n.º 600/2014, a plataforma de negociação preenche este campo com um número que foi gerado internamente pela plataforma de negociação e que é único para cada comunicação de transação apresentada pela plataforma de negociação.	{ALPHANUM-52}
3	Código de identificação da transação da plataforma de negociação	Trata-se de um número gerado pelas plataformas de negociação e divulgado às partes que compram e vendem em conformidade com o artigo 12.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/580 da Comissão ([1]). Este campo só é obrigatório para o lado do mercado de uma transação executada numa plataforma de negociação.	{ALPHANUM-52}

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
4	Código de identificação da entidade executora	Código utilizado para identificar a entidade que executa a transação.	{LEI}
5	Empresa de investimento abrangida pela Diretiva 2014/65/UE	Indica se a entidade identificada no campo 4 é uma empresa de investimento abrangida pelo artigo 4.º, n.º 1, da Diretiva 2014/65/UE.	«true» — sim «false» — não
6	Código de identificação da entidade que apresenta a comunicação	Código utilizado para identificar a entidade que apresenta as comunicações de transações à autoridade competente em conformidade com o artigo 26.º, n.º 7, do Regulamento (UE) n.º 600/2014. Se a comunicação for apresentada pela empresa executora diretamente à autoridade competente, deve ser preenchida com o LEI da empresa executora (se a empresa executora for uma entidade jurídica). Se a comunicação for apresentada por uma plataforma de negociação, deve ser preenchida com o LEI do operador da plataforma de negociação. Se a comunicação for apresentada por um ARM, deve ser preenchida com o LEI do ARM.	{LEI}

Dados do comprador

— No caso de contas conjuntas, os campos 7 a 11 devem ser repetidos para cada comprador.

— Se a transação se referir a uma ordem transmitida que preencha as condições para transmissão estabelecidas no artigo 4.º, as informações dos campos 7 a 15 devem ser preenchidas pela empresa recetora na comunicação da empresa recetora com as informações recebidas da empresa transmissora.

— Se a transmissão se referir a uma ordem transmitida que não preencha as condições de transmissão estabelecidas no artigo 4.º, a empresa recetora deve tratar a empresa transmissora como o comprador.

7	Código de identificação do comprador	Código utilizado para identificar o adquirente do instrumento financeiro. Se o adquirente for uma entidade jurídica, deve ser utilizado o código LEI do adquirente. Se o adquirente não for uma entidade jurídica, deve ser utilizado o identificador especificado no artigo 6.º. Se a transação tiver sido executada numa plataforma de negociação ou numa plataforma de negociação organizada fora da União que recorra a uma contraparte central (CCP) e se a identidade do adquirente não for divulgada, deve ser utilizado o código LEI da CCP. Se a transação tiver sido executada numa plataforma de negociação ou numa plataforma de negociação organizada fora da União que não recorra a uma contraparte central (CCP) e se a identidade do adquirente não for divulgada, deve ser utilizado o código MIC da plataforma de negociação ou da plataforma de negociação organizada fora da União. Se o adquirente for uma empresa de investimento que atue como internalizador sistemático (SI), deve ser utilizado o código LEI do SI. «INTC» é utilizado para designar a conta agregada do cliente na empresa de investimento, a fim de comunicar uma transferência de ou para essa conta com uma atribuição associada a cada cliente de e para essa conta, respetivamente.	{LEI} {MIC} {NATIONAL_ID} «INTC»

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
		No caso de opções e opções sobre *swaps*, o comprador é a contraparte que detém o direito de exercer a opção e o vendedor é a contraparte que vende a opção e recebe um prémio. No caso de futuros e contratos a prazo que não sejam relacionados com divisas, o comprador é a contraparte que compra o instrumento e o vendedor é a contraparte que vende o instrumento. No caso de *swaps* relacionados com valores mobiliários, o comprador é a contraparte que conserva o risco de movimento de preço do valor mobiliário subjacente e recebe o montante do valor mobiliário. O vendedor é a contraparte que paga o montante do valor mobiliário. No caso de *swaps* relacionados com taxas de juro ou índices de inflação, o comprador é a contraparte que paga a taxa fixa. O vendedor é a contraparte que recebe a taxa fixa. No caso de *swaps* de base (*swaps* de taxas de juro a taxa variável contra taxa variável), o comprador é a contraparte que paga o diferencial e o vendedor é a contraparte que recebe o diferencial. No caso de *swaps* e contratos a prazo relacionados com divisas e de *swaps* cambiais, o comprador é a contraparte que recebe a divisa que for a primeira por ordem alfabética de acordo com a norma ISO 4217 e o vendedor é a contraparte que entrega esta divisa. No caso de *swaps* relacionados com dividendos, o comprador é a contraparte que recebe os pagamentos dos dividendos efetivos equivalentes. O vendedor é a contraparte que paga os dividendos e recebe a taxa fixa. No caso de instrumentos derivados para transferência de risco de crédito, exceto opções e *swaps* sobre opções, o comprador é a contraparte que compra a proteção. O vendedor é a contraparte que vende a proteção. No caso de contratos de derivados relacionados com mercadorias, o comprador é a contraparte que recebe a mercadoria especificada na comunicação e o vendedor é a contraparte que entrega essa mercadoria. No caso de contratos a prazo sobre taxas de juro, o comprador é a contraparte que paga a taxa fixa e o vendedor é a contraparte que recebe a taxa fixa. No caso de um aumento do nocional, o comprador é o mesmo que o adquirente do instrumento financeiro na transação original e o vendedor é o mesmo que a parte que procede à alienação do instrumento financeiro na transação original. No caso de uma diminuição do nocional, o comprador é o mesmo que a parte que procede à alienação do instrumento financeiro na transação original e o vendedor é o mesmo que o adquirente do instrumento financeiro na transação original.	

Informações adicionais

— Os campos 8 a 15 só são aplicáveis se o comprador for um cliente

— Os campos 9 a 11 só são aplicáveis se o comprador for uma pessoa singular

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
8	País da sucursal para o comprador	Se o adquirente for um cliente, este campo deve identificar o país da sucursal que recebeu a ordem do cliente ou que tomou uma decisão de investimento em nome de um cliente em conformidade com um mandato discricionário que lhe foi conferido pelo cliente como exigido pelo artigo 14.º, n.º 3. Caso esta atividade não tenha sido realizada por uma sucursal, este campo deve ser preenchido com o código de país do Estado-Membro de origem da empresa de investimento ou com o código de país do país onde a empresa de investimento estabeleceu a sua sede ou sede social (no caso de empresas de países terceiros). Se a transação se referir a uma ordem transmitida que preencha as condições de transmissão estabelecidas no artigo 4.º, este campo devem ser preenchido com as informações recebidas da empresa transmissora.	{COUNTRYCODE_2}
9	Comprador — nome(s) próprio(s)	Nome próprio completo do comprador. No caso de haver mais do que um nome próprio, todos os nomes devem ser incluídos neste campo, separados por uma vírgula.	{ALPHANUM-140}
10	Comprador — apelido(s)	Apelido completo do comprador. No caso de haver mais do que um apelido, devem ser incluídos neste campo todos os apelidos, separados por uma vírgula.	{ALPHANUM-140}
11	Comprador — data de nascimento	Data de nascimento do comprador	{DATEFORMAT}
	Decisor do comprador		
	— Os campos 12 a 15 só são aplicáveis se o decisor agir ao abrigo de poderes de representação		
12	Código do decisor do comprador	Código utilizado para identificar a pessoa que toma a decisão de adquirir o instrumento financeiro. Se a decisão for tomada por uma empresa de investimento, este campo deve ser preenchido com a identidade da empresa de investimento e não com a identidade da pessoa que toma a decisão de investimento. Se o decisor for uma entidade jurídica, deve ser utilizado o código LEI do decisor. Se o decisor não for uma entidade jurídica, deve ser utilizado o identificador especificado no artigo 6.º.	{LEI} {NATIONAL_ID}
	Dados do decisor do comprador		
	— Os campos 13 a 15 só são aplicáveis se o decisor for uma pessoa singular		
13	Decisor de compra — nome(s) próprio(s)	Nome próprio completo do decisor do comprador. No caso de haver mais do que um nome próprio, todos os nomes devem ser incluídos neste campo, separados por uma vírgula	{ALPHANUM-140}
14	Decisor de compra — apelido(s)	Apelido completo do decisor do comprador. No caso de haver mais do que um apelido, devem ser incluídos neste campo todos os apelidos, separados por uma vírgula.	{ALPHANUM-140}

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
15	Decisor de compra — Data de nascimento	Data de nascimento do decisor do comprador	{DATEFORMAT}

Dados do vendedor e do decisor

— No caso de contas conjuntas, os campos 16 a 20 devem ser repetidos para cada vendedor.

— Se a transação para um vendedor se referir a uma ordem transmitida que preenche as condições de transmissão estabelecidas no artigo 4.º, as informações dos campos 16 a 24 devem ser preenchidas pelas empresa recetora na comunicação da empresa recetora a partir das informações recebidas da empresa transmissora.

— Se a transmissão se referir a uma ordem transmitida que não preenche as condições de transmissão estabelecidas no artigo 4.º, a empresa recetora deve tratar a empresa transmissora como o vendedor.

16	Código de identificação do vendedor	Código utilizado para identificar a parte que procede à alienação do instrumento financeiro. Se a parte que procede à alienação for uma entidade jurídica, deve ser utilizado o código LEI da parte que procede à alienação. Se a parte que procede à alienação não for uma entidade jurídica, deve ser utilizado o identificador especificado no artigo 6.º. Se a transação tiver sido executada numa plataforma de negociação ou numa plataforma de negociação organizada fora da União que recorra a uma CCP e se a identidade da parte que procede à alienação não for divulgada, deve ser utilizado o código LEI da CCP. Se a transação tiver sido executada numa plataforma de negociação ou numa plataforma de negociação organizada fora da União que não recorra a uma CCP e se a identidade da parte que procede à alienação não for divulgada, deve ser utilizado o código MIC da plataforma de negociação ou da plataforma de negociação organizada fora da União. Se a parte que procede à alienação for uma empresa de investimento que atue como um SI, deve ser utilizado o código LEI do SI «INTC» é utilizado para designar a conta agregada do cliente na empresa de investimento, a fim de comunicar uma transferência de ou para essa conta com uma atribuição associada a cada cliente de e para essa conta, respetivamente. No caso de opções e opções sobre *swaps*, o comprador é a contraparte que detém o direito de exercer a opção e o vendedor é a contraparte que vende a opção e recebe um prémio. No caso de futuros e contratos a prazo que não sejam relacionados com divisas, o comprador é a contraparte que compra o instrumento e o vendedor é a contraparte que vende o instrumento.	{LEI} {MIC} {NATIONAL_ID} «INTC»

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
		No caso de *swaps* relacionados com valores mobiliários, o comprador é a contraparte que conserva o risco de movimento de preço do valor mobiliário subjacente e recebe o montante do valor mobiliário. O vendedor é a contraparte que paga o montante do valor mobiliário. No caso de *swaps* relacionados com taxas de juro ou índices de inflação, o comprador é a contraparte que paga a taxa fixa. O vendedor é a contraparte que recebe a taxa fixa. No caso de *swaps* de base (*swaps* de taxas de juro a taxa variável contra taxa variável), o comprador é a contraparte que paga o diferencial e o vendedor é a contraparte que recebe o diferencial. No caso de *swaps* e contratos a prazo relacionados com divisas e de *swaps* cambiais, o comprador é a contraparte que recebe a divisa que for a primeira por ordem alfabética de acordo com a norma ISO 4217 e o vendedor é a contraparte que entrega esta divisa. No caso de *swaps* relacionados com dividendos, o comprador é a contraparte que recebe os pagamentos dos dividendos efetivos equivalentes. O vendedor é a contraparte que paga os dividendos e recebe a taxa fixa. No caso de instrumentos derivados para transferência de risco de crédito, exceto opções e *swaps* sobre opções, o comprador é a contraparte que compra a proteção. O vendedor é a contraparte que vende a proteção. No caso de contratos de derivados relacionados com mercadorias, o comprador é a contraparte que recebe a mercadoria especificada na comunicação e o vendedor é a contraparte que entrega essa mercadoria. No caso de contratos a prazo sobre taxas de juro, o comprador é a contraparte que paga a taxa fixa e o vendedor é a contraparte que recebe a taxa fixa. No caso de um aumento do nocional, o vendedor é o mesmo que a parte que procede à alienação na transação original. No caso de uma diminuição do nocional, o vendedor é o mesmo que o adquirente do instrumento financeiro na transação original.	
17-24	**Os campos 17 a 24 refletem todos os campos relacionados com o comprador, numerados de 8 a 15 (Dados do comprador e do decisor) para o vendedor.**		

Dados de transmissão

— Os campos 26 e 27 só devem ser preenchidos para comunicações de transações realizadas por uma empresa recetora se estiverem preenchidas todas as condições de transmissão estabelecidas no artigo 4.º.

— Se uma empresa agir como empresa recetora e como empresa transmissora, deve preencher o campo 25 de modo a indicar que é uma empresa transmissora e deve preencher os campos 26 e 27 da sua perspetiva como empresa recetora.

25	Transmissão do indicador da ordem	«true» deve ser preenchido pela empresa transmissora na comunicação da empresa transmissora se não estiverem preenchidas as condições de transmissão especificadas no artigo 4.º «false» — em quaisquer outras circunstâncias	«true» «false»
26	Código de identificação da empresa transmissora para o comprador	Código utilizado para identificar a empresa que transmite a ordem Este campo deve ser preenchido pela empresa recetora na comunicação da empresa recetora com o código de identificação fornecido pela empresa transmissora.	{LEI}

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
27	Código de identificação da empresa transmissora para o vendedor	Código utilizado para identificar a empresa que transmite a ordem. Este campo deve ser preenchido pela empresa recetora na comunicação da empresa recetora com o código de identificação fornecido pela empresa transmissora	{LEI}
Dados da transação			
28	Data e hora de negociação	Data e hora em que a transação foi executada. No caso de transações executadas numa plataforma de negociação, o nível de pormenor deve estar em conformidade com os requisitos estabelecidos no artigo 3.º do Regulamento Delegado (UE) 2017/574 da Comissão ([2]). No caso de transações não executadas numa plataforma de negociação, a data e hora devem corresponder ao momento em que as partes chegam a acordo sobre o conteúdo dos seguintes campos: quantidade, preço, divisas nos campos 31, 34 e 44, código de identificação do instrumento, classificação do instrumento e código do instrumento subjacente, quando aplicável. No caso de transações não executadas numa plataforma de negociação, a hora comunicada deve ser arredondada pelo menos ao segundo mais próximo. Se a transação resultar de uma ordem transmitida pela empresa que executa a transação em nome de um cliente a um terceiro, caso não estejam preenchidas as condições de transmissão especificadas no artigo 4.º, este campo deve corresponder à data e hora da transação e não à hora da transmissão da ordem.	{DATE_TIME_FORMAT}
29	Qualidade em que atua o interveniente na negociação	Indicação sobre se a transação resulta de transações simultâneas por conta própria nos termos do artigo 4.º, n.º 1, ponto 38, da Diretiva 2014/65/UE ou de negociação por conta própria nos termos do artigo 4.º, n.º 1, ponto 6, da Diretiva 2014/65/UE por parte da empresa executora. Se a transação não resultar de transações simultâneas por conta própria ou de negociação por conta própria por parte da empresa executora, o campo deve indicar que a transação foi realizada em qualquer outra qualidade.	«DEAL» — Negociação por conta própria «MTCH» — Transações simultâneas por conta própria «AOTC» — Qualquer outra qualidade
30	Quantidade	O número de unidades do instrumento financeiro ou o número de contratos de derivados na transação. O valor nominal ou monetário do instrumento financeiro. No caso das margens financeiras definidas (*spread bets*), a quantidade corresponde ao valor monetário calculado por movimento ponto a ponto no instrumento financeiro subjacente. No caso dos *swaps* de risco de incumprimento, a quantidade deve corresponder ao montante nocional pelo qual a proteção é adquirida ou alienada. No caso de aumentos ou diminuições no valor nocional de contratos de derivados, o número deve refletir o valor absoluto da alteração e deve ser expresso como um número positivo. As informações comunicadas neste campo devem ser coerentes com os valores indicados nos campos 33 e 46.	{DECIMAL-18/17} caso a quantidade seja expressa em número de unidades {DECIMAL-18/5} caso a quantidade seja expressa em valor monetário ou nominal

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
31	Divisa da quantidade	A divisa em que é expressa a quantidade. Apenas se aplica se a quantidade for expressa em valor nominal ou monetário.	{CURRENCYCODE_3}
32	Aumento/diminuição do valor nocional de derivados	Indicação sobre se a transação corresponde a um aumento ou uma diminuição do valor nocional de um contrato de derivados. O campo só é aplicável se existir uma alteração no valor nocional de um contrato de derivados.	«INCR» — Aumento «DECR» — Diminuição
33	Preço	O preço negociado da transação, deduzido, quando aplicável, das comissões e juros vencidos. No caso de contratos de opção, deve ser o prémio do contrato de derivados por subjacente ou ponto índice. No caso das *spread bets*, deve ser o preço de referência do instrumento subjacente. No caso dos *swaps* de risco de incumprimento, deve ser o cupão em pontos base. Caso o preço seja expresso em valor monetário, deve ser indicado na unidade monetária principal. Quando o preço ainda não estiver disponível, o valor a indicar deve ser «PNDG» (pendente) Se o preço não for aplicável, o valor a indicar deve ser «NOAP» As informações comunicadas neste campo devem ser coerentes com os valores indicados nos campos 30 e 46.	{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 base «PNDG» caso o preço não esteja disponível «NOAP» caso o preço não seja aplicável
34	Divisa do preço	Divisa em que é expresso o preço (aplicável se o preço for expresso em valor monetário).	{CURRENCYCODE_3}
35	Montante líquido	Por montante líquido da transação entende-se o montante em numerário que é pago pelo comprador do instrumento de dívida no momento da liquidação da transação. Este montante em numerário é igual a: (preço limpo * valor nominal) + quaisquer cupões vencidos. Consequentemente, o montante líquido da transação exclui qualquer comissão ou outros encargos cobrados ao comprador do instrumento de dívida. O campo só se aplica quando o instrumento financeiro for de dívida.	{DECIMAL-18/5}
36	Plataforma	Identificação da plataforma onde a transação foi executada. Utilizar o segmento MIC da norma ISO 10383 para transações executadas numa plataforma de negociação, internalizador sistemático (SI) ou plataforma de negociação organizada fora da União. Se o segmento MIC não existir, utilizar o MIC operacional. Utilizar o código MIC «XOFF» para instrumentos financeiros admitidos à negociação ou negociados numa plataforma de negociação ou para os quais tenha sido apresentado um pedido de admissão, se a transação nesse instrumento financeiro não for executada numa plataforma de negociação, SI ou plataforma de negociação organizada fora da União, ou quando a empresa de investimento não tiver conhecimento de que está a negociar com uma outra empresa de investimento que atua na qualidade de SI.	{MIC}

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
		Utilizar o código MIC «XXXX» para instrumentos financeiros que não estão admitidos à negociação nem são negociados numa plataforma de negociação ou para os quais não tenha sido apresentado um pedido de admissão e que não são negociados numa plataforma de negociação organizada fora da União, mas cujo subjacente está admitido à negociação ou é negociado numa plataforma de negociação.	
37	País no qual a sucursal é membro de um mercado	Código utilizado para identificar o país no qual a qualidade de membro do mercado de uma sucursal da empresa de investimento foi utilizada para executar a transação. Se a qualidade de membro do mercado de uma sucursal não tiver sido utilizada, este campo deve ser preenchido com o código de país do Estado-Membro de origem da empresa de investimento ou com o código do país onde a empresa de investimento estabeleceu a sua sede ou sede social (no caso de empresas de países terceiros). Este campo só deve ser preenchido para a vertente de mercado de uma transação executada numa plataforma de negociação ou numa plataforma de negociação organizada fora da União.	{COUNTRYCODE_2}
38	Pagamento inicial	Valor monetário de qualquer pagamento inicial recebido ou pago pelo vendedor. Se o vendedor receber o pagamento inicial, o valor a preencher será positivo. Se o vendedor efetuar o pagamento inicial, o valor a preencher será negativo.	{DECIMAL-18/5}
39	Divisa do pagamento inicial	A divisa do pagamento inicial.	{CURRENCYCODE_3}
40	ID da componente de negociação complexa	Identificador interno da empresa que apresenta a comunicação para identificar todas as comunicações relacionadas com uma mesma execução para uma combinação de instrumentos financeiros em conformidade com o artigo 12.º. O código tem de ser único ao nível da empresa para o grupo de comunicações relativas à execução. O campo só se aplica quando forem aplicáveis as condições especificadas no artigo 12.º.	{ALPHANUM-35}

Dados do instrumento

41	Código de identificação do instrumento	Código utilizado para identificar o instrumento financeiro Este campo aplica-se a instrumentos financeiros que tenham sido objeto de um pedido de admissão à negociação, estejam admitidos à negociação ou sejam negociados numa plataforma de negociação ou num internalizador sistemático. É igualmente aplicável a instrumentos financeiros que possuem um ISIN e que são negociados numa plataforma de negociação organizada fora da União se o subjacente for um instrumento financeiro negociado numa plataforma de negociação.	{ISIN}

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
Os campos 42 a 56 não são aplicáveis quando: **as transações forem executadas numa plataforma de negociação ou com uma empresa de investimento que atue na qualidade de SI; ou** **o campo 41 for preenchido com um ISIN que consta da lista de dados de referência da ESMA**			
42	Nome completo do instrumento	Nome completo do instrumento financeiro	{ALPHANUM-350}
43	Classificação do instrumento	Taxonomia utilizada para classificar o instrumento financeiro Deverá ser fornecido um código CFI completo e exato.	{CFI_CODE}
44	Divisa nocional 1	Divisa em que o nocional está denominado. No caso de um contrato derivado de taxas de juro ou cambial, trata-se da divisa nocional da componente 1 ou da divisa 1 do par. No caso de opções sobre *swaps* em que o *swap* subjacente é denominado numa única divisa, esta será a divisa nocional do *swap* subjacente. Para opções sobre *swaps* em que o *swap* subjacente é denominado em várias divisas, trata-se da divisa nocional da componente 1 do *swap*.	{CURRENCYCODE_3}
45	Divisa nocional 2	No caso de *swaps* cruzados ou em várias divisas, a divisa em que é denominada a componente 2 do contrato. Para opções sobre *swaps* em que o *swap* subjacente é denominado em várias divisas, a divisa em que é denominada a componente 2 do *swap*.	{CURRENCYCODE_3}
46	Multiplicador de preço	Número de unidades do instrumento subjacente representadas por um único contrato de derivados. O valor monetário abrangido por um único contrato de *swap* se o campo de quantidade indicar o número de contratos de *swap* na transação. Para um futuro ou opção sobre um índice, indicar o montante por ponto do índice. Para as *spread bets*, indicar a flutuação do preço do instrumento subjacente em que se baseia a *spread bet*. As informações comunicadas neste campo devem ser coerentes com os valores indicados nos campos 30 e 33.	{DECIMAL-18/17}
47	Código do instrumento subjacente	Código ISIN do instrumento subjacente. Para os ADR, GDR e instrumentos similares, 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 derivados ou outros instrumentos que possuem um subjacente, indicar o código ISIN do instrumento subjacente, se este estiver admitido à negociação ou for negociado numa plataforma de negociação. Se o subjacente for um dividendo de ações, indicar o código ISIN da ação relacionada que confere direito ao dividendo subjacente.	{ISIN}

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
		Para os *swaps* de risco de incumprimento, indicar o código ISIN da obrigação de referência. Se o subjacente for um índice e tiver um ISIN, indicar o código ISIN desse índice. Se o subjacente for um cabaz, incluir o ISIN de cada constituinte do cabaz que esteja admitido à negociação ou seja negociado numa plataforma de negociação. O campo 47 deve ser comunicado tantas vezes quanto necessário para enumerar todos os instrumentos de comunicação obrigatória no cabaz.	
48	Nome do índice subjacente	Se o subjacente for um índice, indicar o nome do índice.	{INDEX} Ou {ALPHANUM-25} — se o nome do índice não estiver incluído na lista {INDEX}
49	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
50	Tipo de opção	Indicação sobre se o contrato de derivados é uma opção de compra (direito a adquirir um ativo subjacente específico) ou uma opção de venda (direito a vender um ativo subjacente específico) ou se é impossível determinar se se trata de uma opção de compra ou de venda no momento da execução. No caso das opções sobre *swaps*, trata-se de: — «PUTO», no caso de uma opção sobre *swaps* a receber, em que o comprador tem o direito de celebrar um contrato de *swap* enquanto beneficiário a taxa fixa. — «Call» no caso de uma opção sobre *swaps* a pagar, em que o comprador tem o direito de celebrar um contrato de *swap* enquanto pagador a taxa fixa. Caso existam limites máximos e mínimos, trata-se de: — «PUTO», no caso de um limite mínimo. — «Call», no caso de um limite máximo. Este campo só se aplica a derivados que sejam opções ou *warrants*.	«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
51	Preço de exercício	Preço predeterminado ao qual o titular terá de comprar ou vender o instrumento subjacente, ou uma indicação de que o preço não pode ser determinado no momento da execução. O campo só se aplica a uma opção ou *warrant* cujo preço de exercício possa ser determinado no momento da execução. Quando o preço ainda não estiver disponível, o valor a indicar deve ser «PNDG» (pendente) Quando não for aplicável um preço de exercício, o campo não deve ser preenchido.	{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 base «PNDG» caso o preço não esteja disponível

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
52	Divisa do preço de exercício	A divisa do preço de exercício.	{CURRENCYCODE_3}
53	Modalidade de exercício da opção	Indicação sobre se a opção pode ser exercida apenas numa data fixa (modalidade europeia e asiática), em diferentes datas predeterminadas (modalidade bermudense) ou a qualquer momento durante o período de vigência do contrato (modalidade americana). O campo só é aplicável a opções, *warrants* e certificados de direitos.	«EURO» — Europeia «AMER» — Americana «ASIA» — Asiática «BERM» — Bermudense «OTHR» — Qualquer outro tipo
54	Data de vencimento	A data de vencimento do instrumento financeiro O campo só se aplica a instrumentos de dívida com prazo de vencimento definido.	{DATEFORMAT}
55	Data de expiração	A data de expiração do instrumento financeiro. O campo só é aplicável a instrumentos derivados com uma data de expiração definida.	{DATEFORMAT}
56	Modalidade de entrega	Indicação sobre se a transação é liquidada mediante entrega física ou pagamento em numerário. Quando não for possível determinar a modalidade de entrega no momento da execução, o valor a indicar deve ser «OPTL». O campo só é aplicável a derivados.	«PHYS» — Liquidado mediante entrega física «CASH» — Liquidado em numerário «OPTN» — Opcional para a contraparte ou conforme determinado por um terceiro
Operador, algoritmos, dispensas e indicadores			
57	Decisão de investimento no âmbito da empresa	Código utilizado para identificar a pessoa ou o algoritmo da empresa de investimento responsável pela decisão de investimento. No caso de pessoas singulares, deve ser utilizado o identificador especificado no artigo 6.º. Se a decisão de investimento foi tomada por meio de um algoritmo, o campo deve ser preenchido tal como previsto no artigo 8.º. O campo só se aplica a uma decisão de investimento tomada na empresa. Se a transação se referir a uma ordem transmitida que preencheu as condições de transmissão estabelecidas no artigo 4.º, este campo deve ser preenchido pela empresa recetora na comunicação da empresa recetora utilizando as informações recebidas da empresa transmissora.	{NATIONAL_ID} — Pessoas singulares {ALPHANUM-50} — Algoritmos
58	País da sucursal que supervisiona a pessoa responsável pela decisão de investimento	Código utilizado para identificar o país da sucursal da empresa de investimento para a pessoa responsável pela decisão de investimento, tal como estabelecido no artigo 14.º, n.º 3, alínea b). Se a pessoa responsável pela decisão de investimento não tiver sido supervisionada por uma sucursal, este campo deve ser preenchido com o código de país do Estado-Membro de origem da empresa de investimento ou com o código do país onde a empresa estabeleceu a sua sede ou sede social (no caso de empresas de países terceiros).	{COUNTRYCODE_2}

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
		Se a transação se referir a uma ordem transmitida que preencheu as condições de transmissão estabelecidas no artigo 4.º, este campo deve ser preenchido pela empresa recetora na comunicação da empresa recetora utilizando as informações recebidas da empresa transmissora. Este campo não é aplicável quando a decisão de investimento tiver sido tomada por um algoritmo	
59	Execução no âmbito da empresa	Código utilizado para identificar a pessoa ou o algoritmo da empresa de investimento responsável pela execução. No caso das pessoas singulares, deve ser utilizado o identificador especificado no artigo 6.º. Se a execução foi efetuada por meio de um algoritmo, o campo deve ser preenchido tal como previsto no artigo 9.º.	{NATIONAL_ID} — Pessoas singulares {ALPHANUM-50} — Algoritmos
60	País da sucursal que supervisiona a pessoa responsável pela execução	Código utilizado para identificar o país da sucursal da empresa de investimento para a pessoa responsável pela execução da transação, tal como estabelecido no artigo 14.º, n.º 3, alínea c). Se a pessoa responsável não tiver sido supervisionada por uma sucursal, este campo deve ser preenchido com o código de país do Estado-Membro de origem da empresa de investimento, ou com o código do país onde a empresa estabeleceu a sua sede ou sede social (no caso de empresas de países terceiros). Este campo não é aplicável quando a execução tiver sido efetuada por meio de um algoritmo	{COUNTRYCODE_2}
61	Indicador de dispensa	Indicação sobre se a transação foi executada ao abrigo de uma dispensa pré-negociação em conformidade com os artigos 4.º e 9.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014. Para instrumentos de capital: «RFPT» = Transação ao preço de referência «NLIQ» = Transações negociadas em instrumentos financeiros líquidos «OILQ» = Transações negociadas em instrumentos financeiros ilíquidos «PRIC» = Transações negociadas sujeitas a condições diferentes do preço corrente de mercado desse instrumento financeiro de capital. Para instrumentos não representativos de capital: «SIZE» = Transação acima do volume especificado «ILQD» = Transação de instrumentos ilíquidos Este campo só deve ser preenchido para a vertente de mercado de uma transação executada ao abrigo de uma dispensa numa plataforma de negociação.	Preencher uma ou mais das seguintes referências: «RFPT» — Preço de referência «NLIQ» — Negociada (líquido) «OILQ» — Negociada (ilíquido) «PRIC» — Negociada (condições) «SIZE» — Acima do volume especificado «ILQD» — Instrumento ilíquido
62	Indicador de venda a descoberto	Uma venda a descoberto celebrado por uma empresa de investimento em seu próprio nome ou em nome de um cliente, tal como descrito no artigo 11.º. Quando uma empresa de investimento executa uma transação em nome de um cliente que está a vender e não for possível à empresa de investimento, agindo na base do «melhor esforço», determinar se se trata de uma transação de venda a descoberto, este campo deve ser preenchido com «UNDI».	«SESH» — Venda a descoberto sem qualquer isenção «SSEX» — Venda a descoberto com isenção «SELL» — Nenhuma venda a descoberto «UNDI» — Informação não disponível

N	CAMPO	CONTEÚDO A COMUNICAR	FORMATOS E NORMAS A UTILIZAR NAS COMUNICAÇÕES
		Se a transação se referir a uma ordem transmitida que preenche as condições de transmissão estabelecidas no artigo 4.º do presente regulamento, este campo deve ser preenchido pela empresa recetora nas comunicações da empresa recetora utilizando as informações recebidas da empresa transmissora. Este campo só é aplicável quando o instrumento for abrangido pelo Regulamento (UE) n.º 236/2012 e o vendedor for a empresa de investimento ou um cliente da empresa de investimento.	
63	Indicador pós-negociação OTC	Indicador do tipo de transação em conformidade com o artigo 20.º, n.º 3, alínea a), e com o artigo 21.º, n.º 5, alínea a), do Regulamento (UE) n.º 600/2014. Para todos os instrumentos: «BENC» = Transações de referência «ACTX» = Transações cruzadas entre agentes «LRGS» = Transações com volume elevado pós-negociação «ILQD» = Transação de instrumentos ilíquidos «SIZE» = Transação acima do volume especificado «CANC» = Cancelamentos «AMND» = Alterações Para instrumentos de capital: «SDIV» = Transações de dividendos extraordinários «RPRI» = Transações que beneficiaram de melhoria dos preços «DUPL»= Comunicações de transações em duplicado «TNCP» = Transações que não contribuem para o processo de determinação de preços para efeitos do artigo 23.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014 Para instrumentos não representativos de capital: «TPAC» = Transação em pacote 'XFPH' = Transação de troca por produtos físicos	Preencher uma ou mais das seguintes referências: «BENC» — Referência «ACTX» — Cruzadas entre agentes «LRGS» — Volume elevado «ILQD» — Instrumento ilíquido «SIZE» — Acima do volume especificado «CANC» — Cancelamentos «AMND» — Alterações «SDIV» — Dividendo extraordinário «RPRI» — Melhoria dos preços «DUPL» — Duplicado «TNCP» — Não contribui para o processo de determinação dos preços «TPAC» — Pacote «XFPH» — Troca por produtos físicos
64	Indicador de derivado de mercadoria	Indicação sobre se a transação reduz o risco de uma forma objetivamente mensurável em conformidade com o artigo 57.º da Diretiva 2014/65/UE. Se a transação se referir a uma ordem transmitida que preenche as condições de transmissão estabelecidas no artigo 4.º, este campo deve ser preenchido pela empresa recetora nas comunicações da empresa recetora utilizando as informações recebidas da empresa transmissora. Este campo só é aplicável a transações de derivados de mercadorias.	«true» — sim «false» — não
65	Indicador de operações de financiamento através de valores mobiliários	Deve ser preenchido «true» se a transação se inserir no âmbito de atividade mas estiver dispensada de comunicação ao abrigo do Regulamento (UE) 2015/2365. Caso contrário, deve ser preenchido «false».	«true» — sim «false» — não

(1) Regulamento Delegado (UE) 2017/580 da Comissão, de 24 de junho de 2016, que complementa o Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho no que respeita às normas técnicas de regulamentação sobre a manutenção das informações relevantes sobre ordens relativas a instrumentos financeiros (ver página 193 do presente Jornal Oficial).

(2) Regulamento Delegado (UE) 2017/574 da Comissão, de 7 de junho de 2016, que complementa a Diretiva 2014/65/UE do Parlamento Europeu e do Conselho no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação relativas ao nível de precisão dos relógios profissionais (ver página 148 do presente Jornal Oficial).

ANEXO II

Identificadores de cliente nacionais para pessoas singulares a utilizar nas comunicações de transações

ISO 3166 — 1 alfa 2	Nome do país	Identificador de 1.ª prioridade	Identificador de 2.ª prioridade	Identificador de 3.ª prioridade
AT	Áustria	CONCAT		
BE	Bélgica	Número nacional belga (*Numéro de registre national — Rijksregisternummer*)	CONCAT	
BG	Bulgária	Número pessoal búlgaro	CONCAT	
CY	Chipre	Número de passaporte nacional	CONCAT	
CZ	República Checa	Número de identificação nacional (*Rodné číslo*)	Número de passaporte	CONCAT
DE	Alemanha	CONCAT		
DK	Dinamarca	Código de identificação pessoal Alfanumérico com 10 dígitos: DDMMYYXXXX	CONCAT	
EE	Estónia	Código de identificação pessoal da Estónia (*Isikukood*)		
ES	Espanha	Número de identificação fiscal (*Código de identificación fiscal*)		
FI	Finlândia	Código de identificação pessoal	CONCAT	
FR	França	CONCAT		
GB	Reino Unido	UK National Insurance number	CONCAT	
GR	Grécia	Identificador do investidor DSS com 10 dígitos	CONCAT	
HR	Croácia	Número de identificação pessoal (OIB — *Osobni identifikacijski broj*)	CONCAT	
HU	Hungria	CONCAT		
IE	Irlanda	CONCAT		
IS	Islândia	Código de identificação pessoal (*Kennitala*)		
IT	Itália	Código fiscal (*Codice fiscale*)		
LI	Liechtenstein	Número de passaporte nacional	Número do bilhete de identidade nacional	CONCAT

ISO 3166 — 1 alfa 2	Nome do país	Identificador de 1.ª prioridade	Identificador de 2.ª prioridade	Identificador de 3.ª prioridade
LT	Lituânia	Código pessoal (*Asmens kodas*)	Número de passaporte nacional	CONCAT
LU	Luxemburgo	CONCAT		
LV	Letónia	Código pessoal (*Personas kods*)	CONCAT	
MT	Malta	Número de identificação nacional	Número de passaporte nacional	
NL	Países Baixos	Número de passaporte nacional	Número do bilhete de identidade nacional	CONCAT
NO	Noruega	ID pessoal de 11 dígitos (*Foedselsnummer*)	CONCAT	
PL	Polónia	Número de identificação nacional (PESEL)	Número de contribuinte (*Numer identyfikacji podatkowej*)	
PT	Portugal	Número de contribuinte (Número de Identificação Fiscal)	Número de passaporte nacional	CONCAT
RO	Roménia	Número de identificação nacional (*Cod Numeric Personal*)	Número de passaporte nacional	CONCAT
SE	Suécia	Número de identificação pessoal	CONCAT	
SI	Eslovénia	Número de identificação pessoal (EMŠO: *Enotna Matična Številka Občana*)	CONCAT	
SK	Eslováquia	Número pessoal (*Rodné číslo*)	Número de passaporte nacional	CONCAT
Todos os outros países		**Número de passaporte nacional**	**CONCAT**	