

**REGULAMENTO (UE) 2019/113 DO BANCO CENTRAL EUROPEU****de 7 de dezembro de 2018****que altera o Regulamento (UE) n.º 1333/2014 relativo às estatísticas de mercados monetários (BCE/2018/33)**

O CONSELHO DO BANCO CENTRAL EUROPEU,

Tendo em conta o Tratado sobre o Funcionamento da União Europeia,

Tendo em conta os Estatutos do Sistema Europeu de Bancos Centrais e do Banco Central Europeu, nomeadamente o artigo 5.º,

Tendo em conta o Regulamento (CE) n.º 2533/98 do Conselho, de 23 de novembro de 1998, relativo à compilação de informação estatística pelo Banco Central Europeu <sup>(1)</sup>, nomeadamente o artigo 5.º, n.º 1, e o artigo 6.º, n.º 4,

Consultada a Comissão Europeia,

Considerando o seguinte:

- (1) O Regulamento (UE) n.º 1333/2014 do Banco Central Europeu (ECB/2014/48) <sup>(2)</sup> impõe o reporte de dados estatísticos pelos agentes inquiridos para que o Sistema Europeu de Bancos Centrais (SEBC) possa produzir as estatísticas sobre o mercado monetário do euro necessárias ao desempenho das suas atribuições.
- (2) Para garantir a disponibilidade de estatísticas de elevada qualidade referentes ao mercado monetário, torna-se necessário alterar algumas disposições do Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48). É especialmente importante garantir que cada agente inquirido comunique ao Banco Central Europeu (BCE) ou ao banco central nacional pertinente (BCN) todas as operações realizadas entre os agentes inquiridos e as sociedades financeiras (com exceção dos bancos centrais, sempre que a operação não tenha fins de investimento), bem como administrações públicas e determinadas sociedades não financeiras. É ainda necessário garantir que a recolha de dados beneficia da utilização obrigatória alargada do identificador de entidade jurídica (*Legal Entity Identifier/LEI*) na comunicação de dados na União.
- (3) Dada a importância de se assegurar a disponibilidade de estatísticas atualizadas sobre o mercado monetário do euro, é também necessário harmonizar e reforçar as obrigações dos agentes inquiridos quanto à transmissão atempada de informação aos BCN ou ao BCE.
- (4) Devem ser tomadas medidas de precaução para garantir que a informação estatística seja recolhida, compilada e transmitida pelos agentes inquiridos de um modo que proteja a integridade da informação. É importante, em especial, salientar que a informação estatística recebida pelos BCN ou pelo BCE deve ser imparcial, ou seja, deve constituir uma representação neutra de operações observáveis realizadas em condições de igualdade de concorrência pelo agente inquirido, objetiva e fiável, de modo a respeitar os princípios gerais contidos no Compromisso Público do SEBC no domínio das estatísticas europeias <sup>(3)</sup>. Além disso, os agentes inquiridos devem garantir que os eventuais erros na informação estatística comunicada sejam corrigidos e comunicados ao BCE e ao BCN pertinente o mais rapidamente possível.
- (5) Com a implementação das presentes disposições, o SEBC poderá dispor de informação estatística mais atualizada, abrangente, pormenorizada, harmonizada e fiável sobre o mercado monetário do euro, o que permitirá uma análise mais aprofundada do mecanismo de transmissão da política monetária. Além disso, os dados recolhidos podem ser utilizados para o desenvolvimento e administração de uma taxa de juro *overnight* aplicável a operações em euros e sem garantia.
- (6) Havendo, por conseguinte, que alterar em conformidade o Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48),

<sup>(1)</sup> JO L 318 de 27.11.1998, p. 8.

<sup>(2)</sup> Regulamento (UE) n.º 1333/2014 do Banco Central Europeu, de 26 de novembro de 2014, relativo às estatísticas de mercados monetários (BCE/2014/48) (JO L 359 de 16.12.2014, p. 97).

<sup>(3)</sup> Disponível no sítio Web do BCE em [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu).

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

### Artigo 1.º

#### Alterações

O Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) é alterado do seguinte modo:

1) O artigo 1.º é alterado do seguinte modo:

a) É aditado o seguinte n.º 5-A:

«5-A) «Sociedades financeiras», as unidades institucionais dotadas de personalidade jurídica que são produtores mercantis e cuja atividade principal consiste em produzir serviços financeiros conforme definido no sistema europeu de contas revisto (SEC 2010) instituído pelo Regulamento (UE) n.º 549/2013 do Parlamento Europeu e do Conselho (\*);

(\*) Regulamento (UE) n.º 549/2013 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 21 de maio de 2013, relativo ao sistema europeu de contas nacionais e regionais na União Europeia (JO L 174 de 26.6.2013, p. 1).».

b) Os n.ºs 3 a 5 são suprimidos.

c) O n.º 9 passa a ter a seguinte redação:

«9. «Estatísticas do mercado monetário», as estatísticas referentes às operações em instrumentos monetários com e sem garantia e sobre derivados, realizadas no período de reporte pertinente entre agentes inquiridos e sociedades financeiras (com exceção dos bancos centrais, sempre que a operação não tenha fins de investimento), administrações públicas ou sociedades não financeiras classificadas como «grossistas» de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez, mas excluindo operações intragrupo;»;

d) O n.º 14 passa a ter a seguinte redação:

«14. «População inquirida de referência», as IFM residentes na área do euro, com exceção dos bancos centrais e FMM, que aceitem depósitos denominados em euros e/ou emitam outros instrumentos de dívida e/ou concedam os empréstimos denominados em euros enumerados nos anexos I, II e III, de ou a outras sociedades financeiras, administrações públicas ou sociedades não financeiras;».

e) É aditado o seguinte n.º 20-A:

«20-A) «Instituição de crédito», o mesmo que no artigo 4.º, n.º 1, ponto 1), do Regulamento (UE) n.º 575/2013 do Parlamento Europeu e do Conselho (\*);

(\*) Regulamento (UE) n.º 575/2013 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 26 de junho de 2013, relativo aos requisitos prudenciais para as instituições de crédito e para as empresas de investimento e que altera o Regulamento (UE) n.º 648/2012 (JO L 176 de 27.6.2013, p. 1).».

f) O n.º 25 passa a ter a seguinte redação:

«25. «Swap de taxa de juro *overnight*» (*overnight index swap/OIS*), uma operação de permuta financeira de taxa de juro em que a taxa de juro periódica variável equivale à média geométrica de uma taxa *overnight* (ou de uma taxa de índice *overnight*) durante um período determinado. O pagamento final é calculado como a diferença entre a taxa de juro fixa e a taxa de juro *overnight* composta registada ao longo da duração da OIS e aplicada ao valor nominal da operação.».

2) O artigo 3.º é alterado do seguinte modo:

a) O n.º 1 passa a ter a seguinte redação:

«1. Para efeitos da elaboração regular de estatísticas do mercado monetário, os agentes inquiridos devem reportar ao BCN do Estado-Membro em que sejam residentes, numa base consolidada abrangendo todas as suas sucursais situadas na União ou nos países da AECL (EFTA), informação estatística diária referente aos instrumentos do mercado monetário. A informação estatística exigida é a especificada nos anexos I, II e III. Os agentes inquiridos devem reportar a informação estatística exigida em conformidade com as normas mínimas em matéria de transmissão, exatidão, conformidade concetual, revisões e integridade dos dados estabelecidas no anexo IV. Os BCN devem transmitir ao BCE a informação estatística recebida dos agentes inquiridos em conformidade com o disposto no artigo 4.º, n.º 2, do presente regulamento.».

b) O n.º 2 passa a ter a seguinte redação:

«2. Os BCN devem definir e implementar os procedimentos de reporte a observar pelos agentes inquiridos relativamente aos instrumentos do mercado monetário. Estes procedimentos de reporte devem garantir o fornecimento da informação estatística exigida, e permitir a verificação cabal da observância das normas mínimas estabelecidas no anexo IV.».

c) O n.º 5 passa a ter a seguinte redação:

«5. Os BCN devem definir e implementar os procedimentos de reporte a observar pelos novos agentes inquiridos de acordo com os respetivos requisitos de reporte estatístico nacionais. Os BCN devem assegurar que os procedimentos de reporte estatístico nacionais obrigam os novos agentes inquiridos nacionais a cumprir requisitos equivalentes aos previstos nos artigos 6.º a 8.º, 10.º, n.º 3, 11.º e 12.º do presente regulamento. Os BCN devem assegurar que esses procedimentos de reporte fornecem a informação estatística exigida e permitem a verificação cabal da observância das normas mínimas estabelecidas no Anexo IV.».

3) O artigo 4.º é alterado do seguinte modo:

a) O n.º 1 passa a ter a seguinte redação:

«1. No caso de um BCN decidir, nos termos do artigo 3.º, n.º 3, que os agentes inquiridos devem reportar diretamente ao BCE a informação estatística especificada nos anexos I, II e III, os agentes inquiridos devem transmitir tal informação ao BCE uma vez por dia, entre as 18h00 da data da transação e as 07h00 do primeiro dia de liquidação do TARGET2 que se seguir à referida data [hora da Europa Central (*Central European Time/CET*)] (\*);

(\*) O CET tem em conta a mudança para a hora de verão da Europa Central.».

b) O n.º 2 passa a ter a seguinte redação:

«2. Em todas as situações, com exceção das previstas no n.º 1, os BCN devem transmitir ao BCE a informação estatística diária sobre o mercado monetário prevista nos anexos I, II e III que os mesmos recebam dos agentes inquiridos selecionados nos termos do artigo 2.º, n.ºs 2, 3 e 4, ou de novos agentes inquiridos selecionados nos termos do artigo 2.º, n.º 6, uma vez por dia, antes das 07h00 CET do primeiro dia de liquidação do TARGET2 que se seguir à data da transação.»;

c) É aditado o seguinte n.º 5:

«5. Na avaliação da questão de se saber se um agente inquirido cumpriu os requisitos previstos neste artigo, para os efeitos do regime de incumprimento em matéria de reporte estatístico do BCE a violação de qualquer norma mínima em matéria de transmissão prevista no n.º 1, alíneas i) e ii), do anexo IV constitui uma situação de incumprimento do mesmo tipo das de um requisito de reporte.»;

4) O artigo 5.º é suprimido;

5) O anexo I do Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) é substituído pelo texto constante do anexo I do presente regulamento;

6) O anexo II do Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) é substituído pelo texto constante do anexo II do presente regulamento;

7) O anexo III do Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) é substituído pelo texto constante do anexo III do presente regulamento; e

8) O anexo IV do Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) é substituído pelo texto constante do anexo IV do presente regulamento.

#### Artigo 2.º

#### Disposições finais

O presente regulamento entra em vigor no vigésimo dia seguinte ao da sua publicação no *Jornal Oficial da União Europeia*.

O presente regulamento é aplicável a partir de 15 de março de 2019.

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

Feito em Frankfurt am Main, em 7 de dezembro de 2018.

*Pelo Conselho do BCE*

*O Presidente do BCE*

Mario DRAGHI

---

## ANEXO I

## «ANEXO I

**Regime de reporte das estatísticas do mercado monetário relativas a operações com garantia**

## PARTE 1

**TIPO DE INSTRUMENTOS**

Os agentes inquiridos devem reportar ao Banco Central Europeu (BCE) ou ao banco central nacional (BCN) em causa todos os acordos de recompra e operações efetuadas ao abrigo dos mesmos, incluindo acordos de recompra (repos) tripartidos, denominados em euros e com uma data de vencimento não superior a um ano (definidos como operações com uma data de vencimento não superior a 397 dias após a data da liquidação), celebrados entre o agente inquirido e sociedades financeiras (com exceção dos bancos centrais, sempre que a operação não tenha fins de investimento), administrações públicas ou sociedades não financeiras classificadas como «grossistas» de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez. Ficam excluídas as operações intragrupo.

## PARTE 2

**TIPO DE DADOS**

1. Dados baseados no tipo de operação (\*), a reportar relativamente a cada operação:

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se aplicável) e outras qualificações
Estatuto da operação reportada	Este atributo especifica se a operação é uma nova operação, uma alteração de operação anteriormente reportada, um cancelamento ou uma correção de operação anteriormente reportada.	
Estatuto de novação	Este atributo especifica se a operação é uma novação.	
Identificador único da operação	O código único que permite identificar uma transação no respetivo segmento de mercado.	O preenchimento deste campo é obrigatório, se os dados estiverem disponíveis.
Identificação exclusiva da operação	O identificador de operação interno único utilizado pelo agente inquirido para cada operação. A identificação exclusiva da operação é única em relação a qualquer operação reportada por segmento do mercado monetário e agente inquirido.	
Identificação exclusiva da operação conexa	O identificador da operação interno único utilizado pelo agente inquirido para a transação inicial que foi subsequentemente objeto de novação.	O preenchimento deste campo é obrigatório, se aplicável.
Identificação exclusiva da operação da contraparte	A identificação exclusiva da operação atribuída pela contraparte do agente inquirido à mesma operação.	O preenchimento deste campo é obrigatório se os dados estiverem disponíveis.

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se aplicável) e outras qualificações
Identificação da contraparte	Código de identificação a ser utilizado para reconhecer a contraparte do agente inquirido na operação reportada.	O código Identificador de Entidade Jurídica ( <i>Legal Entity Identifier/LEI</i> ) deve ser utilizado sempre que tal código seja atribuído à contraparte. Se não for atribuído um código LEI, devem ser reportados o setor e a localização da contraparte.
Setor da contraparte	Setor institucional da contraparte	Obrigatório, se não for fornecida a identificação da contraparte.
Localização da contraparte	Código de país ISO (atribuído pela <i>International Organisation for Standardisation</i> ) do país onde a contraparte está sediada.	Obrigatório, se não for fornecida a identificação da contraparte.
Identificação do agente tripartido	Identificador de contraparte do agente tripartido.	O preenchimento deste campo só é obrigatório para operações de agentes tripartidos O código LEI deve ser utilizado sempre que tal código tenha sido atribuído ao agente.
Data do reporte	Data e hora de início e de termo do período a que se referem os dados de operação contidos no ficheiro.	
Carimbo de data eletrónico	A hora a que a operação foi concluída ou contabilizada.	
Data da transação	Data em que as partes efetuam a operação financeira.	
Data da liquidação	A data em que o numerário foi inicialmente trocado pelo ativo conforme contratualmente acordado.	No caso da renovação de acordos de recompra com prazo em aberto, esta será a data em que a renovação seja liquidada (ainda que não haja lugar à troca de numerário).
Data de vencimento	A data de recompra, ou seja, a data em que o numerário deve ser devolvido ou recebido em troca do ativo entregue ou recebido como ativo de garantia.	
Tipo de operação	Este atributo especifica se a operação é realizada para contrair ou conceder um empréstimo de numerário.	
Valor nominal da operação	Montante em euros inicialmente obtido ou concedido a título de empréstimo.	
Tipo de taxa	Atributo utilizado para indicar se o instrumento é de taxa fixa ou variável.	
Taxa da operação	A taxa de juro, expressa de acordo com a convenção do mercado monetário «número efectivo de dias/360», à qual o acordo de recompra foi celebrado e o numerário emprestado deve ser reembolsado.	O preenchimento deste campo só é obrigatório para instrumentos de taxa fixa.

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se aplicável) e outras qualificações
Índice da taxa de referência	O Número Internacional de Identificação de Títulos ( <i>International Securities Identification Number/ISIN</i> ) da taxa de referência subjacente com base na qual são calculadas as prestações dos juros.	O preenchimento deste campo só é obrigatório para instrumentos de taxa variável.
Diferencial de pontos base	O número de pontos base adicionados (se o diferencial for positivo) ou subtraídos (se negativo) à taxa de referência subjacente para calcular a taxa de juro efetiva aplicável a um determinado período no momento da emissão do instrumento de taxa variável.	O preenchimento deste campo só é obrigatório para instrumentos de taxa variável.
ISIN do ativo de garantia	O ISIN do ativo utilizado como ativo de garantia.	O preenchimento deste campo é opcional para os acordos de recompra tripartidos não concluídos contra a prestação de um cabaz de títulos de dívida para o qual exista um ISIN genérico, ou para os tipos de ativos de garantia para os quais não esteja disponível um ISIN. Quando não seja fornecido o ISIN do ativo utilizado como ativo de garantia, é necessário indicar o tipo de ativo de garantia, o setor do emitente do ativo de garantia e o conjunto de ativos de garantia.
Conjunto de ativos de garantia	Atributo que indica se o ativo entregue como ativo de garantia é um conjunto de ativos de garantia.	
Tipo de ativo de garantia	Atributo que identifica a classe de ativos entregue como ativo de garantia.	Obrigatório, se não for fornecido o ISIN do ativo de garantia.
Setor do emitente do ativo de garantia	O setor institucional do emitente do ativo de garantia.	Obrigatório, se não for fornecido o ISIN do ativo de garantia.
Indicador de ativo de garantia especial	Para identificar todos os acordo de recompra concluídos contra a prestação de ativos de garantia gerais e especiais.	Atributo a preencher apenas se tal for possível ao agente inquirido.
Valor nominal do(s) ativo(s) de garantia	Valor nominal em euros dos ativos entregues como ativo de garantia.	Opcional para acordos de recompra tripartidos e para qualquer operação em que os ativos entregues não sejam identificados mediante um ISIN.
Margem de avaliação dos ativos de garantia	Medida de controlo do risco aplicada aos ativos de garantia subjacentes mediante a qual o valor desses ativos é calculado como o valor de mercado dos ativos deduzido de uma determinada percentagem ( <i>haircut</i> ).	O preenchimento deste campo só é obrigatório para as operações com um único ativo de garantia.

## 2. Limiar de relevância

As operações realizadas com sociedades não financeiras só deverão ser reportadas quando estas últimas estiverem classificadas como «grossistas» de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez (\*\*).

(\*) As normas em matéria de transmissão eletrónica e as especificações técnicas destes dados são estabelecidas separadamente. Disponível (em inglês) no sítio Web do BCE em [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)

(\*\*) Ver Comité de Basileia de Supervisão Bancária, «*Basel III: The Liquidity Coverage Ratio and liquidity risk monitoring tools*» [Basileia III: o rácio de cobertura de liquidez e os instrumentos de controlo do risco de liquidez], janeiro de 2013, págs. 23 a 37, disponível no sítio Web do Banco de Pagamentos Internacionais em [www.bis.org](http://www.bis.org).»

## ANEXO II

## «ANEXO II

**Regime de reporte das estatísticas do mercado monetário relativas a operações sem garantia**

## PARTE 1

**TIPO DE INSTRUMENTOS**

1. Os agentes inquiridos devem reportar ao Banco Central Europeu (BCE) ou ao banco central nacional (BCN) competente:
- Todas as operações de contração de empréstimo com utilização dos instrumentos descritos no quadro abaixo, denominadas em euros e com uma data de vencimento não superior a um ano (definidas como operações com uma data de vencimento não superior a 397 dias após a data da transação), realizadas pelo agente inquirido junto de sociedades financeiras (com exceção dos bancos centrais, sempre que a operação não tenha fins de investimento), administrações públicas ou sociedades não financeiras classificadas como «grossistas» (*wholesale*) de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez.
  - Todas as operações de concessão de empréstimo denominadas em euros a outras instituições de crédito com uma data de vencimento não superior a um ano (definidas como operações com uma data de vencimento não superior a 397 dias após a data da liquidação) mediante depósitos sem garantia ou contas *call* ou através da compra às instituições de crédito emitentes de papel comercial, certificados de depósito, instrumentos de taxa variável e outros títulos de dívida com data de vencimento até um ano.
- Para efeitos do n.º 1, alíneas a) e b), acima, ficam excluídas as operações intragrupo.
2. O quadro abaixo fornece uma descrição detalhada e normalizada das categorias de instrumentos utilizados em operações que os agentes inquiridos estão obrigados a reportar ao BCE. No caso de os agentes inquiridos estarem obrigados a reportar as operações ao respetivo BCN, o BCN competente deve transpor a nível nacional estas descrições de categorias de instrumentos de acordo com o previsto no presente regulamento.

Tipo de instrumento	Descrição
Depósitos	Depósitos remunerados sem garantia [incluindo as contas <i>call</i> ( <i>call accounts</i> ), mas não as contas correntes], que sejam reembolsáveis à vista ou tenham um prazo de vencimento não superior a um ano, ou seja, até 397 dias após a data da liquidação e que sejam aceites ou efetuados a título de empréstimo pelo agente inquirido.
Conta <i>call</i> / <i>Call money</i>	Contas em numerário sujeitas a variações diárias da taxa de juro aplicável, dando lugar ao pagamento ou ao cálculo de juros a intervalos regulares, e com prazo de pré-aviso para realização de levantamentos. Conta de poupança com prazo de pré-aviso para realização de levantamentos.
Certificados de depósito	Instrumento de taxa de juro fixa emitido por uma IFM que confere ao seu detentor o direito a uma determinada taxa de juro fixa durante um prazo que pode ir até um ano, ou seja, até 397 dias após a data da liquidação, que é remunerado ou emitido a desconto.
Papel comercial	Instrumento de dívida sem garantia emitido por uma IFM com um prazo de vencimento não superior a um ano, ou seja, até 397 dias após a data da liquidação, que é remunerado ou emitido a desconto.
Papel comercial garantido por ativos	Instrumento de dívida emitido por uma IFM com um prazo de vencimento não superior a um ano, ou seja, até 397 dias após a data da liquidação, que é remunerado ou emitido a desconto e garantido por alguma forma de garantia.
Instrumento de taxa variável	Instrumento de dívida cujas prestações de juros são calculadas com base no valor, ou seja, fixação de uma taxa de referência de base, como a taxa de juro interbancária da área do euro ( <i>Euro Interbank Offered Rate</i> /Euribor), em datas pré-definidas, conhecidas como datas de <i>fixing</i> (fixação do valor), e com data de vencimento não superior a um ano, ou seja, até 397 dias após a data da liquidação.



Tipo de instrumento	Descrição
Outros títulos de dívida de curto prazo	<p>Títulos não subordinados, exceto ações ou participações com data de vencimento até um ano, ou seja, até 397 dias após a data da liquidação, emitidos pelos agentes inquiridos, que sejam instrumentos normalmente negociáveis e transacionados em mercados secundários ou que possam ser compensados no mercado e que não confirmam ao detentor qualquer direito de propriedade sobre a instituição emitente. Esta rubrica inclui:</p> <p>a) Títulos que confirmam ao seu detentor o direito incondicional a auferir um rendimento fixo ou contratual sob a forma de pagamento de cupões e/ou a uma importância fixa a pagar em data(s) especificada(s) ou a partir de uma data definida na data da emissão;</p> <p>b) Instrumentos não negociáveis emitidos por agentes inquiridos que posteriormente se tornem negociáveis e que devem ser reclassificados como «títulos de dívida»;</p>

## PARTE 2

## TIPO DE DADOS

1. Dados baseados no tipo de operação (\*) a reportar relativamente a cada operação:

Campo	Descrição dos dados	Opção alternativa de reporte (se houver) e outras reservas
Estatuto da operação reportada	Este atributo especifica se a operação é uma nova operação, uma alteração de operação anteriormente reportada, um cancelamento ou uma correção de operação anteriormente reportada.	
Estatuto de novação	Este atributo especifica se a operação é uma novação.	
Identificador único da operação	O código único que permite identificar uma transação no respetivo segmento de mercado.	O preenchimento deste campo é obrigatório se os dados estiverem disponíveis.
Identificação exclusiva da operação	O identificador de operação interno único utilizado pelo agente inquirido para cada operação. A identificação exclusiva da operação é única em relação a qualquer operação reportada por segmento do mercado monetário e agente inquirido.	
Identificação exclusiva da operação conexa	O identificador da operação interno único utilizado pelo agente inquirido para a transação inicial que foi subsequentemente objeto de novação.	O preenchimento deste campo é obrigatório, se aplicável.
Identificação exclusiva da operação da contraparte	A identificação exclusiva da operação atribuída pela contraparte do agente inquirido à mesma operação.	O preenchimento deste campo é obrigatório se os dados estiverem disponíveis.

Campo	Descrição dos dados	Opção alternativa de reporte (se houver) e outras reservas
Identificação da contraparte	Código de identificação utilizado para reconhecer a contraparte do agente inquirido na operação reportada.	O código Identificador de Entidade Jurídica ( <i>Legal Entity Identifier/LEI</i> ) deve ser utilizado sempre que tal código tenha sido atribuído à contraparte. Se não for atribuído um código LEI, devem ser reportados o setor e a localização da contraparte.
Setor da contraparte	Setor institucional da contraparte	Obrigatório, se não for fornecida a identificação da contraparte.
Localização da contraparte	Código de país ISO (atribuído pela <i>International Organisation for Standardisation</i> ) do país onde a contraparte está sediada.	Obrigatório, se não for fornecida a identificação da contraparte.
Data do reporte	Data e hora de início e de termo do período a que se referem os dados de operação contidos no ficheiro.	
Carimbo de data eletrónico	A hora a que a operação foi concluída ou contabilizada.	
Data da transação	Data em que as partes efetuam a operação financeira reportada.	
Data de liquidação	Data em que o valor em dinheiro é trocado pelas contrapartes ou em que é liquidada a compra ou a venda de um instrumento de dívida.	No caso de contas <i>call</i> e de outras operações de contração ou concessão de empréstimos reembolsáveis com pré-aviso, a data em que o depósito for renovado (ou seja, a data em que o mesmo teria sido reembolsado se o respetivo pagamento tivesse sido exigido ou se não tivesse sido renovado).
Data de vencimento	Data em que o valor em dinheiro deve ser reembolsado pelo mutuário ao mutuante ou em que se vence e deve ser reembolsado um instrumento financeiro.	
Tipo de instrumento	O instrumento através do qual tem lugar concessão ou a contração do empréstimo.	
Tipo de operação	Este atributo especifica se a operação é realizada para contrair ou para conceder um empréstimo de numerário.	
Valor nominal da operação	O montante de numerário em euros concedido ou obtido a título de empréstimo sobre depósitos. No caso de títulos de dívida, é o valor nominal do título emitido/comprado.	
Preço da transação	O preço ilíquido ( <i>dirty price</i> , i. é o preço que inclui eventuais juros vencidos) a que o título é emitido ou negociado em pontos percentuais.	A ser reportado como sendo de 100 em relação aos depósitos não garantidos.
Tipo de taxa	Atributo utilizado para indicar se o instrumento é de taxa fixa ou variável.	

Campo	Descrição dos dados	Opção alternativa de reporte (se houver) e outras reservas
Taxa da operação	A taxa de juro, expressa de acordo com a convenção do mercado monetário «número efectivo de dias/360», à qual o depósito foi efetuado e o montante em numerário emprestado é remunerado. No caso de instrumentos de dívida, trata-se da taxa de juro efetiva, expressa de acordo com a convenção do mercado monetário «número efectivo de dias/360» à qual o instrumento foi emitido ou comprado.	O preenchimento deste campo só é obrigatório para instrumentos de taxa fixa.
Índice da taxa de referência	O Número Internacional de Identificação de Títulos ( <i>International Securities Identification Number/ISIN</i> ) da taxa de referência subjacente com base na qual são calculadas as prestações dos juros.	O preenchimento deste campo só é obrigatório para instrumentos de taxa variável.
Diferencial de pontos base	O número de pontos base adicionados (se o diferencial for positivo) ou subtraídos (se negativo) ao índice da taxa de referência para calcular a taxa de juro efetiva aplicável a um determinado período no momento da emissão do instrumento de taxa variável.	O preenchimento deste campo só é obrigatório para instrumentos de taxa variável.
Opção de compra ou de venda	Atributo que indica se o instrumento tem uma opção de compra ou uma opção de venda.	O preenchimento deste campo só é obrigatório para os instrumentos com opção de recompra/revenda.
Data inicial da opção de compra/venda	A primeira data em que a opção de compra ou a opção de venda pode ser exercida.	O preenchimento deste campo só é obrigatório para os instrumentos com uma opção de compra ou um opção de venda que só pode ser exercida numa ou mais datas previamente definidas.
Pré-aviso da opção de compra/venda.	O número de dias de calendário que o detentor do instrumento ou o emitente do instrumento dá ao emitente/detentor do instrumento antes de exercer a opção de venda/compra.	O preenchimento deste campo só é obrigatório para os instrumentos com um prazo de pré-aviso da opção de compra/venda e para os depósitos reembolsáveis com prazo de pré-aviso.

## 2. Limiar de relevância

As operações realizadas com sociedades não financeiras só deverão ser reportadas quando estas últimas estiverem classificadas como «grossistas» de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez.

(\*) As normas em matéria de reporte eletrónico e as especificações técnicas dos dados são estabelecidos separadamente. Disponível (em inglês) no sítio Web do BCE em [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)

## ANEXO III

## «ANEXO III

**Regime de reporte das estatísticas do mercado monetário relativas a operações com garantia**

## PARTE 1

**TIPO DE INSTRUMENTOS**

Os agentes inquiridos devem reportar ao Banco Central Europeu (BCE) ou ao banco central nacional (BCN) competente:

- a) Todas as operações de *swap* cambial mediante as quais sejam comprados/vendidos euros à vista contra uma divisa estrangeira, e revendidos ou recomprados a prazo a uma taxa de câmbio a prazo pré-acordada, com um prazo de vencimento não superior a um ano (definidas como operações com um prazo de vencimento não superior a 397 dias após a data de liquidação da componente à vista da operação de *swap* cambial), realizadas entre o agente inquirido e sociedades financeiras (com exceção dos bancos centrais, sempre que a operação não tenha fins de investimento), administrações públicas ou sociedades não financeiras classificadas como «grossistas» de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez;
- b) Operações de *swap* de taxa de juro overnight (OIS), denominadas em euros, realizadas entre o agente inquirido e sociedades financeiras (com exceção dos bancos centrais, sempre que a operação não tenha fins de investimento), administrações públicas ou sociedades não financeiras classificadas como «grossistas» de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez.

Para efeitos do n.º 1, alíneas a) e b), acima, ficam excluídas as operações intragrupo.

## PARTE 2

**TIPO DE DADOS**

1. Dados baseados no tipo de operação (\*) relativos a *swaps* cambiais a reportar relativamente a cada operação:

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se aplicável) e outras qualificações
Estatuto da operação reportada	Este atributo especifica se a operação é uma nova operação, uma alteração de operação anteriormente reportada, um cancelamento ou uma correção de operação anteriormente reportada.	
Estatuto de novação	Este atributo especifica se a operação é uma novação.	
Identificador único da operação	O código único que permite identificar uma transação no respetivo segmento de mercado.	O preenchimento deste campo é obrigatório se os dados estiverem disponíveis.
Identificação exclusiva da operação	O identificador de operação interno único utilizado pelo agente inquirido para cada operação. A identificação exclusiva da operação é única em relação a qualquer operação reportada por segmento do mercado monetário e agente inquirido.	
Identificação exclusiva da operação conexa	O identificador da operação interno único utilizado pelo agente inquirido para a transação inicial que foi subsequentemente objeto de novação.	O preenchimento deste campo é obrigatório, se aplicável.
Identificação exclusiva da operação da contraparte	A identificação exclusiva da operação atribuída pela contraparte do agente inquirido à mesma operação.	O preenchimento deste campo é obrigatório se os dados estiverem disponíveis.

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se aplicável) e outras qualificações
Identificação da contraparte	Código de identificação utilizado para reconhecer a contraparte do agente inquirido na operação reportada.	O código Identificador de Entidade Jurídica ( <i>Legal Entity Identifier/LEI</i> ) deve ser utilizado sempre que tal código tenha sido atribuído à contraparte. Se não for atribuído um código LEI, devem ser reportados o setor e a localização da contraparte.
Setor da contraparte	Setor institucional da contraparte	Obrigatório, se não for fornecida a identificação da contraparte.
Localização da contraparte	Código de país ISO (atribuído pela <i>International Organisation for Standardisation</i> ) do país onde a contraparte está sediada.	Obrigatório, se não for fornecida a identificação da contraparte.
Data do reporte	Data e hora de início e de termo do período a que se referem os dados de operação contidos no ficheiro.	
Carimbo de data eletrónico	A hora a que a operação foi concluída ou contabilizada.	
Data da transação	Data em que as partes efetuam a operação financeira reportada.	
Data-valor à vista	Data na qual uma parte vende à outra um dado quantitativo de uma divisa contra o pagamento de um determinado valor noutra divisa, calculado com base numa taxa de câmbio previamente ajustada, designada «taxa de câmbio à vista».	
Data de vencimento	Data em que o <i>swap</i> cambial expira e a divisa vendida na data-valor à vista é recomprada.	
Operação de tipo cambial	Este atributo especifica se o montante em euros reportado como valor nominal da operação foi comprado ou vendido na data-valor à vista. Deve referir-se ao <i>euro spot</i> , ou seja, se o euro é comprado ou vendido na data-valor à vista.	
Valor nominal da operação	Valor nominal em euros do <i>swap</i> cambial.	
Código da moeda estrangeira	O código internacional ISO de três dígitos da moeda comprada/vendida em troca de euros.	
Taxa de câmbio à vista	A taxa de câmbio entre o euro e a moeda estrangeira aplicável à primeira componente do <i>swap</i> cambial.	

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se aplicável) e outras qualificações
Pontos cambiais a prazo	Diferença entre as taxas de câmbio à vista e a prazo, expressas em pontos base cotados de acordo com as convenções de mercado prevalentes no tocante ao par de divisas em causa.	

2. Dados baseados no tipo de operação relativos a operações OIS a reportar relativamente a cada operação

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se aplicável) e outras qualificações
Estatuto da operação reportada	Este atributo especifica se a operação é uma nova operação, uma alteração de operação anteriormente reportada, um cancelamento ou uma correção de operação anteriormente reportada.	
Estatuto de novação	Este atributo especifica se a operação é uma novação.	
Identificador único da operação	O código único que permite identificar uma transação no respetivo segmento de mercado.	O preenchimento deste campo é obrigatório se os dados estiverem disponíveis.
Identificação exclusiva da operação	O identificador de operação interno único utilizado pelo agente inquirido para cada operação. A identificação exclusiva da operação é única em relação a qualquer operação reportada por segmento do mercado monetário e agente inquirido.	
Identificação exclusiva da operação conexa	O identificador da operação interno único utilizado pelo agente inquirido para a transação inicial que foi subsequentemente objeto de novação.	O preenchimento deste campo é obrigatório, se aplicável.
Identificação exclusiva da operação da contraparte	A identificação exclusiva da operação atribuída pela contraparte do agente inquirido à mesma operação.	O preenchimento deste campo é obrigatório se os dados estiverem disponíveis.
Identificação da contraparte	Código de identificação utilizado para reconhecer a contraparte do agente inquirido na operação reportada.	O código LEI deve ser utilizado sempre que tal código tenha sido atribuído à contraparte. Se não for atribuído um código LEI, devem ser reportados o setor e a localização da contraparte.
Setor da contraparte	Setor institucional da contraparte	Obrigatório, se não for fornecida a identificação da contraparte.
Localização da contraparte	Código de país ISO do país onde a contraparte está sediada.	Obrigatório, se não for fornecida a identificação da contraparte.
Data do reporte	Data e hora de início e de termo do período a que se referem os dados de operação contidos no ficheiro.	

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se aplicável) e outras qualificações
Carimbo de data eletrónico	A hora a que a operação foi concluída ou contabilizada.	Campo facultativo.
Data da transação	Data em que as partes efetuam a operação financeira.	
Data de início	Data do cálculo da taxa de juro <i>overnight</i> aplicável à componente ( <i>leg</i> ) variável	
Data de vencimento	Último dia do prazo pelo qual se calcula a taxa de juro <i>overnight</i> .	
Taxa de juro fixa	Taxa fixa utilizada no cálculo do pagamento do OIS ( <i>overnight indexed swap</i> ).	
Tipo de operação	Este atributo especifica se a taxa de juro fixa é paga ou recebida pelo agente inquirido.	
Valor nominal da operação	Valor nocional do OIS	

### 3. Limiar de relevância

As operações realizadas com sociedades não financeiras só deverão ser reportadas quando estas últimas estiverem classificadas como «grossistas» de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez.

(\*) As normas em matéria de transmissão eletrónica e as especificações técnicas destes dados são estabelecidos separadamente. Disponível (em inglês) no sítio Web do BCE em [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)

## ANEXO IV

## «ANEXO IV

**Normas mínimas a observar pela população efetivamente inquirida**

Os agentes inquiridos devem observar as seguintes normas mínimas para cumprirem os requisitos de reporte estatístico do Banco Central Europeu (BCE):

1. Normas mínimas em matéria de transmissão:

- i) O reporte deve ser feito nos prazos estipulados pelo BCE e pelo banco central nacional (BCN) competente;
- ii) A informação estatística deve ser apresentada de acordo com o modelo e formato previstos nos requisitos técnicos para o reporte estabelecidos pelo BCE e pelo BCN competente;
- iii) O agente inquirido deve indicar uma ou mais pessoas de contacto ao BCE e ao BCN competente;
- iv) Devem ser respeitadas as especificações técnicas para a transmissão de dados ao BCE e ao BCN competente.

2. Normas mínimas em matéria de exatidão:

- i) A informação estatística deve estar correta;
- ii) Os agentes inquiridos devem estar preparados para prestar esclarecimentos sobre os desenvolvimentos que os dados reportados deixem antever;
- iii) A informação estatística deve ser completa e não conter lacunas contínuas ou estruturais; as lacunas existentes devem ser assinaladas, explicadas ao BCE e ao BCN competente e, se for o caso, colmatadas logo que possível;
- iv) Os agentes inquiridos devem respeitar as unidades e casas decimais e seguir a política de arredondamento estabelecida pelo BCE e pelo BCN competente para a transmissão técnica dos dados.

3. Normas mínimas em matéria de conformidade concetual:

- i) A informação estatística deve estar de acordo com as definições e classificações contidas no presente regulamento;
- ii) Em caso de desvios relativamente às referidas definições e classificações, os agentes inquiridos devem controlar e quantificar, com regularidade, a diferença entre a medida utilizada e a medida prevista no presente regulamento;
- iii) Os agentes inquiridos devem estar preparados para explicar as quebras verificadas nos dados transmitidos quando comparados com valores de períodos anteriores.

4. Normas mínimas em matéria de revisões:

Devem seguir-se a política de revisões e os procedimentos estabelecidos pelo BCE e pelo BCN competente. Quando não se trate de revisões normais, as revisões devem ser acompanhadas de notas explicativas.

5. Normas mínimas em matéria de integridade dos dados:

- i) a informação estatística deve ser compilada e transmitida pelos agentes inquiridos de forma imparcial e objetiva;
  - ii) os erros nos dados transmitidos devem ser corrigidos e comunicados pelos agentes inquiridos ao BCE e ao BCN competente o mais rapidamente possível.»
-