

COMISSÃO DO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Regulamento da CMVM n.º 4/2022

Sumário: Envio de informação à CMVM sobre fundos do mercado monetário [artigo 37.º do Regulamento (UE) 2017/1131 do Parlamento Europeu e do Conselho de 14 de junho de 2017].

Envio de informação à CMVM sobre fundos do mercado monetário (artigo 37.º do Regulamento (UE) 2017/1131 do Parlamento Europeu e do Conselho de 14 de junho de 2017)

O presente Regulamento regula as especificidades de envio à Comissão do Mercado de Valores Mobiliários (CMVM), pelas entidades responsáveis pela gestão, da informação relativa a Fundos do Mercado Monetário (FMM), nos termos do artigo 37.º do Regulamento (UE) 2017/1131 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 14 de junho de 2017, relativo aos FMM.

Aquele artigo 37.º impõe aos gestores de FMM o envio, às respetivas autoridades nacionais de supervisão, pelo menos trimestralmente, ou anualmente, consoante os casos, de informação específica sobre os FMM sob gestão, incluindo o tipo e as características, os indicadores de carteira, os resultados dos testes de esforço efetuados e as informações sobre os ativos e passivos do FMM. Tal informação é posteriormente transmitida, pela CMVM, à Autoridade Europeia de Supervisão (Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados — ESMA — «European Securities and Markets Authority»).

De forma a sistematizar o cumprimento do dever de reporte por parte das entidades responsáveis pela gestão, mediante a utilização de um canal dedicado de envio de informação à CMVM, já conhecido e utilizado por parte das entidades supervisionadas para cumprimento dos deveres de reporte regular de informação, e o tratamento transversal da informação pela supervisão, tornando mais linear o reporte subsequente à ESMA pela CMVM, é necessário regular as especificidades do envio da referida informação via extranet.

Para o efeito, o presente Regulamento estabelece o prazo de envio da informação à CMVM, as particularidades relativas ao nome do ficheiro e à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados, remetendo, nestes dois últimos casos, para as especificações técnicas disponíveis no sítio da Internet da ESMA, assim como o primeiro reporte de informação a efetuar ao abrigo do presente Regulamento.

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 a enviar à CMVM é remetida em formato XML, de acordo com as especificações técnicas publicadas pela ESMA — Final report on reporting under MMFR Reporting Instructions; Validations e Schemas -, disponíveis no sítio da Internet da ESMA, relativas à prestação desta informação.

A CMVM procede a uma validação preliminar, disponibilizando à entidade responsável pela gestão, 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 Extranet a validação da ESMA, em formato XML e utilizando as regras de nomenclatura da Extranet, com prefixo “RE” e sufixo “_ESMA”.

Nos termos legais, foi realizada a consulta pública da CMVM n.º 2/2022, no quadro da qual foram recebidos os contributos e sugestões descritos no relatório da consulta pública da CMVM n.º 2/2022, aqui tidos em conta.

Assim, 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 rege as especificidades do envio à CMVM, pela entidade responsável pela gestão, da informação relativa aos fundos de mercado monetário, nos termos definidos no artigo 37.º do Regulamento (UE) 2017/1131 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 14 de junho de 2017.

Artigo 2.º

Prestação de informação

A informação prevista no artigo anterior é enviada à CMVM, nos termos do Anexo ao presente Regulamento, até ao 15.º dia útil subsequente ao fim do trimestre ou ao fim do ano civil a que a informação respeite, consoante aplicável.

Artigo 3.º

Disposição transitória

O primeiro reporte de informação à CMVM ao abrigo do presente Regulamento é efetuado por referência ao segundo trimestre de 2022.

Artigo 4.º

Entrada em vigor

O presente Regulamento entra em vigor no dia seguinte ao da sua publicação, sem prejuízo do disposto no artigo anterior

29 de abril de 2022. — O Presidente do Conselho de Administração, *Gabriel Bernardino* — O Vogal do Conselho de Administração, *Rui Pinto*.

ANEXO

Informação a reportar nos termos do artigo 37.º do Regulamento (UE) 2017/1131 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 14 de junho de 2017

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016. Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte da informação relativa a fundos do mercado monetário.	Ficheiro de dados	XMFNNNNNNFFFFSSSSAAAAMMDD.xml
	XMF identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	



Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro “XMF” a enviar à CMVM constam dos documentos disponíveis no sítio da Internet da ESMA para o efeito, relativos à prestação desta informação (Final report on reporting under MMFR; Reporting Instructions; Validations e Schemas).

315275494