

COMISSÃO DO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Regulamento da CMVM n.º 2/2022

Sumário: Prestação de informação pelas Centrais de Valores Mobiliários («CSD») relativa às falhas de liquidação.

Prestação de informação pelas Centrais de Valores Mobiliários (“CSD”) relativa às falhas de liquidação

O presente Regulamento da Comissão do Mercado de Valores Mobiliários (doravante designada por “CMVM”) decorre da necessidade de dar execução aos artigos 6.º e 7.º do Regulamento (UE) n.º 909/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho de 23 de julho de 2014, relativo à melhoria da liquidação de valores mobiliários na União Europeia e nas Centrais de Valores Mobiliários (doravante designado por “CSDR”), e ao disposto no Regulamento Delegado (UE) 2018/1229 da Comissão de 25 de maio de 2018, que complementa o CSDR no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação relativas à disciplina da liquidação (doravante designado por “RTS 2018/1229”).

Nos termos do disposto do n.º 1 do artigo 7.º do CSDR, as Centrais de Valores Mobiliários (doravante designadas por “CSD”) estabelecem, para cada sistema de liquidação de valores mobiliários que gerem, um sistema que controle as falhas de liquidação das transações dos instrumentos financeiros a que se refere o artigo 5.º, n.º 1 do CSDR. Apresentam às autoridades competentes e às autoridades relevantes relatórios periódicos com o número de falhas de liquidação e os pormenores das mesmas, bem como outras informações pertinentes, incluindo as medidas previstas pelas CSD e pelos seus participantes para melhorar a eficiência da liquidação. As CSD devem ainda, com periodicidade anual, tornar público, e de forma agregada, esses relatórios.

O artigo 13.º do RTS 2018/1229 define os pormenores do sistema de controlo das falhas de liquidação que as Centrais de Valores Mobiliários devem estabelecer. Adicionalmente, o artigo 14.º do RTS 2018/1229 detalha os elementos necessários a constar das comunicações em causa, em particular a periodicidade com que as mesmas devem ser reportadas.

Nos termos do artigo 369.º, n.º 1 do Código dos Valores Mobiliários, a CMVM elabora Regulamentos sobre as matérias integradas nas suas atribuições e competências.

Nesse sentido, o presente Regulamento estabelece os procedimentos e os conteúdos relativos à prestação de informação relativa às falhas de liquidação, pelas Centrais de Valores Mobiliários à CMVM.

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

A informação objeto do dever de reporte deve ser remetida à CMVM em formato XML, conforme definido nos documentos disponíveis para consulta no sítio da Internet da ESMA (*Technical Reporting Instructions CSDR Article 7 — Settlement Fails Reporting, Guidelines on Settlement Fails Reporting, CSDR Settlement Fails XML Schema*), relativos à prestação desta informação.

A CMVM procede a uma validação preliminar, disponibilizando, no seu domínio da Extranet, um ficheiro XML, com o mesmo nome e extensão, com o prefixo “RE_” que contém informação de sucesso ou de insucesso quanto aos ficheiros por si remetidos, nos termos definidos no Regulamento da CMVM n.º 3/2016. Adicionalmente, a CMVM disponibiliza no seu domínio da Extranet a validação da ESMA, em formato XML e utilizando as regras de nomenclatura da Extranet, com prefixo “RE_” e sufixo “_ESMA”. É da responsabilidade da CSD a confirmação sobre a aceitação do ficheiro reportado à CMVM ou a correção dos erros verificados e o envio à CMVM de ficheiros corretos.

Nos termos legais, procedeu-se a consulta pública no referente ao projeto de regulamento, tendo sido realizada a consulta pública da CMVM n.º 1/2022, no quadro da qual foram recebidos os contributos e sugestões descritos no relatório da consulta pública da CMVM n.º 1/2022, aqui tido em conta.

Ao abrigo do disposto no artigo 369.º do Código dos Valores Mobiliários, aprovado pelo Decreto-Lei n.º 486/99, de 13 de novembro, na alínea d) do n.º 2 do artigo 1.º, na alínea r) do artigo 12.º e na alínea a) do n.º 3 do artigo 15.º, todos dos Estatutos da CMVM, aprovados pelo Decreto-Lei

n.º 5/2015, de 8 de janeiro, e no artigo 41.º da Lei-Quadro das Entidades Reguladoras, aprovada pela Lei n.º 67/2013, de 28 de agosto, o Conselho de Administração da Comissão do Mercado de Valores Mobiliários aprovou o seguinte regulamento:

Artigo 1.º

Objeto

O presente Regulamento define a forma e conteúdo dos deveres de comunicação à CMVM, pelas Centrais de Valores Mobiliários, de informações relativas às falhas de liquidação, nos termos do disposto no artigo 7.º, n.º 1 do CSDR e do artigo 14.º, números 1 e 2 do RTS 2018/1229.

Artigo 2.º

Prestação de informação

1 — As comunicações previstas nos números 1 e 2 do artigo 14.º do RTS 2018/1229 são prestadas através do acesso ao domínio de *extranet* da CMVM, mediante o envio de um ficheiro informático, elaborado em conformidade com as regras de conteúdo e forma constantes do anexo ao presente Regulamento.

2 — As Centrais de Valores Mobiliários devem validar que a informação foi devidamente submetida e aceite sem erros.

3 — As Centrais de Valores Mobiliários devem obter a informação necessária para o cumprimento dos seus deveres de comunicação à CMVM, 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

O presente Regulamento entra em vigor no dia 1 de fevereiro de 2022, aplicando-se a todas as instruções de liquidação que estejam sujeitas ao dever de reporte, mensal e anual, a partir dessa data, inclusive.

28 de janeiro de 2022 — O Presidente do Conselho de Administração, *Gabriel Bernardo* — O Vogal do Conselho de Administração, *José Miguel Almeida*.

ANEXO I

Envio de informação à CMVM

1 — A informação requerida no artigo 2.º do presente Regulamento é remetida à CMVM em ficheiro de dados em formato XML, nos termos da norma ISO 20022, designado como ficheiros “MSF” (reporte mensal) ou “ASF” (reporte anual) e de acordo com as seguintes especificações:

i) Os ficheiros “MSF” e “ASF” a remeter pela CSD, de acordo com o artigo 1.º deste Regulamento, são elaborados de acordo com os documentos disponíveis para consulta no sítio da Internet da ESMA, relativos à prestação desta informação (Technical Reporting Instructions CSDR Article 7 — Settlement Fails Reporting ⁽¹⁾, Guidelines on Settlement Fails Reporting ⁽²⁾, CSDR Settlement Fails XML Schema ⁽³⁾);

ii) Compete à CSD, sujeito ao dever de reporte, enviar os ficheiros “MSF”, “ASF”;

iii) O conteúdo de cada ficheiro XML é coerente com a informação contida no nome do ficheiro.

iv) Os ficheiros com nomes duplicados são recusados.



2 — O nome do ficheiro tem o formato “FFNNNNNN VVVVYYYYMMDD.xml” onde:

- i) FFF (3 caracteres) — identifica o ficheiro e é preenchido com “MSF” ou “ASF”;
- 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) VVVV (4 caracteres) — caracteres fixos que identificam a versão do ficheiro. Deve ser sequencial por data de informação, sendo o primeiro reporte inicializado com 0001.
- iv) YYYYMMDD (8 algarismos) — “YYYY” corresponde ao ano, “MM” ao mês e “DD” à data final do mês/ano (conforme aplicável) a que se refere a informação, 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.

3 — A CMVM procede à validação dos ficheiros. Os erros produzidos, decorrentes desse processo, são identificados no ficheiro “RE_”, com informação detalhada dos erros detetados.

(¹) ESMA65-8-7109.

(²) ESMA70-156-4717.

(³) ESMA65-8-6905.

314962397