

daquele limite por ficheiro, pode fazê-lo dividindo o reporte por mais ficheiros que são processados de acordo com seus respetivos números de sequência de grupo.

3 — O nome do ficheiro tem o formato “FFFNNNNNSSSSSS-SSXZTTAAAMMDD.xml” onde:

- i) FFF (3 caracteres) — identifica o ficheiro e é preenchido com “XTR”.
- ii) NNNNNN (6 algarismos) — corresponde ao código de entidade que efetua o reporte, atribuído pela CMVM, devendo ser usado o algarismo “0”, à esquerda, para completar o preenchimento dos seis caracteres.
- iii) SSSSSS (6 algarismos) — corresponde ao número de sequência anual do ficheiro XTR, único por tipo de ficheiro e por código de entidade que efetua o reporte, atribuído pela CMVM. Começa em 000001 e reinicia todos os anos.
- iv) XX (2 algarismos) — número sequencial do ficheiro em grupo (“Número sequencial”).
- v) Z (1 carácter) — carácter fixo separador entre Número sequencial e Número total.
- vi) TT (2 algarismos) — número total de ficheiros a enviar em grupo (“Número total”).
- vii) AAAAMMDD (8 algarismos) — “AAAA” corresponde ao ano, “MM” ao mês e “DD” ao dia em que se está a efetuar o reporte, sendo o algarismo “0” utilizado à esquerda, para completar o preenchimento dos quatro caracteres MM e DD.

Todos os caracteres do nome do ficheiro são de preenchimento obrigatório.

4 — A CMVM procede à validação dos ficheiros. Os erros produzidos, decorrentes desse processo, são identificados no ficheiro “RE_”, com informação detalhada dos erros detetados. Os códigos de erro, não exaustivos e que podem ser complementados, relacionados com a convenção do nome do ficheiro são os seguintes:

- i) ETR-001: Wrong or invalid file name format. File name should be: FFFNNNNNNSSSSSSXZTTAAAMMDD.xml.
- ii) ETR-002: NNNNNN is not a valid CMVM code for Reporting entity.
- iii) ETR-003: SSSSSS is not a valid sequence number.
- iv) ETR-004: XXZTT is not a valid code.
- v) ETR-005: AAAAMMDD is not a valid date.
- vi) ETR-006: NNNNNN not authorized to submit data for the executing entity.

5 — Os intermediários financeiros e as plataformas de negociação sujeitos ao dever de reporte prestam à CMVM, com uma antecedência de dois dias úteis em relação à data do primeiro reporte da informação e subsequentemente mantêm-na permanentemente atualizada, a seguinte informação:

- i) Denominação social da entidade responsável pelo reporte da informação.
- ii) Código do Identificador de Entidade Jurídica (código LEI) da entidade sujeita ao dever de reporte e da entidade responsável pelo reporte da informação, sendo distinta.
- iii) Endereço da entidade responsável pelo reporte da informação.
- iv) Contactos relevantes da entidade responsável pelo reporte da informação quando for distinta da entidade sujeita ao dever de reporte.
- v) Data de início do reporte da informação e, sendo efetuado por um Sistema de Reporte Autorizado, data de fim quando predeterminado.
- vi) Outras especificidades relevantes quanto às características do reporte de informação.

6 — As entidades sujeitas ao dever de reporte ou as que efetuam o reporte em nome daquelas, designadamente as plataformas de negociação e os sistemas de reporte autorizados, ainda que não se encontrem sujeitos a supervisão da CMVM, devem obter a informação necessária para o cumprimento dessa obrigação, incluindo o código de reporte atribuído pela CMVM e as permissões de acesso ao sistema de transferência de ficheiros da CMVM, conforme consta do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Artigo 3.º

Entrada em vigor e regime transitório

1 — O presente Regulamento entra em vigor na data de entrada em vigor do Regulamento (UE) n.º 600/2014, do Parlamento Europeu e do Conselho, de 15 de maio de 2014, aplicando-se a todas as transações que estejam sujeitas ao dever de reporte e sejam executadas a partir dessa data, inclusive.

2 — Sem prejuízo do número seguinte, o presente Regulamento revoga a Instrução n.º 12/2011, com efeitos a partir da data indicada no número anterior.

3 — As transações executadas e reportadas até ao dia 2 de janeiro de 2018 inclusive, em que sejam detetados erros ou inconsistências, deverão ser corrigidas até ao dia 31 de janeiro de 2018 inclusive, ao abrigo da Instrução n.º 12/2011. Após essa data e relativamente a tais transações, quaisquer erros ou inconsistências deverão ser comunicados diretamente e caso a caso, à CMVM.

20 de dezembro de 2017. — A Presidente do Conselho de Administração, *Gabriela Figueiredo Dias*. — O Vogal do Conselho de Administração, *Rui Pinto*.

311021007

Regulamento da CMVM n.º 5/2017

Prestação de informação sobre dados de referência dos instrumentos financeiros nos termos do artigo 27.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 15 de maio de 2014 e do artigo 4.º do Regulamento (UE) n.º 596/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 16 de abril de 2014.

O presente Regulamento decorre das alterações introduzidas no Código dos Valores Mobiliários (“CMV”) em consequência da transposição da Diretiva n.º 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 n.º 2002/92/CE e a Diretiva n.º 2011/61/UE (“DMIF II”), do 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 (“RMIF”), e do Regulamento (UE) n.º 596/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 16 de abril de 2014 relativo ao abuso de mercado e que revoga a Diretiva 2003/6/CE do Parlamento Europeu e do Conselho e as Diretivas 2003/124/CE, 2003/125/CE e 2004/72/CE da Comissão (“MAR”).

O artigo 27.º do RMIF institui a obrigação de as plataformas de negociação fornecerem às autoridades competentes dados de referência dos instrumentos financeiros admitidos à negociação em mercados regulamentados ou negociados em sistemas de negociação multilateral ou sistemas de negociação organizada, para efeitos do reporte de transações previsto no artigo 26.º do RMIF. Relativamente aos instrumentos financeiros abrangidos pelo n.º 2 do artigo 26.º do RMIF negociados nos sistemas de cada internalizador sistemático, o artigo 27.º do RMIF também obriga o internalizador sistemático a fornecer à respetiva autoridade competente os dados de referência relativos a esses instrumentos financeiros.

O Regulamento Delegado (UE) n.º 2017/585 da Comissão, de 14 de julho de 2016 (“Regulamento UE n.º 2017/585”), que complementa o RMIF no que respeita às normas e formatos dos dados de referência dos instrumentos financeiros, detalha e define as normas, modelos, conteúdos e prestação desses dados e respetivas atualizações, às autoridades competentes e à Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados (“ESMA”).

Conforme resulta do Considerando 1 do Regulamento Delegado (UE) n.º 2016/909 da Comissão, de 1 de março de 2016, as obrigações decorrentes do artigo 27.º do RMIF que requerem a apresentação contínua de dados de referência identificadores dos instrumentos financeiros admitidos à negociação e as obrigações estabelecidas no artigo 4.º do MAR que requerem que as plataformas de negociação notifiquem às respetivas autoridades competentes, apenas uma vez, os dados relativos aos instrumentos financeiros, sob reserva das suas diferenças, devem ser harmonizadas de modo a reduzir os encargos administrativos para as entidades sujeitas a tais obrigações.

O presente Regulamento estabelece o dever de prestação periódica de informações relevantes à CMVM, nos termos aqui previstos, pelas entidades gestoras de uma plataforma de negociação (i.e. mercados regulamentados, sistemas de negociação multilateral e sistemas de negociação organizada) e pelos internalizadores sistemáticos, sobre dados de referência dos instrumentos financeiros.

O propósito deste dever é permitir à CMVM supervisionar o mercado, pelo que os dados de referência dos instrumentos financeiros devem ser apresentados num formato coerente e de acordo com normas uniformes, sendo comunicados em modelo e formato eletrónico, legível por máquina para facilitar a sua utilização. A receção automatizada e padronizada dos dados de referência dos instrumentos financeiros que estejam admitidos à negociação, ou sejam negociados numa plataforma de negociação ou através de um internalizador sistemático, permite também às autoridades competentes e à ESMA, assegurar o intercâmbio desses dados para uma mais efetiva monitorização do mercado, contribuindo para a sua integridade.

A CMVM delegou na ESMA os procedimentos técnicos para a receção desses dados referenciais.

Neste âmbito, a prestação da informação relevante deve cumprir o disposto nos artigos 1.º a 7.º do Regulamento UE n.º 2017/585 e tabelas 1 a 3 do respetivo Anexo.

É da responsabilidade da entidade gestora ou do internalizador sistemático a confirmação sobre a aceitação do ficheiro reportado ou a correção dos erros verificados e o envio de ficheiros corretos.

Para os devidos efeitos, cumpre referir que o Regulamento da CMVM n.º 4/2017, relativo à prestação de informação sobre transações em instrumentos financeiros nos termos do artigo 26.º do RMIF, procedeu à revogação na íntegra, nos termos e nas condições nele previstos, da Instrução da CMVM n.º 12/2011.

Nos termos descritos, a CMVM, ao abrigo do disposto nos n.ºs 2 e 3 do artigo 315.º e no artigo 369.º do Código dos Valores Mobiliários, determina, através do presente Regulamento, o seguinte:

Artigo 1.º

Objeto

O presente Regulamento rege as especificidades relativas à prestação, nos termos do disposto no artigo seguinte, pelas entidades gestoras de plataformas de negociação e pelos internalizadores sistemáticos, dos dados de referência dos instrumentos financeiros, conforme previsto no Regulamento UE n.º 2017/585, no Regulamento UE n.º 2016/909 e no Regulamento UE n.º 2016/378.

Artigo 2.º

Prestação de informação

1 — A CMVM delegou na ESMA os procedimentos técnicos de recolha da informação sobre dados de referência dos instrumentos financeiros. Por efeito desta delegação, são aplicáveis os procedimentos técnicos definidos pela ESMA, referidos nas respetivas especificações técnicas.

2 — A informação prevista no artigo 1.º é prestada pelas entidades gestoras e pelos internalizadores sistemáticos, no prazo definido no artigo 2.º do Regulamento UE n.º 2017/585, através do acesso e dos procedimentos técnicos identificados para o efeito pela ESMA, elaborada em conformidade com as regras de forma e conteúdo constantes nos quadros 1 a 3 do Anexo ao Regulamento UE n.º 2017/585, com as regras de forma e conteúdo constantes dos quadros 1 a 2 do Anexo ao Regulamento UE n.º 2016/909 e com as regras de forma e conteúdo constantes dos quadros 1 a 3 do Regulamento UE n.º 2016/378.

Artigo 3.º

Entrada em vigor

O presente Regulamento entra em vigor na data em que entre em vigor o Regulamento (UE) n.º 600/2014, do Parlamento Europeu e do Conselho, de 15 de maio de 2014.

20 de dezembro de 2017. — A Presidente do Conselho de Administração, *Gabriela Figueiredo Dias*. — O Vogal do Conselho de Administração, *Rui Pinto*.

311021064

Regulamento da CMVM n.º 6/2017

Prestação de informação pelas plataformas de negociação sobre ofertas relativas a instrumentos financeiros nos termos do artigo 25.º do Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 15 de maio de 2014.

O presente Regulamento visa estabelecer o dever de prestação periódica de informações relevantes pelas entidades gestoras de uma plataforma de negociação sobre ofertas relativas a instrumentos financeiros registadas nos seus sistemas, de acordo com 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 (“RMIF”), concretizado por atos delegados e normas técnicas de regulamentação e execução.

O n.º 2 do artigo 25.º do RMIF vem instituir que as entidades gestoras de uma plataforma de negociação mantém à disposição da autoridade competente, durante pelo menos cinco anos, as informações relevantes relacionadas com todas as ofertas relativas a instrumentos financeiros registadas nos seus sistemas. Esses registos contêm as características da oferta, incluindo aquelas que associam a oferta à transação e cujos pormenores são reportados nos termos dos n.ºs 1 e 3 do artigo 26.º do RMIF.

O Regulamento Delegado (UE) n.º 2017/580 da Comissão, de 24 de junho de 2016 (“Regulamento UE n.º 2017/580”), que complementa o RMIF no que respeita às normas técnicas de regulamentação sobre a manutenção das informações relevantes sobre ofertas relativas a instrumentos financeiros, detalha as informações e o formato dos registos de ofertas a manter pelas entidades gestoras de plataformas de negociação para efeitos de disponibilização às respetivas autoridades competentes.

Nos termos dos n.ºs 1 e 4 do artigo 369.º do Código dos Valores Mobiliários (“CVM”), a Comissão do Mercado de Valores Mobiliários (“CMVM”) pode, por regulamento, elaborar regulamentos sobre as matérias integradas nas suas atribuições e competências.

O presente Regulamento estabelece o dever de prestação periódica de informações relevantes pelas entidades gestoras de uma plataforma de negociação sobre ofertas relativas a instrumentos financeiros registadas nos seus sistemas. Desta forma, ficam abrangidas pelo dever de prestação periódica de informação à CMVM, as entidades gestoras de uma plataforma de negociação, conforme mencionadas no artigo 198.º do CVM.

O propósito deste dever é permitir à CMVM investigar, de forma mais eficiente, padrões anómalos ou comportamentos potencialmente abusivos nas atividades de negociação, através dos registos de informações relevantes sobre todas as ofertas relativas a instrumentos financeiros, incluindo designadamente a identificação imediata de quaisquer pessoas e entidades suscetíveis de estarem envolvidas no processamento das ofertas.

Neste âmbito, a prestação da informação relevante sobre ofertas deverá conter as informações pormenorizadas e o formato previstos nos artigos 2.º a 13.º do Regulamento UE n.º 2017/580, conforme detalhado na segunda e na terceira colunas do quadro 2 do respetivo Anexo.

Em 10 de outubro de 2016, a Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e do Mercado (“ESMA”) emitiu Orientações (ESMA/2016/1452) designadamente quanto aos deveres de manutenção das informações relevantes relacionadas com ofertas, relativamente às quais a CMVM manifestou intenção de aderir, ao abrigo do artigo 16.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010, do Parlamento Europeu e do Conselho, de 24 de novembro de 2010 (“Regulamento UE n.º 1095/2010”). Estas Orientações incluem instruções específicas sobre o modo de preenchimento dos respetivos campos previstos no Anexo ao Regulamento UE n.º 2017/580. Atento o grau de pormenor e natureza explicativa das Orientações da ESMA, as regras especificadas no presente Regulamento devem ser interpretadas e complementadas de acordo com aquelas Orientações.

O modo de prestação de informação à CMVM segue os termos e condições previstos no Regulamento da CMVM n.º 3/2016, relativo aos deveres de reporte de informação à CMVM, com as especificidades estabelecidas no presente Regulamento.

A informação objeto do dever de reporte deve ser remetida à CMVM em formato XML, de acordo com as especificações técnicas definidas pela CMVM, disponíveis no respetivo sítio da internet. O ficheiro com a estrutura de base XML (.xsd), encontra-se disponível no ficheiro ZIP que integra as referidas especificações técnicas. A CMVM procede à verificação do formato XML para efeitos de deteção de erros de conteúdo.

Em complemento do referido no parágrafo anterior, é disponibilizado à entidade gestora da plataforma de negociação sujeita ao dever de reporte de informação, no seu domínio da *extranet*, um ficheiro XML, com o mesmo nome e extensão, com o prefixo “RE_” que contém uma mensagem de sucesso ou de insucesso quanto aos ficheiros por si remetidos, nos termos definidos no Regulamento da CMVM n.º 3/2016. É da responsabilidade da entidade gestora a confirmação sobre a aceitação do ficheiro reportado à CMVM ou a correção dos erros verificados e o envio à CMVM de ficheiros corretos.

Nestes termos, a CMVM, ao abrigo do disposto nos n.ºs 1 e 4 do artigo 369.º do Código dos Valores Mobiliários, determina, através do presente Regulamento, o seguinte:

Artigo 1.º

Objeto

O presente Regulamento rege as especificidades relativas à prestação à CMVM, pelas entidades gestoras de plataformas de negociação, da informação relevante relacionada com todas as ofertas relativas a instrumentos financeiros registadas nos seus mercados regulamentados, sistemas de negociação multilateral e sistemas de negociação organizada, conforme previsto no Regulamento UE n.º 2017/580.

Artigo 2.º

Prestação de informação

1 — A informação prevista no artigo anterior é enviada diariamente à CMVM, até às 07h00 m do segundo dia útil seguinte ao da sessão de