



BOLETIM MENSAL CMVM

Nº 324 | ABRIL 2020



COMISSÃO DO MERCADO
DE VALORES MOBILIÁRIOS

Dever de prestação de informação relativa às liquidações internalizadas (Regulamento da CMVM n.º 6/2019 e Art. 9.º/1 do CSDR)

9 de abril de 2020

No âmbito do artigo 9.º do Regulamento (UE) n.º 909/2014, do Parlamento Europeu e do Conselho, de 23 de julho de 2014, relativo à melhoria da liquidação de valores mobiliários na União Europeia e às Centrais de Valores Mobiliários (doravante [CSDR](#)), **as entidades qualificadas como internalizadores de liquidação** deverão efetuar um reporte nos termos do previsto no Regulamento Delegado (UE) 2017/391 da Comissão, de 11 de novembro de 2016, que complementa a CSDR no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação que especificam o conteúdo da comunicação de informações sobre as liquidações internalizadas ([RTS 2017/391](#)) e no Regulamento de Execução (UE) 2017/393 da Comissão, de 11 de novembro de 2016, que estabelece normas técnicas de execução no que respeita aos modelos e procedimentos a seguir com vista à comunicação e transmissão das informações relativas às liquidações internalizadas ([ITS 2017/393](#)).

Neste sentido, faz-se notar que o prazo limite para a submissão deste reporte é o 10.º dia útil a contar do final de cada trimestre, de cada ano civil.

Para o efeito, deverá considerar-se o [Regulamento da CMVM n.º 6/2019](#), relativo à prestação de informação pelas entidades qualificadas como internalizadores de liquidação e que concretiza os procedimentos e os conteúdos da informação a reportar.

Adicionalmente, cumpre referir que a ESMA disponibilizou, no respetivo sítio da internet relativo ao *post-trading*, na secção de "[Internalised settlement reporting](#)", a documentação de suporte a este reporte, nomeadamente as [Report Validation Rules](#) e as [Orientações relativas à comunicação da liquidação internalizada nos termos do artigo 9.º do CSDR](#).

Por último, requer-se a especial atenção quanto à completude dos dados reportados, os quais devem incluir:

- A correta conversão da moeda do instrumento financeiro;
- O volume preenchido com o número de instruções internalizadas em detrimento do número de instrumentos financeiros das instruções; e
- O correto valor de mercado das instruções de liquidação internalizada sem pagamento (FoP).

Quaisquer solicitações respeitantes à presente circular poderão ser requeridas junto do Departamento de Supervisão Contínua, através do seguinte endereço: sup_continua@cmvm.pt.