



Conselho da
União Europeia

Bruxelas, 17 de junho de 2022
(OR. en)

10387/22
ADD 1

EF 179
ECOFIN 638
DELECT 98

NOTA DE ENVIO

de:	Secretária-geral da Comissão Europeia, com a assinatura de Martine DEPREZ, diretora
para:	Secretariado-Geral do Conselho
n.º doc. Com.:	C(2022) 3589 final – ANEXO
Assunto:	ANEXO do REGULAMENTO DELEGADO (UE) .../... DA COMISSÃO que complementa o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação que especificam os pormenores mínimos dos dados a comunicar aos repositórios de transações e o tipo de comunicações de informações a utilizar

Envia-se em anexo, à atenção das delegações, o documento C(2022) 3589 final – ANEXO.

Anexo: C(2022) 3589 final – ANEXO



Bruxelas, 10.6.2022
C(2022) 3589 final

ANNEX

ANEXO

do

REGULAMENTO DELEGADO (UE) .../... DA COMISSÃO

que complementa o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação que especificam os pormenores mínimos dos dados a comunicar aos repositórios de transações e o tipo de comunicações de informações a utilizar

ANEXO

Quadro 1

	Secção	Campo	Dados a comunicar
1	Partes no derivado	Data e hora da comunicação	Data e hora da comunicação dos dados ao repositório de transações.
2	Partes no derivado	Identificação da entidade que apresenta a comunicação de informações	Caso a entidade responsável pela comunicação de informações tenha delegado essa comunicação num terceiro ou na outra contraparte, esta entidade tem de ser identificada neste campo, através de um código único. Caso contrário, a entidade responsável pela comunicação de informações deve ser identificada neste campo.
3	Partes no derivado	Entidade responsável pela comunicação de informações	Caso uma contraparte financeira seja a única responsável, nomeadamente no plano jurídico, pela comunicação de informações em nome de ambas as contrapartes nos termos do artigo 9.º, n.º 1-A, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho ¹ e a contraparte não financeira não decida comunicar ela própria os dados dos seus contratos de derivados OTC com a contraparte financeira, o código único de identificação dessa contraparte financeira. Caso uma sociedade gestora seja responsável, nomeadamente no plano jurídico, pela comunicação de informações em nome de um organismo de investimento coletivo em valores mobiliários (OICVM) em conformidade com o artigo 9.º, n.º 1-B, desse regulamento, o código único de identificação dessa sociedade gestora. Caso um gestor de fundos de investimento alternativos (GFIA) seja responsável, nomeadamente no plano jurídico, pela comunicação de informações em nome de um fundo de investimento alternativo (FIA) em

¹ Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 4 de julho de 2012, relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações (JO L 201 de 27.7.2012, p. 1).

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			<p>conformidade com o artigo 9.º, n.º 1-C, desse regulamento, o código único de identificação desse GFIA. Caso uma entidade autorizada responsável pela gestão e atuação em nome de uma IRPPP seja responsável, nomeadamente no plano jurídico, pela comunicação de informações em seu nome nos termos do artigo 9.º, n.º 1-D, desse regulamento, o código único de identificação dessa entidade.</p> <p>Este campo aplica-se apenas aos derivados OTC.</p>
4	Partes no derivado	Contraparte 1 (contraparte que comunica as informações)	<p>Identificador da contraparte numa transação de derivados que cumpre a sua obrigação de comunicação de informações através da comunicação em questão.</p> <p>No caso de uma transação de derivados afetada, executada por um gestor de fundos em nome de um fundo, o fundo, e não o gestor do fundo, é indicado como a contraparte.</p>
5	Partes no derivado	Natureza da contraparte 1	<p>Indicar se a contraparte 1 é uma contraparte central («CCP»), uma contraparte financeira ou uma contraparte não financeira na aceção do artigo 2.º, pontos 1, 8 e 9, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, ou uma entidade a que se refere o artigo 1.º, ponto 5, desse regulamento.</p>

	Secção	Campo	Dados a comunicar
6	Partes no derivado	Setor empresarial da contraparte 1	<p>Natureza das atividades empresariais da contraparte 1.</p> <p>Se a contraparte 1 for uma contraparte financeira, este campo deve conter todos os códigos necessários incluídos na taxonomia das contrapartes financeiras no campo 6 do quadro 1 do anexo de [OP: inserir referência ao C(2022) 3588] e aplicáveis a essa contraparte.</p> <p>Se a contraparte 1 for uma contraparte não financeira, este campo deve conter todos os códigos necessários incluídos na taxonomia das contrapartes não financeiras no campo 6 do quadro 1 do anexo de [OP: inserir referência ao C(2022) 3588] e aplicáveis a essa contraparte.</p> <p>Caso seja comunicada mais do que uma atividade, os códigos devem ser inseridos por ordem da importância relativa das atividades a que correspondem.</p>
7	Partes no derivado	Limiar de compensação da contraparte 1	<p>Informação sobre se a contraparte 1 está acima do limiar de compensação a que se refere o artigo 4.º-A, n.º 3, ou o artigo 10.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 na data em que a transação foi concluída.</p>
8	Partes no derivado	Tipo de identificador da contraparte 2	<p>Menção que indica se o LEI foi utilizado para identificar a contraparte 2.</p>
9	Partes no derivado	Contraparte 2	<p>Identificador da segunda contraparte numa transação de derivados.</p> <p>No caso de uma transação de derivados afetada, executada por um gestor de fundos em nome de um fundo, o fundo, e não o gestor do fundo, é indicado como a contraparte.</p>
10	Partes no derivado	Natureza da contraparte 2	<p>No caso de a contraparte 2 ser uma pessoa singular, o código do país de residência dessa pessoa.</p>

	Secção	Campo	Dados a comunicar
11	Partes no derivado	Natureza da contraparte 2	Indicar se a contraparte 2 é uma CCP, uma contraparte financeira ou uma contraparte não financeira na aceção do artigo 2.º, pontos 1, 8 e 9, do Regulamento (UE) n.º 648/2012, ou uma entidade a que se refere o artigo 1.º, ponto 5, desse regulamento.
12	Partes no derivado	Setor empresarial da contraparte 2	Natureza das atividades empresariais da contraparte 2. Se a contraparte 2 for uma contraparte financeira, este campo deve conter todos os códigos necessários incluídos na taxonomia das contrapartes financeiras no campo 6 do quadro 1 do anexo de [OP: inserir referência ao C(2022) 3588] e aplicáveis a essa contraparte. Se a contraparte 2 for uma contraparte não financeira, este campo deve conter todos os códigos necessários incluídos na taxonomia das contrapartes não financeiras no campo 6 do quadro 1 do anexo de [OP: inserir referência ao C(2022) 3588] e aplicáveis a essa contraparte. Caso seja comunicada mais do que uma atividade, os códigos devem ser inseridos por ordem da importância relativa das atividades a que correspondem.
13	Partes no derivado	Limiar de compensação da contraparte 2	Informação sobre se a contraparte 2 está acima do limiar de compensação a que se refere o artigo 4.º-A, n.º 3, ou o artigo 10.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 na data em que a transação foi concluída.
14	Partes no derivado	Obrigaçãõ de comunicação de informações da contraparte 2	Menção que indica se a contraparte 2 tem a obrigaçãõ de comunicação de informações nos termos do Regulamento (UE) n.º 648/2012, independentemente de quem é responsável, nomeadamente no plano jurídico, pela sua comunicação.
15	Partes no derivado	Identificação do corretor	Caso o corretor atue como intermediário da contraparte 1 mas sem se tornar ele próprio uma contraparte, a contraparte 1 deve identificar esse corretor através de

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			um código único.
16	Partes no derivado	Membro compensador	Identificador do membro compensador através do qual uma transação de derivados foi compensada numa CCP. Estes dados aplicam-se às transações compensadas.
17	Partes no derivado	Direção	Menção que indica se a contraparte 1 é o comprador ou o vendedor, tal como determinado na data em que o contrato de derivados foi celebrado.
18	Partes no derivado	Direção da componente 1	Menção que indica se a contraparte 1 é o ordenante ou o beneficiário da componente 1, tal como determinado na data em que o contrato de derivados foi celebrado.
19	Partes no derivado	Direção da componente 2	Menção que indica se a contraparte 1 é o ordenante ou o beneficiário da componente 2, tal como determinado na data em que o contrato de derivados foi celebrado.
20	Partes no derivado	Ligação direta à atividade comercial ou à gestão de tesouraria	Indicar se o contrato é objetivamente considerado diretamente ligado à atividade comercial ou à gestão de tesouraria da contraparte 1, nos termos do artigo 10.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012. Este campo só deve ser preenchido se a contraparte 1 for uma contraparte não financeira, na aceção do artigo 2.º, ponto 9, do Regulamento (UE) n.º 648/2012.

Quadro 2

	Secção	Campo	Dados a comunicar
1	Secção 2A - Identificadores e ligações	UTI	Identificador de transação único a que se refere o artigo 7.º de [OP: inserir referência ao C(2022) 3588].
2	Secção 2A - Identificadores e ligações	Número de referência da comunicação de informações	Quando um contrato de derivados foi executado numa plataforma de negociação, um número gerado pela plataforma de negociação e exclusivo dessa execução.
3	Secção 2A - Identificadores e ligações	UTI anterior (para as relações «uma para uma» e «uma para muitas» entre transações)	UTI afetado à operação anterior que deu origem à transação comunicada devido a um evento ao longo do ciclo de vida, numa relação «uma para uma» entre transações (por exemplo, no caso de uma novação, quando uma transação é cessada e é gerada uma nova transação) ou numa relação «uma para muitas» entre transações (por exemplo, na compensação ou se uma transação for dividida em várias transações diferentes). Estes dados não se aplicam aquando da comunicação de relações «muitas para uma» e «muitas para muitas» entre transações (por exemplo, em caso de compressão).
4	Secção 2A - Identificadores e ligações	UTI da posição subsequente	O UTI da posição em que um derivado está incluído. Este campo só se aplica às comunicações relacionadas com a

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			cessação de um derivado devido à sua inclusão numa posição.
5	Secção 2A - Identificadores e ligações	Identificação da redução dos riscos pós-transação (PTRR)	Identificador gerado pelo prestador de serviços de PTRR ou pela CCP que presta o serviço de PTRR a fim de associar todos os derivados que participam num determinado evento de PTRR e que resultam desse evento.
6	Secção 2A - Identificadores e ligações	Identificador do pacote	Identificador (determinado pela contraparte 1) para associar derivados no mesmo pacote em conformidade com o artigo 1.º, n.º 3, terceiro parágrafo, do presente regulamento. Um pacote pode incluir transações sujeitas e não sujeitas a comunicação de informações.
7	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Número de identificação internacional de títulos (ISIN)	O ISIN que identifica o produto se esse produto for admitido à negociação ou negociado num mercado regulamentado, MTF, OTF ou internalizador sistemático.
8	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Identificador único do produto (UPI)	UPI que identifica o produto.
9	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Classificação dos produtos	Código de classificação do instrumento financeiro (CFI) relativo ao instrumento.
10	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Tipo de contrato	Cada contrato comunicado deve ser classificado de acordo com o seu tipo.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
11	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Categoria de ativos	Cada contrato comunicado deve ser classificado em função da classe de ativos em que se baseia.
12	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Derivados baseados em criptoativos	Menção que indica se o derivado se baseia ou não em criptoativos.
13	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Tipo de identificação do subjacente	Tipo de identificador do subjacente em causa.
14	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Identificação do subjacente	O subjacente direto deve ser identificado através de um identificador único baseado no seu tipo. Para os <i>swaps</i> de risco de incumprimento, indicar o ISIN da obrigação de referência.
15	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Indicador sobre o índice subjacente	Uma indicação do índice subjacente, se disponível.
16	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Nome do índice subjacente	Nome completo do índice subjacente atribuído pelo fornecedor do índice.
17	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Código do cabaz personalizado	Se a transação de derivados se basear num cabaz personalizado, código único atribuído pela entidade estruturadora do cabaz para associar os seus componentes.
18	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Identificador dos componentes do cabaz	No caso dos cabazes personalizados compostos, entre outros, por instrumentos financeiros negociados numa plataforma de negociação, devem ser especificados apenas os instrumentos financeiros negociados

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			numa plataforma de negociação.
19	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Moeda de liquidação 1	Moeda para a liquidação em numerário da transação, quando aplicável. Para produtos multdivisas que não sejam passíveis de ser comunicados em termos líquidos, a moeda de liquidação da componente 1. Estes dados não se aplicam a produtos liquidados mediante entrega física (por exemplo, opções sobre <i>swaps</i> liquidadas mediante entrega física).
20	Secção 2B - Informações sobre os contratos	Moeda de liquidação 2	Moeda para a liquidação em numerário da transação, quando aplicável. Para produtos multdivisas que não sejam passíveis de ser comunicados em termos líquidos, a moeda de liquidação da componente 2. Estes dados não se aplicam a produtos liquidados mediante entrega física (por exemplo, opções sobre <i>swaps</i> liquidadas mediante entrega física).
21	Secção 2C - Avaliação	Montante da avaliação	Avaliação do contrato ao preço de mercado, ou avaliação com recurso a um modelo a que se refere o artigo 4.º do presente regulamento. Para as transações compensadas, deve ser utilizada a avaliação da

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			CCP.
22	Secção 2C - Avaliação	Moeda da avaliação	Divisa em que é expresso o montante da avaliação.
23	Secção 2C - Avaliação	Data e hora da avaliação	Data e hora da última avaliação ao preço de mercado, fornecida pela CCP ou calculada utilizando o preço de mercado atual ou o último preço de mercado disponível das componentes.
24	Secção 2C - Avaliação	Método de avaliação	<p>Fonte e método utilizados para a avaliação da transação pela contraparte 1.</p> <p>Se for utilizada, pelo menos, uma componente da avaliação classificada como avaliação com recurso a um modelo, então toda a avaliação é classificada como avaliação com recurso a um modelo.</p> <p>Se apenas forem utilizadas componentes classificadas como avaliadas ao preço de mercado, toda a avaliação é classificada como avaliação ao preço de mercado.</p>
25	Secção 2C - Avaliação	Delta	<p>O rácio entre a variação do preço de uma transação de derivados e a variação do preço do subjacente.</p> <p>Este campo aplica-se apenas às opções e às opções sobre <i>swaps</i>.</p> <p>O delta atualizado deve ser comunicado diariamente pelas</p>

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			contrapartes financeiras e não financeiras a que se refere o artigo 10.º do Regulamento (UE) n.º 648/2012.
26	Secção 2D - Garantias	Indicador sobre a carteira de garantias	Menção que indica se a cobertura por garantias é ou não assegurada a nível da carteira. Por «a nível de uma carteira», entende-se um conjunto de transações cujas margens são agrupadas (numa base líquida ou bruta), contrariamente ao cenário em que a margem é calculada e fornecida separadamente para cada transação individual.
27	Secção 2D - Garantias	Código da carteira de garantias	Se as garantias forem comunicadas numa base de carteira, um código único atribuído à carteira pela contraparte 1. Estes dados não se aplicam se a cobertura por garantias tiver sido assegurada a nível das transações, se não houver acordo de garantia ou se não for fornecida ou recebida nenhuma garantia.
28	Secção 2E - Atenuação de riscos/Comunicação de informações	Data e hora da confirmação	Data e hora da confirmação, conforme definido no artigo 12.º do Regulamento Delegado (UE) n.º 149/2013 ² . Aplicável apenas aos

² Regulamento Delegado (UE) n.º 149/2013 da Comissão, de 19 de dezembro de 2012, que completa o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho no que respeita às normas técnicas de regulamentação sobre os acordos de compensação indireta, a obrigação de compensação, o registo público, o acesso a um espaço ou organização de negociação, as contrapartes não financeiras e as técnicas de atenuação dos riscos para os contratos de derivados OTC não compensados através de uma CCP (JO L 52 de 23.2.2013, p. 11).

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			contratos de derivados OTC não compensados através de uma CCP.
29	Secção 2E - Atenuação de riscos/Comunicação de informações	Confirmado	<p>Para as novas transações a comunicar, indicar se as condições juridicamente vinculativas de um contrato de derivados OTC foram documentadas e acordadas (confirmadas) ou não (não confirmadas). Se documentadas e acordadas, indicar se essa confirmação se realizou:</p> <ul style="list-style-type: none"> • através de um sistema ou plataforma de confirmação partilhado, ou de um sistema eletrónico privado ou bilateral (eletrónico); • através de um documento escrito legível pelo ser humano, como fax, papel ou mensagens de correio eletrónico processadas manualmente (não eletronicamente). <p>Aplicável apenas aos contratos de derivados OTC não compensados através de uma CCP.</p>
30	Secção 2F - Compensação	Obrigação de compensação	<p>Indica se o contrato comunicado pertence a uma classe de derivados OTC que tenha sido declarada sujeita à obrigação de compensação e se ambas as partes no contrato estão sujeitas a essa obrigação de compensação nos termos do Regulamento (UE) n.º 648/2012, a partir da data de execução do contrato. Aplicável apenas aos contratos de derivados OTC.</p>

	Secção	Campo	Dados a comunicar
31	Secção 2F - Compensação	Compensado	Menção que indica se o derivado foi ou não compensado por uma CCP.
32	Secção 2F - Compensação	Data e hora da compensação	Data e hora em que foi efetuada a compensação. Aplicável apenas aos derivados compensados por uma CCP.
33	Secção 2F - Compensação	Contraparte central	Identificador da CCP que compensou a transação. Estes dados não se aplicam se o valor dos dados «Compensação efetuada» for «N» («Não, não compensado centralmente»).
34	Secção 2G - Pormenores da transação	Tipo de acordo-quadro	Referência ao tipo de acordo-quadro no âmbito do qual as contrapartes celebraram um contrato de derivados.
35	Secção 2G - Pormenores da transação	Outro tipo de acordo-quadro	Nome do acordo-quadro. Este campo apenas deve ser preenchido caso «OTHR» seja comunicado no campo 34 do presente quadro.
36	Secção 2G - Pormenores da transação	Versão do acordo-quadro	Referência ao ano do acordo-quadro relevante para a transação que é objeto da comunicação, se aplicável.
37	Secção 2G - Pormenores da transação	Intragrupo	Especificar se o contrato foi celebrado como uma transação intragrupo, conforme definida no artigo 3.º do Regulamento (UE) n.º 648/2012.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
38	Secção 2G - Pormenores da transação	PTRR (redução dos riscos pós-transação, ou <i>post-trade risk reduction</i>)	Indicar se o contrato resulta de uma operação de PTRR.
39	Secção 2G - Pormenores da transação	Tipo de técnica de PTRR	Indicador sobre um tipo de operação de PTRR para efeitos de comunicação de informações no quadro do Regulamento (UE) n.º 648/2012. Compressão de carteira sem um terceiro prestador de serviços: Um acordo para reduzir o risco nas carteiras existentes de transações que utilizam transações sem formação de preços principalmente para reduzir o montante nocional pendente, o número de transações ou alternativamente harmonizar as condições, cessando total ou parcialmente as transações e substituindo normalmente os derivados cessados por novas transações de substituição. Compressão de carteira com um terceiro prestador de serviços ou CCP: Um serviço de PTRR prestado por um prestador de serviços ou uma CCP para reduzir o risco nas carteiras de transações existentes que utilizam transações sem formação de preços principalmente para reduzir o montante nocional pendente, o número de transações ou alternativamente harmonizar as condições, cessando total ou parcialmente as transações e substituindo

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			<p>normalmente os derivados cessados por novas transações de substituição. Reequilíbrio da carteira/gestão das margens: Um serviço de PTRR prestado por um prestador de serviços para reduzir o risco de uma carteira de transações existente adicionando novas transações sem formação de preços e em que nenhuma transações existentes na carteira são cessadas ou substituídas e o montante nocional é aumentado em vez de ser reduzido.</p> <p>Outros serviços de PTRR da carteira: Um serviço de PTRR prestado por um prestador de serviços para reduzir o risco nas carteiras de transações existentes que utilizam transações sem formação de preços e quando esse serviço não é considerado uma compressão de carteira ou reequilíbrio de carteira.</p>
40	Secção 2G - Pormenores da transação	Prestador de serviços de PTRR	LEI que identifica o prestador de serviços de PTRR.
41	Secção 2G - Pormenores da transação	Espaço ou organização de execução	<p>Identificação do espaço ou organização de negociação onde a transação foi executada.</p> <p>Utilizar o MIC (código de identificação do mercado) do segmento ISO 10383 para transações executadas numa plataforma de negociação, num internalizador sistemático</p>

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			<p>ou numa plataforma de negociação organizada fora da União. Se esse código MIC do segmento não estiver disponível, utilizar o código MIC operacional.</p> <p>Utilizar o código MIC «XOFF» para os instrumentos financeiros admitidos à negociação, negociados numa plataforma de negociação ou para os quais foi apresentado um pedido de admissão, quando a transação relativa a esse instrumento financeiro não é executada numa plataforma de negociação, num internalizador sistemático ou numa plataforma de negociação organizada fora da União, ou se uma contraparte não tiver conhecimento de que está a negociar com uma contraparte 2 que atua como um internalizador sistemático.</p> <p>Utilizar o código MIC «XXXX» para os instrumentos financeiros não admitidos à negociação, não negociados numa plataforma de negociação ou para os quais não tenha sido apresentado qualquer pedido de admissão e que não sejam negociados numa plataforma de negociação organizada fora da União.</p>
42	Secção 2C - Pormenores da	Data e hora de execução	Data e hora em que uma transação foi inicialmente

	Secção	Campo	Dados a comunicar
	transação		executada, resultando na geração de um novo UTI. Este dado mantém-se inalterado ao longo da vida do UTI. Para a comunicação de informações ao nível de posição, deve referir-se ao momento em que a posição foi aberta pela primeira vez.
43	Secção 2C - Pormenores da transação	Data-valor	Data não ajustada em que as obrigações decorrentes da transação de derivados OTC começam a produzir efeitos, tal como incluído na confirmação. Se a data de produção de efeitos não for especificada no contrato, as contrapartes devem comunicar neste campo a data de execução do contrato de derivados.
44	Secção 2C - Pormenores da transação	Data de termo	Data não ajustada em que as obrigações decorrentes da transação de derivados deixam de produzir efeitos, tal como incluído na confirmação. A cessação antecipada não afeta este dado.
45	Secção 2C - Pormenores da transação	Data de cessação antecipada	Data efetiva da cessação antecipada (termo) da transação comunicada. Este dado é aplicável se a cessação da transação ocorrer antes do seu vencimento devido a uma decisão <i>ex interim</i> de uma contraparte (ou contrapartes).
46	Secção 2C - Pormenores da	Data final de liquidação contratual	Data não ajustada de acordo com o contrato, na

	Secção	Campo	Dados a comunicar
	transação		<p>qual todas as transferências de numerário ou ativos devem ter lugar e as contrapartes devem deixar de ter quaisquer obrigações pendentes entre si no âmbito desse contrato.</p> <p>Para produtos que podem não ter uma data final de liquidação contratual (por exemplo, opções americanas), estes dados refletem a data até à qual a transferência de numerário ou ativos teria lugar se a rescisão ocorresse na data de termo.</p>
47	Secção 2C - Pormenores da transação	Tipo de entrega	Especificar se o contrato é liquidado mediante entrega física ou em dinheiro.
48	Secção 2G - Pormenores da transação	Preço	<p>Preço especificado na transação de derivados. Não inclui taxas, impostos ou comissões.</p> <p>Se o preço não for conhecido quando é comunicada uma nova transação, o preço é atualizado à medida que estiver disponível.</p> <p>Para as transações que fazem parte de um pacote, estes dados contêm o preço da transação componente, se for caso disso.</p>
49	Secção 2G - Pormenores da transação	Moeda do preço	<p>Moeda em que é expresso o preço.</p> <p>A moeda do preço só é aplicável se o preço for expresso em valor monetário.</p>

	Secção	Campo	Dados a comunicar
	Os campos 50 a 52 são reprodutíveis e devem ser preenchidos no caso de derivados que envolvam tabelas de preços.		
50	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor não ajustada do preço	Data-valor não ajustada do preço.
51	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final não ajustada do preço	Data final não ajustada do preço (não aplicável se a data final não ajustada de um dado período da tabela for consecutiva à data-valor não ajustada do período subsequente).
52	Secção 2G - Pormenores da transação	Preço em vigor entre a data-valor não ajustada e a data final	Preço em vigor entre a data-valor não ajustada e a data final não ajustada, incluindo esta última.
53	Secção 2G - Pormenores da transação	Preço de transação do pacote	Preço transacionado de todo o pacote no qual a transação de derivados comunicada é uma componente. Estes dados não são aplicáveis se: <ul style="list-style-type: none"> • não está envolvido nenhum pacote, ou • é utilizado o <i>spread</i> da transação do pacote. Os preços e os dados conexos das transações (moeda do preço) que representam componentes individuais do pacote são comunicados quando disponíveis. O preço da transação do pacote pode não ser conhecido quando é comunicada uma nova

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			transação, mas pode ser atualizado mais tarde.
54	Secção 2G - Pormenores da transação	Moeda do preço de transação do pacote	Moeda em que é expresso o preço de transação do pacote. Estes dados não são aplicáveis se: <ul style="list-style-type: none"> • não está envolvido nenhum pacote, ou • é utilizado o <i>spread</i> da transação do pacote, ou • o preço de transação do pacote é expresso em percentagem.
55	Secção 2G - Pormenores da transação	Montante nocional da componente 1	Montante nocional da componente 1 a que se refere o artigo 5.º do presente regulamento.
56	Secção 2G - Pormenores da transação	Moeda nocional 1	Quando aplicável: a moeda em que está expresso o montante nocional da componente 1.
	Os campos 57 a 59 são reprodutíveis e devem ser preenchidos no caso de derivados que envolvam tabelas de montantes nocionais.		
57	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor do montante nocional da componente 1	A data não ajustada em que o montante nocional associado à componente 1 se torna efetivo.
58	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final do montante nocional da componente 1	Data final não ajustada do montante nocional da componente 1 (não aplicável se a data final não ajustada de um dado período da tabela for consecutiva à data-valor não ajustada do período subsequente).

	Secção	Campo	Dados a comunicar
59	Secção 2G - Pormenores da transação	Montante nocional em vigor na data-valor associada à componente 1	Montante nocional da componente 1 que se torna efetivo na data-valor não ajustada associada.
60	Secção 2G - Pormenores da transação	Quantidade nocional total da componente 1	Quantidade nocional agregada do ativo subjacente da componente 1 do prazo da transação. Se a quantidade nocional total não for conhecida quando é comunicada uma nova transação, a quantidade nocional total é atualizada à medida que estiver disponível.
	Os campos 61 a 63 são reprodutíveis e devem ser preenchidos no caso de derivados que envolvam tabelas de quantidades nocionais.		
61	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor da quantidade nocional da componente 1	A data não ajustada em que a quantidade nocional associada à componente 1 se torna efetiva
62	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final da quantidade nocional da componente 1	Data final não ajustada da quantidade nocional da componente 1 (não aplicável se a data final não ajustada de um dado período da tabela for consecutiva à data-valor não ajustada do período subsequente).
63	Secção 2G - Pormenores da transação	Quantidade nocional em vigor na data-valor associada à componente 1	Quantidade nocional da componente 1 que se torna efetivo na data-valor não ajustada associada.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
64	Secção 2G - Pormenores da transação	Montante nocional da componente 2	Se aplicável, montante nocional da componente 2 a que se refere o artigo 5.º do presente regulamento.
65	Secção 2G - Pormenores da transação	Moeda nocional 2	Quando aplicável: a moeda em que está expresso o montante nocional da componente 2.
	Os campos 66 a 68 são reprodutíveis e devem ser preenchidos no caso de derivados que envolvam tabelas de montantes nocionais.		
66	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor do montante nocional da componente 2	A data não ajustada em que o montante nocional associado à componente 2 se torna efetivo.
67	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final do montante nocional da componente 2	Data final não ajustada do montante nocional da componente 2 (não aplicável se a data final não ajustada de um dado período da tabela for consecutiva à data-valor não ajustada do período subsequente).
68	Secção 2G - Pormenores da transação	Montante nocional em vigor na data-valor associada à componente 2	Montante nocional da componente 2 que se torna efetivo na data-valor não ajustada associada.
69	Secção 2G - Pormenores da transação	Quantidade nocional total da componente 2	Quantidade nocional agregada do ativo subjacente da componente 2 do prazo da transação. Se a quantidade nocional total não for conhecida quando é comunicada uma nova transação, a quantidade nocional total

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			é atualizada à medida que estiver disponível.
	Os campos 70 a 72 são reprodutíveis e devem ser preenchidos no caso de derivados que envolvam tabelas de quantidades nocionais.		
70	Secção 2G - Pormenores da transação	Data-valor da quantidade nocional da componente 2	A data não ajustada em que a quantidade nocional associada à componente 2 se torna efetiva.
71	Secção 2G - Pormenores da transação	Data final da quantidade nocional da componente 2	Data final não ajustada da quantidade nocional da componente 2 (não aplicável se a data final não ajustada de um dado período da tabela for consecutiva à data-valor não ajustada do período subsequente).
72	Secção 2G - Pormenores da transação	Quantidade nocional em vigor na data-valor associada à componente 2	Montante nocional da componente 2 que se torna efetivo na data-valor não ajustada associada.
	A secção dos campos 73 a 78 é reprodutível		
73	Secção 2G - Pormenores da transação	Outro tipo de pagamento	Tipo de outro montante de pagamento. O pagamento de prémios de opções não é incluído como tipo de pagamento, uma vez que os prémios de opções são comunicados utilizando os

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			dados específicos relativos aos prémios de opções.
74	Secção 2G - Pormenores da transação	Outro montante de pagamento	Montantes de pagamento com os tipos de pagamento correspondentes para ter em conta os requisitos das descrições de transações de diferentes classes de ativos.
75	Secção 2G - Pormenores da transação	Outra moeda de pagamento	Moeda em que é expresso o outro montante de pagamento.
76	Secção 2G - Pormenores da transação	Outra data de pagamento	Data não ajustada em que o outro montante de pagamento é pago.
77	Secção 2G - Pormenores da transação	Outro ordenante do pagamento	Identificador do ordenante do outro montante de pagamento.
78	Secção 2G - Pormenores da transação	Outro beneficiário do pagamento	Identificador do beneficiário do outro montante de pagamento.
79	Secção 2H - Taxas de juro	Taxa fixa da componente 1 ou cupão	Indicação da taxa fixa da componente 1 ou do cupão utilizada, se aplicável.
80	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias correspondentes à taxa fixa ou ao cupão da componente 1	Quando aplicável: Convenção sobre a contagem de dias (muitas vezes também referida como fração de contagem de dias, base de contagem de dias ou método de contagem de dias) que determina a forma como os pagamentos de juros são calculados. É utilizada para calcular a fração

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			anual do período de cálculo e indica o número de dias do período de cálculo dividido pelo número de dias do ano.
81	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade de pagamento à taxa fixa ou ao cupão da componente 1	Quando aplicável: unidade de tempo associada à periodicidade dos pagamentos, por exemplo, dia, semana, mês, ano ou prazo do fluxo de pagamentos à taxa fixa da componente 1 ou ao cupão.
82	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa fixa ou do cupão da componente 1	Quando aplicável: número de unidades de tempo (expresso pela periodicidade dos pagamentos) que determina a frequência com que ocorrem as datas periódicas de pagamento à taxa fixa da componente 1 ou ao cupão. Por exemplo, uma transação com pagamentos que ocorram de dois em dois meses é representada por uma periodicidade de pagamento «MNTM» (mensal) e por um multiplicador da periodicidade de pagamento que é 2. Estes dados não são aplicáveis se a periodicidade de pagamentos for «ADHO». Se a periodicidade dos pagamentos for «EXPI», o multiplicador da periodicidade dos pagamentos é 1. Se a

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			periodicidade de pagamento for intradiária, a periodicidade de pagamento é «DAIL» e o multiplicador da periodicidade de pagamento é 0.
83	Secção 2H - Taxas de juro	Identificador da taxa variável da componente 1	Quando aplicável: um identificador das taxas de juro utilizadas que são ajustadas a intervalos preestabelecidos em função de uma taxa de referência do mercado.
84	Secção 2H - Taxas de juro	Indicador sobre a taxa variável da componente 1	Uma indicação da taxa de juro, se disponível.
85	Secção 2H - Taxas de juro	Designação da taxa variável da componente 1	Designação completa da taxa de juro atribuída pelo fornecedor do índice.
86	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias da taxa variável da componente 1	Quando aplicável: convenção sobre a contagem de dias (muitas vezes também referida como fração de contagem de dias, base de contagem de dias ou método de contagem de dias) que determina a forma como os pagamentos de juros à taxa variável da componente 1 são calculados. É utilizada para calcular a fração anual do período de cálculo e indica o número de dias do período de cálculo dividido pelo número de dias do ano.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
87	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 1	Quando aplicável: unidade de tempo associada à periodicidade dos pagamentos, por exemplo, dia, semana, mês, ano ou prazo do fluxo de pagamentos à taxa variável da componente 1.
88	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 1	Quando aplicável: número de unidades de tempo (expresso pela periodicidade dos pagamentos) que determina a frequência com que ocorrem as datas periódicas de pagamento à taxa variável da componente 1. Por exemplo, uma transação com pagamentos que ocorram de dois em dois meses é representada por uma periodicidade de pagamento «MNTH» (mensal) e por um multiplicador da periodicidade de pagamento que é 2. Estes dados não são aplicáveis se a periodicidade de pagamentos for «ADHO». Se a periodicidade dos pagamentos for «EXPI», o multiplicador da periodicidade dos pagamentos é 1. Se a periodicidade de pagamento for intradiária, a periodicidade de pagamento é «DAIL» e o multiplicador da periodicidade de pagamento é 0.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
89	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 1 – período	Período correspondente ao período de referência da taxa variável da componente 1.
90	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 1 – multiplicador	Multiplicador do período correspondente ao período de referência da taxa variável da componente 1.
91	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 1	Quando aplicável: unidade de tempo associada à periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos, por exemplo, dia, semana, mês, ano ou prazo do fluxo de pagamentos à taxa variável da componente 1.
92	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 1	Quando aplicável: número de unidades de tempo (expresso pela periodicidade dos pagamentos) que determina a frequência com que ocorrem as datas periódicas dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 1. Por exemplo, uma transação com pagamentos que ocorram de dois em dois meses é representada por uma periodicidade de pagamento «MNTM» (mensal) e por um multiplicador da periodicidade de pagamento que é 2. Estes dados não são aplicáveis se a periodicidade de pagamentos for «ADHO». Se a periodicidade dos pagamentos for «EXPI», o multiplicador da

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			periodicidade dos pagamentos é 1. Se a periodicidade de pagamento for intradiária, a periodicidade de pagamento é «DAIL» e o multiplicador da periodicidade de pagamento é 0.
93	Secção 2H - Taxas de juro	<i>Spread</i> da componente 1	<p>Uma indicação do <i>spread</i> da componente 1, se aplicável: para as transações de derivados OTC com pagamentos periódicos (por exemplo, <i>swaps</i> de taxa de juro fixa/variável, <i>swaps</i> de taxa de juro, <i>swaps</i> de mercadorias).</p> <ul style="list-style-type: none"> • <i>spread</i> do preço de referência do índice individual da(s) componente(s) variável(is), no caso de existir um <i>spread</i> de uma ou mais componentes variáveis. • diferença entre os preços de referência dos dois índices das componentes variáveis.
94	Secção 2H - Taxas de juro	Moeda do <i>spread</i> da componente 1	Quando aplicável: a moeda em que está expresso o <i>spread</i> da componente 1. Estes dados só são aplicáveis se o <i>spread</i> for expresso em valor monetário.
95	Secção 2H - Taxas de juro	Taxa fixa da componente 2	Uma indicação da taxa fixa da componente 2 utilizada, se aplicável.
96	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias da taxa	Quando aplicável: Convenção sobre a

	Secção	Campo	Dados a comunicar
		fixa da componente 2	contagem de dias (muitas vezes também referida como fração de contagem de dias, base de contagem de dias ou método de contagem de dias) que determina a forma como os pagamentos de juros são calculados. É utilizada para calcular a fração anual do período de cálculo e indica o número de dias do período de cálculo dividido pelo número de dias do ano.
97	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade de pagamento à taxa fixa da componente 2	Quando aplicável: unidade de tempo associada à periodicidade dos pagamentos, por exemplo, dia, semana, mês, ano ou prazo do fluxo de pagamentos à taxa fixa da componente 2.
98	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa fixa da componente 2	Quando aplicável: número de unidades de tempo (expresso pela periodicidade dos pagamentos) que determina a frequência com que ocorrem as datas periódicas de pagamento à taxa fixa da componente 2. Por exemplo, uma transação com pagamentos que ocorram de dois em dois meses é representada por uma periodicidade de pagamento «MNTH» (mensal) e por um multiplicador da periodicidade de pagamento que é 2. Estes dados não são aplicáveis se a periodicidade de pagamentos for «ADHO».

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			Se a periodicidade dos pagamentos for «EXPI», o multiplicador da periodicidade dos pagamentos é 1. Se a periodicidade de pagamento for intradiária, a periodicidade de pagamento é «DAIL» e o multiplicador da periodicidade de pagamento é 0.
99	Secção 2H - Taxas de juro	Identificador da taxa variável da componente 2	Quando aplicável: um identificador das taxas de juro utilizadas que são ajustadas a intervalos preestabelecidos em função de uma taxa de referência do mercado
100	Secção 2H - Taxas de juro	Indicador sobre a taxa variável da componente 2	Uma indicação da taxa de juro, se disponível.
101	Secção 2H - Taxas de juro	Designação da taxa variável da componente 2	Designação completa da taxa de juro atribuída pelo fornecedor do índice.
102	Secção 2H - Taxas de juro	Convenção sobre a contagem de dias da taxa variável da componente 2	Quando aplicável: convenção sobre a contagem de dias (muitas vezes também referida como fração de contagem de dias, base de contagem de dias ou método de contagem de dias) que determina a forma como os pagamentos de juros à taxa variável da componente 2 são calculados. É utilizada para calcular a fração anual do período de cálculo e indica o número de dias do período de cálculo dividido pelo número de dias do ano.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
103	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 2	Quando aplicável: unidade de tempo associada à periodicidade dos pagamentos, por exemplo, dia, semana, mês, ano ou prazo do fluxo de pagamentos à taxa variável da componente 2.
104	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos pagamentos à taxa variável da componente 2	Quando aplicável: número de unidades de tempo (expresso pela periodicidade dos pagamentos) que determina a frequência com que ocorrem as datas periódicas de pagamento à taxa variável da componente 2. Por exemplo, uma transação com pagamentos que ocorram de dois em dois meses é representada por uma periodicidade de pagamento «MNTH» (mensal) e por um multiplicador da periodicidade de pagamento que é 2. Estes dados não são aplicáveis se a periodicidade de pagamentos for «ADHO». Se a periodicidade dos pagamentos for «EXPI», o multiplicador da periodicidade dos pagamentos é 1. Se a periodicidade de pagamento for intradiária, a periodicidade de pagamento é «DAIL» e o multiplicador da periodicidade de pagamento é 0.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
105	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 2 – período	Período correspondente ao período de referência da taxa variável da componente 2.
106	Secção 2H - Taxas de juro	Período de referência da taxa variável da componente 2 – multiplicador	Multiplicador do período correspondente ao período de referência da taxa variável da componente 2.
107	Secção 2H - Taxas de juro	Periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 2	Quando aplicável: unidade de tempo associada à periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos, por exemplo, dia, semana, mês, ano ou prazo do fluxo de pagamentos à taxa variável da componente 2.
108	Secção 2H - Taxas de juro	Multiplicador da periodicidade dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 2	Quando aplicável: número de unidades de tempo (expresso pela periodicidade dos pagamentos) que determina a frequência com que ocorrem as datas periódicas dos ajustamentos dos pagamentos à taxa variável da componente 2. Por exemplo, uma transação com pagamentos que ocorram de dois em dois meses é representada por uma periodicidade de pagamento «MNTM» (mensal) e por um multiplicador da periodicidade de pagamento que é 2. Estes dados não são aplicáveis se a periodicidade de pagamentos for «ADHO». Se a periodicidade dos pagamentos for «EXPI», o multiplicador da

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			periodicidade dos pagamentos é 1. Se a periodicidade de pagamento for intradiária, a periodicidade de pagamento é «DAIL» e o multiplicador da periodicidade de pagamento é 0.
109	Secção 2H - Taxas de juro	<i>Spread</i> da componente 2	<p>Uma indicação do <i>spread</i> da componente 2, se aplicável: para as transações de derivados OTC com pagamentos periódicos (por exemplo, <i>swaps</i> de taxa de juro fixa ou variável, <i>swaps</i> de taxa de juro, <i>swaps</i> de mercadorias),</p> <ul style="list-style-type: none"> • <i>spread</i> do preço de referência do índice individual da(s) componente(s) variável(is), no caso de existir um <i>spread</i> de uma ou mais componentes variáveis. • diferença entre os preços de referência dos dois índices das componentes variáveis.
110	Secção 2H - Taxas de juro	Moeda do <i>spread</i> da componente 2	<p>Quando aplicável: a moeda em que está expresso o <i>spread</i> da componente 2. Estes dados só são aplicáveis se o <i>spread</i> for expresso em valor monetário.</p>

	Secção	Campo	Dados a comunicar
111	Secção 2H - Taxas de juro	<i>Spread</i> da transação do pacote	<p>Preço transacionado de todo o pacote no qual a transação de derivados comunicada é uma componente da transação do pacote.</p> <p>Preço da transação do pacote quando o preço do pacote é expresso como um <i>spread</i>, diferença entre dois preços de referência. Estes dados não são aplicáveis se:</p> <ul style="list-style-type: none"> • não está envolvido nenhum pacote, ou • é utilizado o preço da transação do pacote. <p>O <i>spread</i> e os dados conexos das transações (moeda do <i>spread</i>) que representam componentes individuais do pacote são comunicados quando disponíveis.</p> <p>O <i>spread</i> da transação do pacote pode não ser conhecido quando é comunicada uma nova transação, mas pode ser atualizado mais tarde.</p>
112	Secção 2H - Taxas de juro	Moeda do <i>spread</i> da transação do pacote	<p>Moeda em que é expresso o <i>spread</i> da transação do pacote. Estes dados não são aplicáveis se:</p> <ul style="list-style-type: none"> • não está envolvido nenhum pacote, ou • é utilizado o preço da transação do pacote, ou • o <i>spread</i> da transação do pacote é expresso em percentagem ou em pontos de base.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
113	Secção 2I - Divisas	Taxa de câmbio 1	Taxa de câmbio entre as duas moedas diferentes especificadas na transação de derivados acordada pelas contrapartes no início da transação, expressa como a taxa de câmbio da conversão da unidade monetária na moeda cotada.
114	Secção 2I - Divisas	Taxa de câmbio <i>forward</i>	Taxa de câmbio <i>forward</i> acordada entre as contrapartes no acordo contratual. É expressa como um preço da moeda de base na moeda cotada.
115	Secção 2I - Divisas	Base da taxa de câmbio	Par de moedas e ordem em que a taxa de câmbio é denominada, expressa em unidade monetária ou em moeda cotada.
116	Secção 2J - Mercadorias e licenças de emissão (geral)	Produto de base	Produto de base, tal como especificado na classificação das mercadorias no quadro 4 do anexo de [OP: inserir referência ao C(2022) 3588].
117	Secção 2J - Mercadorias e licenças de emissão (geral)	Subproduto	Subproduto — produto especificado na classificação das mercadorias no quadro 4 do anexo de [OP: inserir referência ao C(2022) 3588] Este campo exige um produto de base específico no campo.
118	Secção 2J - Mercadorias e licenças de emissão (geral)	Subproduto adicional	Subproduto adicional, tal como especificado na classificação das mercadorias no quadro 4 do anexo de [OP: inserir

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			<i>referência ao C(2022) 3588/</i> Este campo exige um subproduto específico no campo.
119	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Zona ou ponto de entrega	Ponto(s) de entrega ou zona(s) do mercado.
120	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Ponto de interconexão	Identificação da(s) fronteira(s) ou ponto(s) de fronteira de um contrato de transporte.
121	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Tipo de carga	Identificação do perfil de entrega.
	A secção dos campos 122 a 131 é reprodutível		
122	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Hora de início do intervalo de entrega	A hora de início do intervalo de entrega para cada bloco ou formato.
123	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Hora final do intervalo de entrega	A hora final do intervalo de entrega para cada bloco ou formato.
124	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Data de início da entrega	Data de início da entrega.
125	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Data final da entrega	Data final da entrega.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
126	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Duração	A duração do período de entrega.
127	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Dias da semana	Os dias da semana da entrega.
128	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Capacidade de entrega	O número de unidades incluídas na transação para cada intervalo de entrega especificado nos campos 122 e 123.
129	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Unidade de quantidade	A unidade de medida utilizada.
130	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Preço por quantidade por intervalo de tempo	Se aplicável, preço por quantidade por intervalo de tempo de entrega.
131	Secção 2K - Mercadorias e licenças de emissão (energia)	Moeda do preço por quantidade por intervalo de tempo	A moeda em que é expresso o preço por quantidade do intervalo de tempo.
132	Secção 2L - Opções	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 do contrato de derivados. No caso das opções sobre <i>swaps</i> , trata-se do

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			<p>seguinte:</p> <ul style="list-style-type: none"> - «Opção de venda» no caso de uma opção sobre <i>swaps</i> do beneficiário (<i>receiver swaption</i>), em que o comprador tem o direito de celebrar um contrato de <i>swap</i> enquanto beneficiário a taxa fixa. - «Opção de compra» no caso de uma opção sobre <i>swaps</i> do pagador (<i>payer swaption</i>), em que o comprador tem o direito de celebrar um contrato de <i>swap</i> enquanto pagador a taxa fixa. <p>Caso existam limites máximos e mínimos, trata-se do seguinte:</p> <ul style="list-style-type: none"> - «Opção de venda», se for previsto um limite mínimo. - «Opção de compra», se for previsto um limite máximo.
133	Secção 2L - Opções	Estilo da opção	Indicar se a opção pode ser exercida apenas numa data predefinida (estilo europeu), numa série de datas predefinida (estilo Bermudas) ou a qualquer momento durante o período de vigência do contrato (estilo americano).

	Secção	Campo	Dados a comunicar
134	Secção 2L - Opções	Preço de exercício	<ul style="list-style-type: none"> • Para opções que não sejam opções cambiais, opções sobre <i>swaps</i> e produtos semelhantes, o preço a que o proprietário de uma opção pode comprar ou vender o ativo subjacente da opção. • Para as opções cambiais, a taxa de câmbio a que a opção pode ser exercida, expressa como a taxa de câmbio da conversão da unidade monetária na moeda cotada. No exemplo, 0,9426 USD/EUR, USD é a unidade monetária e EUR é a moeda cotada; USD 1 = EUR 0.9426. Se o preço de exercício não for conhecido quando é comunicada uma nova transação, o preço de exercício é atualizado à medida que estiver disponível. • Para <i>swaps</i> de volatilidade e variância e produtos semelhantes, o preço de exercício de volatilidade é comunicado nestes dados.
	Os campos 135 a 137 são reprodutíveis e devem ser preenchidos no caso de derivados que envolvam tabelas de preços de exercício.		
135	Secção 2L - Opções	Data-valor do preço de exercício	Data-valor não ajustada do preço de exercício.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
136	Secção 2L - Opções	Data final do preço de exercício	Data final não ajustada do preço de exercício (não aplicável se a data final não ajustada de um dado período da tabela for consecutiva à data-valor não ajustada do período subsequente).
137	Secção 2L - Opções	Preço de exercício em vigor na data-valor associada	Preço de exercício em vigor entre a data-valor não ajustada e a data final não ajustada, incluindo esta última.
138	Secção 2L - Opções	Moeda/par de moedas do preço de exercício	Para opções sobre ações, opções sobre mercadorias e produtos semelhantes, a moeda em que o preço de exercício é denominado. Para as opções cambiais: par de moedas e ordem em que o preço de exercício é expresso. É expresso como unidade monetária por moeda cotada.
139	Secção 2L - Opções	Montante do prémio da opção	Para opções e opções sobre <i>swaps</i> de todas as classes de ativos, o montante monetário pago pelo comprador da opção. Estes dados não são aplicáveis se o instrumento não for uma opção ou não incluir qualquer opcionalidade.
140	Secção 2L - Opções	Moeda do prémio da opção	Para opções e opções sobre <i>swaps</i> de todas as classes de ativos, a moeda em que o montante do prémio da opção é denominado. Estes dados não são aplicáveis se o instrumento não for uma opção ou não incluir

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			qualquer opcionalidade.
141	Secção 2L - Opções	Data de pagamento do prémio da opção	Data não ajustada em que o prémio da opção é pago.
142	Secção 2I - Opções	Data de vencimento do subjacente	No caso das opções sobre <i>swaps</i> , a data de vencimento do <i>swap</i> subjacente.
143	Secção 2M – Derivados de crédito	Grau de prioridade	Indica a prioridade do título de dívida, do cabaz de dívida ou do índice subjacente a um derivado.
144	Secção 2M – Derivados de crédito	Entidade de referência	Identificação da entidade de referência subjacente.
145	Secção 2M – Derivados de crédito	Série	O número de série da composição do índice, quando aplicável.
146	Secção 2M – Derivados de crédito	Versão	Uma nova versão de uma série é emitida se uma das componentes entrar em incumprimento e o índice tiver de ser reponderado a fim de ter em conta o novo número de constituintes totais do índice.
147	Secção 2M – Derivados de crédito	Fator do índice	O fator a aplicar ao montante nocional (campo 55 neste quadro) para o ajustar a todos os eventos de crédito anteriores nessa série de índices.
148	Secção 2M – Derivados de crédito	Parcela	Indicação sobre se o contrato de derivados é dividido em parcelas.
149	Secção 2M – Derivados de crédito	Ponto de ligação do índice de <i>swap</i> de risco de incumprimento (CDS)	Ponto mais baixo definido em que o nível de perdas na carteira subjacente reduz o montante nocional de uma parcela. Por exemplo, o montante

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			nocional de uma parcela com um ponto de ligação de 3 % será reduzido após a ocorrência de 3 % de perdas na carteira. Estes dados não são aplicáveis se a transação não for uma transação de parcela de CDS (índice ou cabaz personalizado).
150	Secção 2M – Derivados de crédito	Ponto de desconexão do índice de CDS	Ponto definido a partir do qual as perdas na carteira subjacente deixam de reduzir o montante nocional de uma parcela. Por exemplo, o montante nocional de uma parcela com um ponto de ligação de 3 % e um ponto de desconexão de 6 % será reduzido depois de se terem registado 3 % de perdas na carteira. As perdas de 6 % na carteira esgotam o montante nocional da parcela. Estes dados não são aplicáveis se a transação não for uma transação de parcela de CDS (índice ou cabaz personalizado).
151	Secção 2N - Alterações do derivado	Tipo de ação	<ul style="list-style-type: none"> • Novo: A comunicação de um derivado, a nível da transação ou da posição, pela primeira vez. • Alteração: Uma alteração das condições ou dos pormenores de um derivado anteriormente comunicado, a nível de uma transação ou de uma posição, mas não uma correção de uma comunicação. • Correção: Uma comunicação que corrige

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			<p>os campos de dados errados de uma comunicação anteriormente apresentada.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Cessação: A cessação de um derivado existente, a nível de uma transação ou de uma posição. • Erro: A anulação de uma comunicação completa apresentada indevidamente caso o derivado, a nível da transação ou da posição, nunca tenha chegado a existir ou não esteja sujeito aos requisitos em matéria de comunicação de informações do Regulamento (UE) n.º 648/2012, tendo sido enviada por engano a um repositório de transações, ou a anulação de uma comunicação em duplicado. • Reabertura: Reabertura de um derivado, a nível de uma transação ou de uma posição, que tenha sido anulado com o tipo de ação «Erro» ou cessado por erro. • Avaliação: A atualização da avaliação de um derivado, a nível de uma transação ou de uma posição • Componente de posição: Uma comunicação de um novo derivado que esteja incluído numa comunicação de posição separada no mesmo dia.

	Secção	Campo	Dados a comunicar
152	Secção 2N - Alterações do derivado	Tipo de evento	<ul style="list-style-type: none"> • Transação: conclusão de um derivado ou renegociação das suas condições que não resulte na alteração de uma contraparte • Transferência: um evento em que parte ou a totalidade do derivado é transferida para uma contraparte 2 (e comunicada como um novo derivado) e o derivado existente é cessado ou o seu montante nocional alterado. • PTRR (redução dos riscos pós-transação, ou <i>post-trade risk reduction</i>): Exercício de redução dos riscos pós-transação • Cessação antecipada: Cessação de um derivado, a nível de transação ou de posição • Compensação: Compensação na aceção do artigo 2.º, ponto 3, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 • Exercício: O exercício de uma opção ou de uma opção sobre <i>swaps</i> por uma contraparte da transação, total ou parcialmente. • Afetação: Evento de afetação, em que um derivado existente é afetado a diferentes contrapartes e comunicado como novos derivados com montantes nocionais reduzidos. • Evento de crédito: Aplica-se apenas aos derivados de crédito. Um

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			<p>evento de crédito que resulta na alteração de um derivado, a nível de transação ou de posição</p> <p>Evento empresarial: Uma ação empresarial sobre ações subjacentes com impacto nos derivados sobre essas ações</p> <ul style="list-style-type: none"> • Inclusão na posição: Inclusão de derivados ou CFD compensados por CCP numa posição em que um derivado existente é cessado e é criada uma nova posição ou alterado o montante nocional de uma posição existente. <p>Atualização - Atualização de um derivado pendente realizada durante o período de transição, a fim de assegurar a sua conformidade com os requisitos de comunicação alterados</p>
153	Secção 2N - Alterações do derivado	Data do evento	Data em que ocorreu o evento a comunicar relacionado com o contrato de derivados e tido em conta na comunicação ou, em caso de alteração, quando a alteração entra em vigor.
154	Secção 2N - Alterações do derivado	Nível	<p>Menção que indica se a comunicação é feita a nível de transação ou de posição.</p> <p>A comunicação ao nível d posição apenas pode ser utilizada como complemento à comunicação ao nível d transação para a comunicação de eventos pós-negociação, e apenas</p>

	Secção	Campo	Dados a comunicar
			se as transações individuais nos produtos fungíveis tiverem sido substituídas pela posição.

Quadro 3

Dados	Secção	Campo	Dados a comunicar
1	Partes no derivado	Data e hora da comunicação	Data e hora da comunicação dos dados ao repositório de transações.
2	Partes no derivado	Identificação da entidade que apresenta a comunicação de informações	Caso a entidade responsável pela comunicação de informações tenha delegado essa comunicação num terceiro ou na outra contraparte, esta entidade tem de ser identificada neste campo, através de um código único. Caso contrário, a entidade responsável pela comunicação de informações deve ser identificada neste campo.
3	Partes no derivado	Entidade responsável pela comunicação de informações	Caso uma contraparte financeira seja a única responsável, nomeadamente no plano jurídico, pela comunicação de informações em nome de ambas as contrapartes nos termos do artigo 9.º, n.º 1-A, do Regulamento (UE) n.º 648/2012 e a contraparte não financeira não decida comunicar ela própria os dados dos seus contratos de derivados OTC com a contraparte financeira, o código único de identificação dessa contraparte financeira. Caso uma sociedade gestora seja responsável, nomeadamente no plano jurídico, pela comunicação de informações em nome de um organismo de investimento coletivo em valores mobiliários (OICVM) em conformidade com o artigo 9.º, n.º 1-B, desse regulamento, o código único de identificação dessa sociedade gestora. Caso um gestor de fundos de investimento alternativos (GFIA) seja responsável, nomeadamente no plano jurídico, pela comunicação de informações em nome de um fundo de investimento alternativo (FIA) em conformidade com o artigo 9.º, n.º 1-C, desse regulamento, o código único de identificação desse GFIA. Caso uma entidade autorizada responsável pela gestão e atuação em nome de uma IRPPP seja responsável, nomeadamente no plano jurídico, pela comunicação de informações em seu nome nos termos do artigo 9.º, n.º 1-

Dados	Secção	Campo	Dados a comunicar
			D, desse regulamento, o código único de identificação dessa entidade. Este campo aplica-se apenas aos derivados OTC.
4	Partes no derivado	Contraparte 1 (contraparte que comunica as informações)	Identificador da contraparte numa transação de derivados que cumpre a sua obrigação de comunicação de informações através da comunicação em questão. No caso de uma transação de derivados afetada, executada por um gestor de fundos em nome de um fundo, o fundo, e não o gestor do fundo, é indicado como a contraparte.
5	Partes no derivado	Tipo de identificador da contraparte 2	Menção que indica se o LEI foi utilizado para identificar a contraparte 2.
6	Partes no derivado	Contraparte 2	Identificador da segunda contraparte numa transação de derivados. No caso de uma transação de derivados afetada, executada por um gestor de fundos em nome de um fundo, o fundo, e não o gestor do fundo, é indicado como a contraparte.
7	Garantia	Data e hora da garantia	Data e hora a partir da qual são comunicados os valores das margens.
8	Garantia	Indicador sobre a carteira de garantias	Menção que indica se a cobertura por garantias é ou não assegurada a nível da carteira. Por «a nível de uma carteira», entende-se um conjunto de transações cujas margens são agrupadas (numa base líquida ou bruta), contrariamente ao cenário em que a margem é calculada e fornecida separadamente para cada transação individual.

Dados	Secção	Campo	Dados a comunicar
9	Garantia	Código da carteira de garantias	Se as garantias forem comunicadas numa base de carteira, um código único atribuído à carteira pela contraparte 1. Estes dados não se aplicam se a cobertura por garantias tiver sido assegurada a nível das transações, se não houver acordo de garantia ou se não for fornecida ou recebida nenhuma garantia.
10	Garantia	UTI	Identificador de transação único a que se refere o artigo 7.º de [OP: inserir referência ao C(2022) 3588].
11	Garantia	Categoria de constituição de garantias	Indicar se existe ou não um acordo de garantia entre as contrapartes. Estes dados são fornecidos para cada transação ou carteira, consoante as garantias sejam constituídas ao nível de transação ou de carteira, sendo aplicável tanto às transações compensadas como às não compensadas.
12	Garantia	Margem inicial fornecida pela contraparte 1 (pré-margem de avaliação)	Valor monetário da margem inicial fornecida pela contraparte 1, incluindo qualquer margem em trânsito e na pendência de liquidação. Se as garantias forem constituídas ao nível da carteira, a margem inicial fornecida diz respeito à totalidade da carteira; se as garantias forem constituídas para transações únicas, a margem inicial fornecida diz respeito a essa transação única. Este campo refere-se ao valor atual total da margem inicial, e não à sua variação diária. Os dados referem-se tanto a transações não compensadas como a transações compensadas centralmente. Para as transações compensadas centralmente, os dados não incluem as contribuições para o fundo de proteção contra o incumprimento, nem as garantias fornecidas como provisões de liquidez relativamente à CCP, ou seja, linhas de crédito autorizadas. Se a margem inicial fornecida for expressa em mais do que uma moeda, esses montantes são convertidos numa única moeda escolhida pela

Dados	Secção	Campo	Dados a comunicar
			contraparte 1 e comunicados como um valor total.
13	Garantia	Margem inicial fornecida pela contraparte 1 (pós-margem de avaliação)	<p>Valor monetário da margem inicial fornecida pela contraparte 1, incluindo qualquer margem em trânsito e na pendência de liquidação.</p> <p>Se as garantias forem constituídas ao nível da carteira, a margem inicial fornecida diz respeito à totalidade da carteira; se as garantias forem constituídas para transações únicas, a margem inicial fornecida diz respeito a essa transação única.</p> <p>Este campo refere-se ao valor atual total da margem inicial após aplicação da margem de avaliação (se aplicável), e não à sua variação diária.</p> <p>Os dados referem-se tanto a transações não compensadas como a transações compensadas centralmente. Para as transações compensadas centralmente, os dados não incluem as contribuições para o fundo de proteção contra o incumprimento, nem as garantias fornecidas como provisões de liquidez relativamente à CCP, ou seja, linhas de crédito autorizadas.</p> <p>Se a margem inicial fornecida for expressa em mais do que uma moeda, esses montantes são convertidos numa única moeda escolhida pela contraparte 1 e comunicados como um valor total.</p>
14	Garantia	Moeda da margem inicial fornecida	<p>Moeda em que é denominada a margem inicial fornecida.</p> <p>Se a margem inicial fornecida for denominada em mais do que uma moeda, estes dados refletem uma das moedas para as quais a contraparte 1 optou por converter todos os valores das margens iniciais fornecidas.</p>

Dados	Secção	Campo	Dados a comunicar
15	Garantia	Margem de variação fornecida pela contraparte 1 (pré-margem de avaliação)	<p>Valor monetário da margem de variação fornecida pela contraparte 1, incluindo a margem liquidada em numerário e qualquer margem em trânsito e na pendência de liquidação.</p> <p>A margem de variação contingente não está incluída.</p> <p>Se as garantias forem constituídas ao nível da carteira, a margem de variação fornecida diz respeito à totalidade da carteira; se as garantias forem constituídas para transações únicas, a margem de variação fornecida diz respeito a essa transação única.</p> <p>Este campo refere-se ao valor atual total da margem de variação, acumulado desde a primeira comunicação das margens de variação fornecidas relativamente à carteira ou transação.</p> <p>Se a margem de variação fornecida for expressa em mais do que uma moeda, esses montantes são convertidos numa única moeda escolhida pela contraparte 1 e comunicados como um valor total.</p>
16	Garantia	Margem de variação fornecida pela contraparte 1 (pós-margem de avaliação)	<p>Valor monetário da margem de variação fornecida pela contraparte 1, incluindo a margem liquidada em numerário e qualquer margem em trânsito e na pendência de liquidação.</p> <p>A margem de variação contingente não está incluída.</p> <p>Se as garantias forem constituídas ao nível da carteira, a margem de variação fornecida diz respeito à totalidade da carteira; se as garantias forem constituídas para transações únicas, a margem de variação fornecida diz respeito a essa transação única.</p> <p>Este campo refere-se ao valor atual total da margem de variação, após aplicação da margem de avaliação, se aplicável, acumulado desde a primeira comunicação das margens de variação fornecidas relativamente à carteira ou transação.</p> <p>Se a margem de variação fornecida for</p>

Dados	Secção	Campo	Dados a comunicar
			expressa em mais do que uma moeda, esses montantes são convertidos numa única moeda escolhida pela contraparte 1 e comunicados como um valor total.
17	Garantia	Moeda das margens de variação fornecidas	Moeda em que é denominada a margem de variação fornecida. Se a margem de variação fornecida for denominada em mais do que uma moeda, estes dados refletem uma das moedas para as quais a contraparte 1 optou por converter todos os valores das margens de variação fornecidas.
18	Garantia	Garantias excedentárias fornecidas pela contraparte 1	Valor monetário de quaisquer garantias adicionais fornecidas pela contraparte 1, separadas e independentes da margem inicial e da margem de variação. Este campo refere-se ao valor atual total das garantias excedentárias antes da aplicação da margem de avaliação, se aplicável, e não à sua variação diária. Qualquer montante das margens inicial ou de variação fornecidas que exceda a margem inicial ou a margem de variação exigida é comunicado, respetivamente, como parte da margem inicial fornecida ou da margem de variação fornecida, em vez de ser incluído como garantias excedentárias fornecidas. Relativamente às transações compensadas centralmente, as garantias excedentárias só são comunicadas na medida em que possam ser afetadas a uma carteira ou operação específica.
19	Garantia	Moeda das garantias excedentárias fornecidas	Moeda em que são denominadas as garantias excedentárias fornecidas. Se as garantias excedentárias fornecidas forem denominadas em mais do que uma moeda, estes dados refletem uma das moedas para as quais a contraparte 1 optou por converter todos os valores das garantias excedentárias fornecidas.

Dados	Secção	Campo	Dados a comunicar
20	Garantia	Margem inicial cobrada pela contraparte 1 (pré-margem de avaliação)	<p>Valor monetário da margem inicial cobrada pela contraparte 1, incluindo qualquer margem em trânsito e na pendência de liquidação.</p> <p>Se as garantias forem constituídas ao nível de carteira, a margem inicial cobrada diz respeito à totalidade da carteira; se as garantias forem constituídas para transações únicas, a margem inicial cobrada diz respeito a essa transação única.</p> <p>Este campo refere-se ao valor atual total da margem inicial, e não à sua variação diária. Os dados referem-se tanto a transações não compensadas como a transações compensadas centralmente. Relativamente às transações compensadas centralmente, os dados não incluem as garantias cobradas pela CCP no âmbito da sua atividade de investimento.</p> <p>Se a margem inicial cobrada for expressa em mais do que uma moeda, esses montantes são convertidos numa única moeda escolhida pela contraparte 1 e comunicados como um valor total.</p>
21	Garantia	Margem inicial cobrada pela contraparte 1 (pós-margem de avaliação)	<p>Valor monetário da margem inicial cobrada pela contraparte 1, incluindo qualquer margem em trânsito e na pendência de liquidação.</p> <p>Se as garantias forem constituídas ao nível de carteira, a margem inicial cobrada diz respeito à totalidade da carteira; se as garantias forem constituídas para transações únicas, a margem inicial cobrada diz respeito a essa transação única.</p> <p>Este campo refere-se ao valor atual total da margem inicial após aplicação da margem de avaliação, se aplicável, e não à sua variação diária.</p> <p>Os dados referem-se tanto a transações não compensadas como a transações compensadas centralmente. Relativamente às transações compensadas centralmente, os dados não incluem as garantias cobradas pela CCP no âmbito da sua atividade de investimento.</p>

Dados	Secção	Campo	Dados a comunicar
			Se a margem inicial cobrada for expressa em mais do que uma moeda, esses montantes são convertidos numa única moeda escolhida pela contraparte 1 e comunicados como um valor total.
22	Garantia	Moeda da margem inicial cobrada	Moeda em que é denominada a margem inicial cobrada. Se a margem inicial cobrada for denominada em mais do que uma moeda, estes dados refletem uma das moedas para as quais a contraparte 1 optou por converter todos os valores das margens iniciais cobradas.
23	Garantia	Margem de variação cobrada pela contraparte 1 (pré-margem de avaliação)	Valor monetário da margem de variação cobrada pela contraparte 1, incluindo a margem liquidada em numerário e qualquer margem em trânsito e na pendência de liquidação. A margem de variação contingente não está incluída. Se as garantias forem constituídas ao nível de carteira, a margem de variação cobrada diz respeito à totalidade da carteira; se as garantias forem constituídas para transações únicas, a margem de variação cobrada diz respeito a essa transação única. Este campo refere-se ao valor atual total da margem de variação, acumulado desde a primeira comunicação das margens de variação cobradas relativamente à carteira/transação. Se a margem de variação cobrada for expressa em mais do que uma moeda, esses montantes são convertidos numa única moeda escolhida pela contraparte 1 e comunicados como um valor total.
24	Garantia	Margem de variação cobrada pela contraparte 1 (pós-margem de avaliação)	Valor monetário da margem de variação cobrada pela contraparte 1, incluindo a margem liquidada em numerário e qualquer margem que esteja em trânsito e na pendência de liquidação. A margem de variação contingente não está

Dados	Secção	Campo	Dados a comunicar
			<p>incluída.</p> <p>Se as garantias forem constituídas ao nível de carteira, a margem de variação cobrada diz respeito à totalidade da carteira; se as garantias forem constituídas para transações únicas, a margem de variação cobrada diz respeito a essa transação única.</p> <p>Este campo refere-se ao valor atual total da margem de variação cobrada, após aplicação da margem de avaliação, se aplicável, acumulado desde a primeira comunicação das margens de variação cobradas relativamente à carteira/transação.</p> <p>Se a margem de variação cobrada for expressa em mais do que uma moeda, esses montantes são convertidos numa única moeda escolhida pela contraparte 1 e comunicados como um valor total.</p>
25	Garantia	Moeda da margem de variação cobrada	<p>Moeda em que é denominada a margem de variação cobrada.</p> <p>Se a margem de variação cobrada for denominada em mais do que uma moeda, estes dados refletem uma das moedas para as quais a contraparte 1 optou por converter todos os valores das margens de variação cobradas.</p>
26	Garantia	Garantias excedentárias cobradas pela contraparte 1	<p>Valor monetário de quaisquer garantias adicionais cobradas pela contraparte 1, separadas e independentes da margem inicial e da margem de variação. Estes dados referem-se ao valor atual total das garantias excedentárias antes da aplicação da margem de avaliação, se aplicável, e não à sua variação diária.</p> <p>Qualquer montante das margens inicial ou de variação cobrado que exceda a margem inicial ou a margem de variação exigida é comunicado, respetivamente, como parte da margem inicial cobrada ou da margem de variação cobrada, em vez de ser incluído como garantia excedentária cobrada.</p> <p>Relativamente às transações compensadas</p>

Dados	Secção	Campo	Dados a comunicar
			centralmente, as garantias excedentárias só são comunicadas na medida em que possam ser afetadas a uma carteira ou operação específica.
27	Garantia	Moeda das garantias excedentárias cobradas	Moeda em que são denominadas as garantias excedentárias cobradas. Se as garantias excedentárias forem denominadas em mais do que uma moeda, estes dados refletem uma das moedas para as quais a contraparte 1 optou por converter todos os valores das garantias excedentárias cobradas.
28	Garantia	Tipo de ação	A comunicação deve incluir um dos seguintes tipos de ação: a) Um novo saldo das margens ou uma eventual alteração dos pormenores das margens deve ser identificado como «Atualização da margem»; b) Uma correção de campos de dados que foram apresentados indevidamente numa comunicação anterior deve ser identificada como «Correção».
29	Garantia	Data do evento	Data em que ocorreu o evento a comunicar relacionado com o contrato de derivados e que é tido em conta na comunicação. Em caso de atualização das garantias - a data em que são fornecidas as informações contidas na comunicação.