

ANEXO A

(A que se refere o artigo 3.º)

ANEXO 12

**COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA DA CARTEIRA DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO
COLETIVO EM VALORES MOBILIÁRIOS DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO
ALTERNATIVO EM VALORES MOBILIÁRIOS E DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO EM
ATIVOS NÃO FINANCEIROS**

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte da carteira dos OICVM, OIAVM e OIA nF	Ficheiro de dados	CFMNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMMDD.XML
	CFM identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um caráter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "CFM" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_CFM_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre instrumentos financeiros admitidos, em processo de admissão ou não admitidos à negociação em plataformas de negociação, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo que identifica o código de categoria do instrumento financeiro, sendo preenchido com o código da tabela 1.

Código do instrumento financeiro 1 (Campo 2): Campo que identifica o código do instrumento financeiro que integra a carteira sob gestão, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number* (ISIN), nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável, e
- “NA” caso não exista ISIN.

Código do instrumento financeiro 2 (Campo 3): Campo que identifica código adicional do instrumento financeiro que integra a carteira sob gestão, sendo preenchido com o *Classification of Financial Instruments* (CFI), nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Descrição do instrumento financeiro (Campo 4): Campo que identifica a designação do instrumento financeiro.

Código do mercado (Campo 5): Campo que identifica a plataforma de negociação onde o instrumento financeiro se encontra admitido à negociação ou no qual será admitido para os instrumentos financeiros em processo de admissão, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code* (MIC), nos termos definidos na Norma ISO 10383, para os instrumentos financeiros admitidos, ou em processo de admissão, à negociação em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.
Caso o instrumento se encontre admitido em mais do que uma plataforma de negociação, o campo deve ser preenchido com o MIC Code do mercado onde o mesmo é normalmente transacionado pela entidade responsável pela gestão.
- “XXXX”, para os instrumentos financeiros não admitidos à negociação.

Tipo de OIC (Campo 6): Campo que é preenchido com:

- “S”, tratando-se de OICVM estabelecidos ou não em território nacional;
- “N”, tratando-se de OIC, que não sejam OICVM estabelecidos ou não em território nacional;
- “NA”, quando não aplicável (para os códigos de categoria (campo 1) que não sejam CC05, CC18 e CC31).

País do emitente (Campo 7): Campo que identifica o país do emitente do instrumento financeiro.

Código do emitente (Campo 8): Campo que identifica o código LEI relativo ao emitente do instrumento financeiro. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Descrição do emitente (Campo 9): Campo que identifica o nome ou denominação do emitente do instrumento financeiro.

Descrição do ativo subjacente (Campo 10): Campo que identifica a designação do(s) ativo(s) subjacente(s) (qualquer que seja o instrumento financeiro derivado).

Notação de risco da emissão ou do emitente (Campo 11): Campo que é preenchido com:

- A notação de risco da emissão do título de dívida, ou na sua inexistência, notação do risco do emitente à data da carteira, atribuído por agências internacionalmente reconhecidas. No caso da existência de duas ou mais notações, corresponde à notação mais baixa.
- “NA”, no caso de inexistência de notação de risco da emissão ou do emitente.

Tipo de notação de risco (Campo 12): Campo que é preenchido com:

- “O”, se o campo anterior tiver sido preenchido com notação de risco da emissão;
- “E”, se o campo anterior tiver sido preenchido com notação de risco do emitente;
- “NA”, se o campo anterior tiver sido preenchido com “NA”.

Grupo (Campo 13): Campo que é preenchido com “S” ou “N”, consoante o instrumento financeiro seja ou não:

- a. Emitido ou garantido por entidade previstas nas alíneas a) a h) do artigo 147.º do RGOIC;
- b. Emitido por organismo de investimento coletivo gerido pela entidade responsável pela gestão do organismo objeto de reporte ou gerido por entidade que com ela se encontre em relação de grupo para efeitos de consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13 do artigo 176.º do RGOIC; ou
- c. Emitido por entidade em relação de grupo para efeitos de consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13 do artigo 176.º do RGOIC, com outro emitente de outro ativo em carteira.

Entidade de grupo (Campo 14): Campo que é preenchido caso o campo “Grupo” ser igual a “S”, do seguinte modo:

- Estando em causa situação prevista na alínea a) do campo “Grupo”, é inserida a abreviatura “SG”, “DP” ou “OUT” consoante a entidade que tenha emitido ou garantido o ativo ou passivo esteja relacionada com a entidade responsável pela gestão, com o depositário ou com outra entidade, respetivamente. No caso de a entidade ser enquadrável em mais do que uma opção deverá ser utilizada a abreviatura “SG” em detrimento de “DP” e “OUT” ou “DP” em detrimento de “OUT”.
- Estando em causa a situação prevista na alínea b) do campo “Grupo”, é inserida a abreviatura “OIC”.
- Estando em causa a situação prevista na alínea c) do campo “Grupo”, é inserido o código de identificação do ativo, utilizando para o efeito a abreviatura “G” seguida de um número sequencial (com início em “00001” para o primeiro

grupo até “nnnnn” para o grupo “n”), que estabeleça uma relação historicamente inequívoca e constante com o grupo. Esta identificação deverá ser igual para todos os fundos geridos por uma entidade responsável pela gestão.

Código da moeda (Campo 15): Campo que identifica a moeda em que o preço do instrumento financeiro originariamente se encontra expresso, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217.

Quantidade do instrumento financeiro (Campo 16): Campo que identifica a quantidade ou valor nominal do instrumento financeiro em carteira.

Preço do instrumento financeiro (Campo 17): Campo que é preenchido com o valor unitário do ativo em carteira na moeda em que foi adquirido ou em percentagem quando se trate de instrumento representativo de dívida.

Indicação do preço do instrumento financeiro (Campo 18): Campo preenchido com “V”, caso o campo anterior tenha sido preenchido com valor, “P”, caso tenha sido preenchido em percentagem.

Tipo de preço do instrumento financeiro (Campo 19): Campo que identifica o tipo de preço do instrumento financeiro sendo preenchido com:

- “N”, caso o preço tenha por base, o preço praticado no mercado em que o instrumento financeiro se encontre admitido à negociação;
- “B”, caso o preço tenha por base o valor médio das ofertas de compra e venda firmes;
- “O”, caso o preço tenha por base o valor médio das ofertas de compra e venda definidas através de entidades especializadas;
- “V”, caso o preço tenha por base o valor médio das ofertas de compra difundidas através de entidades especializadas;
- “A”, caso o preço tenha por base os modelos de avaliação utilizados e reconhecidos universalmente nos mercados financeiros;
- “U”, caso o preço tenha por base o último valor da unidade de participação divulgado ao mercado pela respetiva entidade responsável pela gestão.

Data do preço do instrumento financeiro (Campo 20): Campo que identifica a data do preço do instrumento financeiro.

Montante total (Campo 21): Campo que identifica o montante total do instrumento financeiro na carteira, incluindo juros corridos se aplicável, em euros.

Montante total na moeda de referência da carteira (Campo 22): Campo que identifica o montante total do instrumento financeiro na carteira, incluindo juros corridos se aplicável, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão
1	Código de categoria	Código da tabela 1
2	Código do instrumento financeiro 1	ISIN, NA
3	Código do instrumento financeiro 2	CFI
4	Descrição do instrumento financeiro	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*
5	Código do mercado	Mic Code, XXXX
6	Tipo de OIC	S, N, NA
7	País do emitente	Dimensão máxima de 2 caracteres alfanuméricos*
8	Código do emitente	Código LEI, NA
9	Descrição do emitente	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*
10	Descrição do ativo subjacente	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*
11	Notação de risco da emissão ou do emitente	Dimensão máxima de 4 caracteres alfanuméricos *
12	Tipo de notação de risco	O, E, NA
13	Grupo	S, N
14	Entidade de grupo	SG, DP, OUT, OIC, Gnnnnn
15	Código da moeda	ISO 4217
16	Quantidade do instrumento financeiro	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
17	Preço do instrumento financeiro	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
18	Indicação do preço do instrumento financeiro	V, P
19	Tipo de preço do instrumento financeiro	N, B, O, V, A, U
20	Data do preço do instrumento financeiro	ISO 8601
21	Montante total	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais
22	Montante total na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Tabela 1 - Códigos de categoria dos ativos em carteira nos OICVM, OIAVM e OIANF

Código de Categoria	Designação
	Instrumentos Financeiros admitidos à negociação em Plataformas Negociação (PN)
CC01	Títulos de dívida pública
CC02	Outros fundos públicos e equiparados
CC03	Obrigações diversas
CC04	Ações
CC05	Unidades de participação/ações de OIC que não OII (ETFs)

CC06	Direitos
CC07	Warrants autónomos
CC08	Opções
CC09	Unidades de participação/ações de OII (ETFs)
CC10	Ações emitidas por sociedades imobiliárias
CC11	Papel comercial
CC12	Outros instrumentos de dívida de curto prazo
CC13	Outros instrumentos financeiros
	Instrumentos Financeiros em processo de admissão à negociação em PN
CC14	Títulos de dívida pública
CC15	Outros fundos públicos e equiparados
CC16	Obrigações diversas
CC17	Ações
CC18	Unidades de participação/ações de OIC que não OII
CC19	Direitos
CC20	Warrants autónomos
CC21	Opções
CC22	Unidades de participação/ações de OII
CC23	Ações emitidas por sociedades imobiliárias
CC24	Papel comercial
CC25	Outros instrumentos de dívida de curto prazo
CC26	Outros instrumentos financeiros
	Instrumentos Financeiros não admitidos à negociação em PN
CC27	Títulos de dívida pública
CC28	Outros fundos públicos e equiparados
CC29	Obrigações diversas
CC30	Ações
CC31	Unidades de participação/ações de OIC que não OII
CC32	Direitos
CC33	Warrants autónomos
CC34	Opções
CC35	Unidades de participação/ações de OII
CC36	Ações emitidas por sociedades imobiliárias
CC37	Papel comercial
CC38	Outros instrumentos de dívida de curto prazo
CC39	Outros instrumentos financeiros

Bloco de informação número 2: Informação sobre ativos não financeiros da carteira, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo que identifica o código de categoria do ativo, sendo preenchido com o código da tabela 2.

Descrição do ativo (Campo 2): Campo que identifica a designação do ativo.

Grupo (Campo 3): Campo que é preenchido com "S" ou "N", consoante o ativo seja ou não:

- Emitido ou garantido por entidades previstas nas alíneas a) a h) do artigo 147.º do RGOIC;
- Emitido por organismo de investimento coletivo gerido pela entidade responsável pela gestão do organismo objeto de reporte ou gerido por entidade que com ela se encontre em relação de grupo para efeitos de

consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13 do artigo 176.º do RGOIC; ou

- c. Emitido por entidade em relação de grupo para efeitos de consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13 do artigo 176.º do RGOIC, com outro emitente de outro ativo em carteira.

Entidade de grupo (Campo 4): Campo que é preenchido caso o campo “Grupo” ser igual a “S”, do seguinte modo:

- Estando em causa situação prevista na alínea a) do campo “Grupo”, é inserida a abreviatura “SG”, “DP” ou “OUT” consoante a entidade que tenha emitido ou garantido o ativo ou passivo esteja relacionada com a entidade responsável pela gestão, com o depositário ou com outra entidade, respetivamente. No caso de a entidade ser enquadrável em mais do que uma opção deverá ser utilizada a abreviatura “SG” em detrimento de “DP” ou “OUT”.
- Estando em causa a situação prevista na alínea b) do campo “Grupo”, é inserida a abreviatura “OIC”, ou
- Estando em causa a situação prevista na alínea c) do campo “Grupo”, é inserido o código de identificação do ativo, utilizando para o efeito a abreviatura “G” seguida de um número sequencial (com início em “00001” para o primeiro grupo até “nnnnn” para o grupo “n”), que estabeleça uma relação historicamente inequívoca e constante com o grupo. Esta identificação deverá ser igual para todos os fundos geridos por uma entidade responsável pela gestão.

Código da moeda (Campo 5): Campo que identifica a moeda em que o preço do ativo originariamente se encontra expresso, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217.

Quantidade do ativo (Campo 6): Campo que identifica a quantidade do ativo em carteira.

Montante total (Campo 7): Campo que identifica o montante total do ativo na carteira, em euros.

Montante total na moeda de referência da carteira (Campo 8): Campo que identifica o montante total do ativo na carteira, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão
1	Código de categoria	Código da tabela 2
2	Descrição do ativo	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*
3	Grupo	S, N
4	Entidade de grupo	SG, DP, OUT, OIC, Gnnnnn

5	Código da moeda	ISO 4217
6	Quantidade do ativo	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
7	Montante total	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
8	Montante total na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Tabela 2 - Códigos de categoria dos ativos em carteira nos OICVM, OIAVM, OIANF

Código de Categoria	Designação
	Outros Ativos da Carteira
CC01	Ativos Não Financeiros
CC02	Imóveis
CC03	Outros Ativos

Bloco de informação número 3: Informação sobre outros ativos e passivos da carteira, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo que identifica o código de categoria dos outros ativos e passivos, sendo preenchido com o código da tabela 3.

Descrição do ativo ou passivo (Campo 2): Campo que identifica a designação do ativo ou passivo.

Código da entidade relevante (Campo 3): Campo que identifica a entidade junto da qual a entidade responsável pela gestão contratou os ativos e passivos, sendo preenchido com:

- O código LEI, quando aplicável;
- “NA”, quando não aplicável.

Descrição da entidade relevante (Campo 4): Campo que identifica o nome ou denominação da entidade junto da qual a entidade responsável pela gestão contratou os ativos e passivos, sendo preenchido com:

- O nome ou denominação da entidade, quando aplicável;
- “NA”, quando não aplicável.

Data de emissão (Campo 5): Campo que identifica a data de contratação do ativo ou passivo, se aplicável.

Data de maturidade (Campo 6): Campo que identifica a data na qual o valor ativo ou passivo se vence, se aplicável.

Grupo (Campo 7): Campo que é preenchido com “S” ou “N”, consoante o ativo ou o passivo seja ou não:

- a. Emitido ou garantido por entidade previstas nas alíneas a) a h) do artigo 147.º do RGOIC;
- b. Emitido por entidade em relação de grupo para efeitos de consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13 do artigo 176.º do RGOIC, com outro emitente de outro ativo em carteira.

Entidade de grupo (Campo 8): Campo que é preenchido caso o campo “Grupo” ser igual a “S”, do seguinte modo:

- Estando em causa situação prevista na alínea a) do campo “Grupo”, é inserida a abreviatura “SG”, “DP” ou “OUT” consoante a entidade que tenha emitido ou garantido o ativo ou passivo esteja relacionada com a entidade responsável pela gestão, com o depositário ou com outra entidade, respetivamente. No caso de a entidade ser enquadrável em mais do que uma opção deverá ser utilizada a abreviatura “SG” em detrimento de “DP” e “OUT” ou “DP” em detrimento de “OUT”.
- Estando em causa a situação prevista na alínea b) do campo “Grupo”, é inserida a abreviatura “OIC”, ou
- Estando em causa a situação prevista na alínea c) do campo “Grupo”, é inserido o código de identificação do ativo, utilizando para o efeito a abreviatura “G” seguida de um número sequencial (com início em “00001” para o primeiro grupo até “nnnnn” para o grupo “n”), que estabeleça uma relação historicamente inequívoca e constante com o grupo. Esta identificação deverá ser igual para todos os fundos geridos por uma entidade responsável pela gestão.

Tipo de outros valores (Campo 9): Campo que identifica no caso de organismos de investimento coletivo em valores mobiliários, de organismos de investimento alternativo em valores mobiliários e de organismo de investimento em ativos não financeiros, sob a forma societária autogerida, sendo preenchido com:

- “I”, caso respeite a outros valores ativos e passivos relativos à carteira de investimento;
- “N”, caso respeite a outros valores necessários ao desenvolvimento da atividade do organismo;

Código da moeda (Campo 10): Campo que identifica a moeda em que o ativo ou passivo originariamente se encontra expresso, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217.

Montante total (Campo 11): Campo que identifica o montante total do valor do ativo ou

Montante total na moeda de referência da carteira (Campo 12): Campo que identifica o

montante total do ativo ou passivo na carteira, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão
1	Código de categoria	Código da tabela 3
2	Descrição do ativo	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*
3	Código da entidade relevante	Código LEI, NA
4	Descrição da entidade relevante	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*, NA
5	Data de emissão	ISO 8601
6	Data de maturidade	ISO 8601
7	Grupo	S, N
8	Entidade de grupo	SG, DP, OUT, OIC, Gnnnnn
9	Tipo de outros valores	I, N
10	Código da moeda	ISO 4217
11	Montante total	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
12	Montante total na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres " ", " * ", " ! " e " ? ".

Tabela 3 - Códigos de categoria dos outros ativos e passivos dos OICVM, OIAVM e OIANF

Código de Categoria	Designação
	Liquidez
CC01	Numerário
CC02	Depósitos à Ordem
CC03	Aplicações nos mercados monetários
CC04	Depósitos a prazo
	Empréstimos
CC05	Empréstimos obtidos
CC06	Descobertos
	Outros Valores a Regularizar
CC07	Valores ativos
CC08	Valores passivos

Bloco de informação número 4: Informação adicional sobre a carteira, com os seguintes campos:

Código da moeda de referência da carteira (Campo 1): Campo que identifica a moeda de referência da carteira, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217 (apenas no caso de ser diferente do euro).

Valor líquido global (Campo 2): Campo que identifica o valor líquido global, em euros.

N.º Unidades de participação total (Campo 3): Campo que identifica o total de unidades de participação em circulação.

Valor líquido global na moeda de referência da carteira (Campo 4): Campo que identifica o valor líquido global na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Ativo sob gestão (Campo 5): Campo que identifica o ativo sob gestão (AUM), em euros, sendo calculado nos termos definidos no Regulamento Delegado (EU) n.º 231/2013 da Comissão de 19 de dezembro de 2012.

Ativo sob gestão na moeda de referência da carteira (Campo 6): Campo que identifica o ativo sob gestão (AUM), na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro), sendo calculado nos termos definidos no Regulamento Delegado (EU) n.º 231/2013 da Comissão de 19 de dezembro de 2012.

Ativos líquidos (Campo 7): Campo que identifica o valor total de ativos líquidos, em euros; por ativos líquidos entendem-se os previstos no n.º 1 do artigo 416.º do Regulamento (EU) n.º 575/2013, excluindo a condição prevista na alínea d) do n.º 3 do referido artigo e as disponibilidades e aplicações em outras instituições de crédito com prazo residual inferior a 30 dias ou mobilizáveis sem penalização num prazo máximo de 30 dias.

Ativos líquidos na moeda de referência da carteira (Campo 8): Campo que identifica o valor total de ativos líquidos, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro), por ativos líquidos entendem-se os previstos no n.º 1 do artigo 416.º do Regulamento (EU) n.º 575/2013, excluindo a condição prevista na alínea d) do n.º 3 do referido artigo e as disponibilidades e aplicações em outras instituições de crédito com prazo residual inferior a 30 dias ou mobilizáveis sem penalização num prazo máximo de 30 dias.

Valor de posições equivalentes nos ativos subjacentes relativamente a instrumentos financeiros derivados detidos (Campo 9): Campo que identifica o valor das posições equivalentes nos ativos subjacentes a instrumentos financeiros derivados detidos, em euros.

Valor de posições equivalentes nos ativos subjacentes relativamente a instrumentos financeiros derivados detidos na moeda de referência da carteira (Campo 10): Campo que identifica o valor das posições equivalentes nos ativos subjacentes a instrumentos financeiros derivados detidos, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Valor do investimento noutros OIC geridos pela entidade responsável pela gestão (Campo 11): Campo que identifica o valor do investimento noutros OIC detidos pela entidade responsável pela gestão, em euros.

Valor do investimento noutros OIC geridos pela entidade responsável pela gestão na moeda de referência da carteira (Campo 12): Campo que identifica o valor do investimento noutros OIC detidos pela entidade responsável pela gestão, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão
1	Código da moeda de referência da carteira	ISO 4217
2	Valor líquido global	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
3	N.º Unidades de participação total	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais
4	Valor líquido global na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
5	Ativo sob gestão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
6	Ativo sob gestão na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
7	Ativos líquidos	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
8	Ativos líquidos na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
9	Valor de posições equivalentes nos ativos subjacentes relativamente a instrumentos financeiros derivados detidos	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
10	Valor de posições equivalentes nos ativos subjacentes relativamente a instrumentos financeiros derivados detidos na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
11	Valor do investimento noutros OIC geridos pela entidade responsável pela gestão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
12	Valor do investimento noutros OIC geridos pela entidade responsável pela gestão na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 5: Informação sobre as unidades de participação, com os seguintes campos:

Categoria de unidades de participação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- “C”, seguido de 1 ou 2 caracteres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- “NA”, sempre que não existam categorias de unidades de participação.

N.º Unidades de participação por categoria (Campo 2): Campo que identifica o n.º de unidades de participação por categoria de unidades de participação existente.

Pré-aviso de resgate (Campo 3): Campo que identifica o pré-aviso de resgate em número dias

para cada categoria de unidades de participação existente.

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão
1	Categoria de unidades de participação	Dimensão mínima de 2 e máxima de 3 caracteres
2	N.º Unidades de participação por categoria	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais
3	Pré-aviso de resgate	Dimensão máxima de 4 caracteres numéricos

Bloco de informação número 6: Informação sobre as responsabilidades extrapatrimoniais, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo que identifica o código de categoria das responsabilidades extrapatrimoniais, sendo preenchido com o código da tabela 4.

Código do instrumento financeiro 1 (Campo 2): Campo que identifica o código do instrumento financeiro que integra a carteira sob gestão, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number* (ISIN), nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável;
- “NA” caso não exista ISIN.

Código do instrumento financeiro 2 (Campo 3): Campo que identifica adicionalmente o código do instrumento financeiro que integra a carteira sob gestão, sendo preenchido com o *Classification of Financial Instruments* (CFI), nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Descrição do instrumento financeiro (Campo 4): Campo que identifica a designação do instrumento financeiro.

Mercado (Campo 5): Campo que identifica a plataforma de negociação onde o instrumento financeiro se encontra admitido à negociação ou no qual será admitido para os instrumentos financeiros em processo de admissão, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code* (MIC), nos termos definidos na Norma ISO 10383, para os instrumentos financeiros admitidos à negociação em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.
- “XXXX”, para os instrumentos financeiros não admitidos à negociação.

Descrição do ativo subjacente (Campo 6): Campo que identifica a designação do(s) ativo(s) subjacente(s).

Data de maturidade (Campo 7): Campo que identifica a data na qual o instrumento financeiro se vence, se aplicável.

Código da moeda (Campo 8): Campo que identifica a moeda em que o instrumento

originariamente se encontra expresso, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217.

Quantidade do instrumento financeiro (Campo 9): Campo que identifica a quantidade do instrumento financeiro em carteira. As posições vendedoras deverão ser precedidas de sinal negativo no campo de valor total (com exceção dos derivados cambiais em que o subjacente é a moeda de referência do fundo, nos quais as posições compradoras deverão ser precedidas de sinal negativo no campo de valor total).

Preço do instrumento financeiro (Campo 10): Campo que é preenchido com a valorização do instrumento financeiro.

Tipo de preço do instrumento financeiro (Campo 11): Campo que identifica o tipo de preço sendo preenchido com:

- “N”, caso o preço tenha por base, o preço praticado no mercado em que o ativo se encontre admitido à negociação;
- “B”, caso o preço tenha por base o valor médio das ofertas de compra e venda firmes;
- “O”, caso o preço tenha por base o valor médio das ofertas de compra e venda definidas através de entidades especializadas;
- “V”, caso o preço tenha por base o valor médio das ofertas de compra difundidas através de entidades especializadas;
- “A”, caso o preço tenha por base os modelos de avaliação utilizados e reconhecidos universalmente nos mercados financeiros.

Data do preço (Campo 12): Campo que identifica a data do preço utilizado.

Exposição (Campo 13): Campo que identifica a exposição inerente aos instrumentos financeiros derivados, expresso em euros. As posições vendedoras deverão ser precedidas de sinal negativo (com exceção dos derivados cambiais em que o subjacente é a moeda de referência do fundo, nos quais as posições compradoras deverão ser precedidas de sinal negativo no campo de valor total).

Objetivo do derivado (Campo 14): Campo que identifica o objetivo que o instrumento financeiro derivado em carteira pretenda concretizar sendo preenchido com:

- “C”, caso se destina a cobertura de riscos;
- “O”, outros.

Montante total (Campo 15): Campo que identifica o montante total da responsabilidade extrapatrimonial incluindo juros decorridos, em euros.

Montante total na moeda de referência da carteira (Campo 16): Campo que identifica o montante total do valor integrante da carteira, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão
1	Código de categoria	Código da tabela 4
2	Código do instrumento financeiro 1	ISIN
3	Código do instrumento financeiro 2	CFI
4	Descrição do instrumento financeiro	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*
5	Mercado	Mic Code, XXXX
6	Descrição do ativo subjacente	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*
7	Data de maturidade	ISO 8601
8	Código da moeda	ISO 4217
9	Quantidade do instrumento financeiro	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
10	Preço do instrumento financeiro	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
11	Tipo de preço do instrumento financeiro	N, B, O, V, A
12	Data do preço	ISO 8601
13	Exposição	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
14	Objetivo do derivado	C, O
15	Montante total	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
16	Montante total na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!” e “?”.

Tabela 4 - Códigos de categoria de informação sobre as responsabilidades extrapatrimoniais dos OICVM, OIAVM e OIANF

Código de Categoria	Designação
	Contratos Cambiais admitidos à negociação em PN
CC02	Futuros
CC02	Opções
CC03	Outros
	Contratos Cambiais não admitidos à negociação em PN
CC04	Forwards
CC05	Opções
CC06	Swaps
CC07	Outros
	Contratos sobre taxas de juro admitidos à negociação em PN

CC08	Futuros
CC09	Opções
CC10	Outros
	Contratos sobre taxa de juro não admitidos à negociação em PN
CC11	FRA
CC12	Opções
CC13	Swaps
CC14	Outros
	Contratos sobre cotações admitidos à negociação em PN
CC15	Futuros
CC16	Opções
CC17	Outros
	Contratos sobre cotações não admitidos à negociação em PN
CC18	Opções
CC19	Swaps
CC20	Outros

ANEXO 13

INFORMAÇÃO SOBRE A ATIVIDADE DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO

I. Especificidades relativas à atividade dos OICVM, OIAVM e OIA nF

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do ficheiro da atividade dos OICVM, OIAVM e OIA nF	Ficheiro de dados	AFMNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMDD.XML
	AFM identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um caráter fixo e 'AAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "AFM" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_AFM_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser

preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o número de participantes e unidades de participação, com os seguintes campos:

Tipo de participantes (Campo 1): Campo que identifica o código do tipo de participante:

- “NP”, se for investidor não profissional;
- “PR”, se for investidor profissional;
- “CE”, se for contraparte elegível.

Categoria de unidades de participação (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- “C”, seguido de 1 ou 2 caracteres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- “NA”, sempre que não existam categorias de unidades de participação.

Número de participantes (Campo 3): Campo que identifica o número de participantes para cada registo.

Quantidade de unidades de participação (Campo 4): Campo que identifica o número de unidades de participação detidas.

Campo	1	2	3	4
Identificação	Tipo de participantes	Categoria de unidades de participação	Número de participantes	Quantidade de unidades de participação
Domínio e Dimensão	NP, PR, CE	Dimensão mínima de 2 e máxima de 3 caracteres	10 caracteres numéricos	16 caracteres numéricos, com 4 decimais

Bloco de informação número 2: Informação sobre a comercialização de unidades de participação, com os seguintes campos:

Tipo de operação (Campo 1): Campo que identifica o código de operação:

- “S”, subscrição de OIC aberto;
- “R”, resgate de OIC aberto;
- “SI”, subscrição inicial OIC fechado;
- “A”, aumento de capital OIC fechado;
- “RC”, redução de capital OIC fechado;
- “RF”, reembolso total ou parcial de capital OIC fechado.

Tipo de participante (Campo 2): Campo que identifica o código do tipo de participante:

- “NP”, se for investidor não profissional;
- “PR”, se for investidor profissional;
- “CE”, se for contraparte elegível.

Categoria de unidades de participação (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- “C”, seguido de 1 ou 2 caracteres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- “NA”, sempre que não existam categorias de unidades de participação.

Valor da operação (Campo 4): Campo que identifica o valor de cada operação, em euros, excluindo os encargos de transação.

Número de participantes (Campo 5): Campo que identifica o número de participantes associado a cada tipo de operação.

Quantidade de unidades de participação (Campo 6): Campo que identifica o número de unidades de participação associado a cada tipo de operação.

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Tipo de operação	Tipo de participante	Categoria de unidades de participação	Valor da operação	Número de participantes	Quantidade de unidades de participação
Domínio e Dimensão	2 caracteres alfanuméricos	NP, PR, CE	Dimensão mínima de 2 e máxima de 3 caracteres	20 caracteres numéricos, com 4 decimais	10 caracteres numéricos	16 caracteres numéricos, com 4 decimais

Bloco de informação número 3: Informação sobre a transações de ativos, com os seguintes campos:

Local de Execução (Campo 1): Campo que identifica o local onde foi efetuada a transação, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code* (MIC), nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as transações executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada;
- “XXXX”, para as transações executadas fora de plataformas de negociação.

Código do ativo (Campo 2): Campo que identifica o código do ativo:

- “AC”, Ações;
- “CD”, *Contracts for Difference*;
- “CF”, Contratos de futuro;

- “CO”, Contratos de opções;
- “CS”, *Credit Default Swaps*;
- ”DP”, Dívida pública;
- “DR”, Direitos;
- “FP”, Fundos públicos e equiparados;
- “FW”, *Forwards*;
- “OD”, Obrigações diversas;
- “SW”, *Swaps*;
- “TP”, Títulos de participação;
- “UH”, Unidades de participação de organismos de investimento coletivo em valores mobiliários;
- “UN”, Unidades de participação de organismos de investimento alternativo excluindo os organismos de investimento imobiliário;
- “WA”, Warrants autónomos;
- “PC”, Papel comercial
- “EF”, *Exchange Traded Fund*;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros;
- “AnF”, Ativos Não Financeiros;
- “Imo”, Imóveis;
- “POII”, Participações em organismos de investimento imobiliário;
- “ASI”, Ações emitidas por sociedades imobiliárias;
- “OT”, para outros ativos.

Tipo de operação (Campo 3): Campo que identifica o tipo de operação, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “C”, para aquisições, incluindo subscrições de OIC;
- “V”, para alienações, incluindo resgates de OIC.

Valor da transação (Campo 4): Campo que identifica o valor da transação em euros excluindo os custos associados à mesma.

Encargos da transação (Campo 5): Campo que identifica o valor dos encargos da transação em euros.

Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Local de Execução	Código do ativo	Tipo de operação	Valor da transação	Encargos da transação
Domínio e Dimensão	Mic Code, XXXX	Dimensão máxima de 4 caracteres alfanuméricos	1 carácter alfanumérico	16 caracteres numéricos, com 4 decimais	12 caracteres numéricos, com 4 decimais

II - Especificidades relativas à atividade dos organismos de investimento imobiliário

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do ficheiro da atividade dos OII	Ficheiro de dados	AFINNNNNFFFFSSSS0AAAAMDD.XML
	AFI identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "AFI" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_AFI_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o número de participantes e unidades de participação, com os seguintes campos:

Tipo de participante (Campo 1): Campo que identifica o código do tipo de participante, sendo

preenchido com:

- “NP”, se for investidor não profissional;
- “PR”, se for investidor profissional;
- “CE”, se for contraparte elegível.

Categoria de unidades de participação (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- “C”, seguido de 1 ou 2 caracteres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- “NA”, sempre que não existam categorias de unidades de participação.

Número de participantes (Campo 3): Campo que identifica o número de participantes relativo a cada tipo de participante.

Quantidade de unidades de participação (Campo 4): Campo que identifica o número de unidades de participação detidas.

Campo	1	2	3	4
Identificação	Tipo de participantes	Categoria de unidades de participação	Número de participantes	Quantidade de unidades de participação
Domínio e Dimensão	NP, PR, CE	Dimensão mínima de 2 e máxima de 3 caracteres	Dimensão máxima de 10 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 16 caracteres numéricos, com 4 decimais

Bloco de informação número 2: Informação sobre a comercialização de unidades de participação, com os seguintes campos:

Tipo de operação (Campo 1): Campo que identifica o código do tipo de operação, sendo preenchido com:

- “S”, Subscrições de OII Abertos;
- “R”, Resgates de OII Abertos;
- “SI”, Subscrição Inicial de OII Fechado;
- “A”, Aumento de Capital de OII Fechado;
- “RC”, Redução de Capital de OII Fechado;
- “RF”, Reembolso Total ou Parcial de OII Fechado.

Tipo de participante (Campo 2): Campo que identifica o código do tipo de participante:

- “NP”, se for investidor não profissional;
- “PR”, se for investidor profissional;
- “CE”, se for contraparte elegível.

Categoria de unidades de participação (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- “C”, seguido de 1 ou 2 caracteres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- “NA”, sempre que não existam categorias de unidades de participação.

Valor da operação (Campo 4): Campo que identifica o valor de cada operação, em euros, excluindo os encargos de transação.

Número de participantes (Campo 5): Campo que identifica o número de participantes associado a cada tipo de operação.

Quantidade de unidades de participação (Campo 6): Campo que identifica o número de unidades de participação associado a cada tipo de operação.

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Tipo de operação	Tipo de participante	Categoria de unidades de participação	Valor da operação	Número de participantes	Quantidade de unidades de participação
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 2 caracteres alfanuméricos	NP, PR, CE	Dimensão mínima de 2 e máxima de 3 caracteres	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 4 decimais	Dimensão máxima de 10 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 16 caracteres numéricos, com 4 decimais

Bloco de informação número 3: Informação sobre os imóveis arrendados a entidades que representem 20% ou mais do ativo total, com os seguintes campos:

País do arrendatário (Campo 1) – Campo que identifica o país de residência do arrendatário.

Código do arrendatário (Campo 2) – Campo que identifica o código da entidade arrendatária sendo preenchido com:

- Código LEI da entidade arrendatária;
- Na ausência do código LEI, este campo é preenchido com o respetivo número de identificação fiscal.

Descrição do arrendatário (Campo 3) – Campo que identifica o nome ou a denominação do arrendatário sem utilização de abreviaturas.

País do ativo imobiliário (Campo 4) – Campo que identifica o país onde está localizado o imóvel arrendado.

Código do ativo imobiliário (Campo 5) – Campo que identifica o imóvel em função do país,

sendo preenchido com:

- Código que corresponde a sua estrutura matricial quando o país do imóvel é Portugal. Este código tem por base a estrutura XXXXXX.T.YYYYYY.ZZZZZZZ.AAA sendo que, “XXXXXX” identifica o código da freguesia, “T” identifica o tipo de prédio (“U” para prédio urbano, “R” para prédio rústico e “O” para prédio omissivo), “ZZZZZZZ” identifica a fração ou secção de cada prédio (não podendo ser identificada mais do que uma fração ou secção, desde que respeitem ao mesmo artigo matricial) e “AAA” (exclusivamente para prédios rústicos, caso os elementos referentes a árvore/colónia façam parte da identificação matricial);
- Código de registo que corresponde ao número de registo de imóvel cuja localização seja em país diferente de Portugal.

Descrição do ativo imobiliário (Campo 6) – Campo que identifica a natureza e a denominação do imóvel de acordo com o disposto no n.º 4 do artigo 78.º do Regulamento da CMVM n.º 2/2015.

Valor do ativo imobiliário (Campo 7) – Campo preenchido com o valor do imóvel em euros.

Campo	1	2	3	4	5	6	7
Identificação	País do arrendatário	Código do arrendatário	Descrição do arrendatário	País do ativo imobiliário	Código do ativo imobiliário	Descrição do ativo imobiliário	Valor do ativo imobiliário
Domínio e Dimensão	2 caracteres alfanuméricos	20 caracteres alfanuméricos	200 caracteres alfanuméricos	2 caracteres alfanuméricos	28 caracteres alfanuméricos	200 caracteres alfanuméricos	16 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 4: Informação sobre as transações de ativos imobiliários (imóveis, direitos ou participações em sociedades imobiliárias) adquiridos ou vendidos no mês, com os seguintes campos:

Tipo de transação (Campo 1) – Campo que informa sobre o tipo de transação, sendo preenchido com

- “C”, Compra;
- “V”, Venda;
- “PA”, Permuta Adquirido;
- “PC”, Permuta Cedido.

País do ativo imobiliário (Campo 2) – Campo que informa sobre o país onde está localizado o ativo imobiliário no qual o OII detém a participação.

Código do ativo imobiliário (Campo 3) – Campo que identifica o imóvel, sendo preenchido

com:

- Código que corresponde a sua estrutura matricial quando o país do imóvel é Portugal. Este código tem por base a estrutura XXXXXX.T.YYYYYY.ZZZZZZZ.AAA sendo que, “XXXXXX” identifica o código da freguesia, “T” identifica o tipo de prédio (“U” para prédio urbano, “R” para prédio rústico e “O” para prédio omissivo), “ZZZZZZZ” identifica a fração ou secção de cada prédio (não podendo ser identificada mais do que uma fração ou secção, desde que respeitem ao mesmo artigo matricial) e “AAA” (exclusivamente para prédios rústicos, caso os elementos referentes a árvore/colónia façam parte da identificação matricial);
- Código de registo que corresponde ao número de registo de imóvel cuja localização seja em país diferente de Portugal.
- Código LEI da Sociedade Imobiliária. Na ausência do código LEI, é preenchido com o respetivo número de identificação fiscal.

Descrição do ativo imobiliário (Campo 4) – Campo que identifica a natureza e a denominação do ativo imobiliário, sendo preenchido com:

- Natureza e denominação no caso de imóvel ou direito, nos termos do disposto no n.º 4 do artigo 78.º do Regulamento da CMVM n.º 2/2015;
- Denominação social da sociedade imobiliária, sem utilização de abreviaturas.

País da contraparte (Campo 5) – Campo que identifica o país de residência da contraparte da transação.

Código da contraparte (Campo 6) – Campo que identifica a contraparte na transação, sendo preenchido com:

- Código LEI da entidade contraparte;
- Número de identificação fiscal, não existindo código LEI.

Descrição da contraparte (Campo 7) – Campo preenchido com o nome ou denominação da contraparte, sem utilização de abreviaturas.

Tipo de contraparte (Campo 8) – Campo que identifica a relação da contraparte com a entidade responsável pela gestão, sendo preenchido com:

- “SG”, Contraparte é parte relacionada com a entidade responsável pela gestão;
- “DP”, Entidade participante é parte relacionada com o depositário;
- “OUT”, Entidade participante é parte relacionada com outra entidade prevista no artigo 147.º do RGOIC;
- “OIC” Entidade participante corresponde a organismo de investimento coletivo objeto de reporte ou gerido por entidade que com ela se encontra em relação

de grupo para efeitos de consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13 do artigo 176.º do RGOIC;

- “NA”, caso a entidade participante não corresponda a nenhuma das entidades previstas no artigo 147.º do RGOIC.

Valor de avaliação 1 (Campo 9) – Campo que identifica o valor de uma das avaliações previstas na alínea b) do n.º 1 do artigo 144.º do RGOIC.

Data I (Campo 10) – Campo preenchido com a data da avaliação I.

Avaliador I (Campo 11) – Campo que identifica o avaliador I do ativo imobiliário e é preenchido com o respetivo n.º de perito responsável pela avaliação I.

Valor de avaliação II (Campo 12) – Campo que identifica o valor de uma das avaliações previstas na alínea b) do n.º 1 do artigo 144.º do RGOIC.

Data II (Campo 13) – Campo preenchido com a data da avaliação II.

Avaliador II (Campo 14) – Campo que identifica o avaliador II do ativo imobiliário e é preenchido com o respetivo n.º de perito responsável pela avaliação II.

Data do contrato promessa de compra e venda (Campo 15) – Campo que, caso exista, identifica a data relativa à celebração do contrato de promessa de compra e venda.

Data da transação (Campo 16) – Campo que identifica a data de transação do ativo imobiliário.

Valor da transação (Campo 17) – Campo preenchido com o valor da transação em euros.

Meio de pagamento (Campo 18) – Campo que identifica o meio de pagamento da transação sendo preenchido com:

- “ESP”, pagamento efetuado em espécie;
- “NUM”, pagamento efetuado em numerário;
- “CHQ”, pagamento em cheque;
- “TRB”, pagamento efetuado através de transferência bancária.

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão
1	Tipo de transação	2 carateres alfanuméricos
2	País do ativo imobiliário	2 carateres alfanuméricos
3	Código do ativo imobiliário	28 carateres alfanuméricos
4	Descrição do ativo imobiliário	200 carateres alfanuméricos
5	País da contraparte	2 carateres alfanuméricos
6	Código da contraparte	20 carateres alfanuméricos
7	Descrição da contraparte	200 carateres alfanuméricos
8	Tipo de contraparte	3 carateres alfanuméricos, NA
9	Valor de avaliação 1	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais
10	Data I	ISO 8601
11	Avaliador I	8 carateres numéricos

12	Valor de avaliação II	16 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
13	Data II	ISO 8601
14	Avaliador II	8 caracteres numéricos
15	Data do contrato promessa de compra e venda	ISO 8601
16	Data da transação	ISO 8601
17	Valor da transação	16 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
18	Meio de pagamento	3 caracteres alfanuméricos

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 5: Informação sobre os imóveis arrendados no mês, com os seguintes campos:

País do arrendatário (Campo 1) – Campo que identifica o país de residência do arrendatário.

Código do arrendatário (Campo 2) – Campo que identifica a entidade arrendatária e é preenchido com:

- Código LEI da entidade arrendatária;
- N.º de identificação fiscal, na ausência de código LEI.

Descrição do arrendatário (Campo 3) – Campo preenchido com o nome ou a denominação do arrendatário, sem utilização de abreviaturas.

País do ativo imobiliário (Campo 4) - Campo que identifica o país onde está localizado o imóvel.

Código do ativo imobiliário (Campo 5) - Campo que identifica o imóvel, sendo preenchido com:

- Código que corresponde a sua estrutura matricial quando o país do imóvel é Portugal. Este código tem por base a estrutura XXXXXX.T.YYYYYY.ZZZZZZZZ.AAA sendo que, “XXXXXX” identifica o código da freguesia, “T” identifica o tipo de prédio (“U” para prédio urbano, “R” para prédio rústico e “O” para prédio omissivo), “ZZZZZZZZ” identifica a fração ou secção de cada prédio (não podendo ser identificada mais do que uma fração ou secção mesmo que respeitem ao mesmo artigo matricial) e “AAA” (exclusivamente para prédios rústicos, caso os elementos referentes a árvore/colónia façam parte da identificação matricial);
- Código de registo que corresponde ao número de registo de imóvel cuja localização seja em país diferente de Portugal.

Descrição do ativo imobiliário (Campo 6) – Campo preenchido com a natureza e a denominação do imóvel de acordo com o disposto no n.º 4 do artigo 78.º do Regulamento da CMVM n.º 02/2015.

Contrato de arrendamento (Campo 7) – Campo que identifica se os contratos de arrendamento

são novos ou se apenas foram alterados, sendo a data de aquisição sendo considerada como data de arrendamento e sendo preenchido com:

- “N” – Novo contrato de arrendamento;
- “A” – Alteração de contrato de arrendamento já existente.

Data do arrendamento (Campo 8) – Campo que identifica a data de celebração ou de alteração do contrato de arrendamento vigente (data de aquisição considerada como a data de arrendamento).

Data de vencimento do contrato (Campo 9) – Campo que identifica a data de vencimento do contrato de arrendamento.

Valor da renda (Campo 10) – Campo preenchido com o valor da renda mensal contratada em euros.

Tipo de Opção (Campo 11) – Campo que regista a existência de uma opção sobre o imóvel pelo arrendatário ou OII, sendo preenchido com:

- “C”, opção de compra do imóvel pelo arrendatário;
- “V”, opção de venda do imóvel pelo OII.

Preço de exercício da opção (Campo 12) – Campo preenchido com o preço de exercício da opção em euros. É preenchido com “NA” quando não é determinável.

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão*
1	País do arrendatário	2 carateres alfanuméricos
2	Código do arrendatário	20 carateres alfanuméricos
3	Descrição do arrendatário	200 carateres alfanuméricos
4	País do ativo imobiliário	2 carateres alfanuméricos
5	Código do ativo imobiliário	28 carateres alfanuméricos
6	Descrição do ativo imobiliário	200 carateres alfanuméricos
7	Contrato de arrendamento	1 carácter alfanumérico
8	Data do arrendamento	ISO 8601
9	Data de vencimento do contrato	ISO 8601
10	Valor da renda	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais
11	Tipo de Opção	1 carácter alfanumérico
12	Preço de exercício da opção	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os carateres “ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 6: Informação sobre as rendas e os valores de venda em mora, com os seguintes campos:

País do ativo imobiliário (Campo 1) – Campo que informa sobre o país onde está localizado o ativo imobiliário no qual o OII detém a participação.

Código do ativo imobiliário (Campo 2) – Campo que identifica o imóvel, sendo preenchido com:

- Código que corresponde a sua estrutura matricial quando o país do imóvel é Portugal. Este código tem por base a estrutura XXXXXX.T.YYYYYY.ZZZZZZZ.AAA sendo que, “XXXXXX” identifica o código da freguesia, “T” identifica o tipo de prédio (“U” para prédio urbano, “R” para prédio rústico e “O” para prédio omissivo), “ZZZZZZZ” identifica a fração ou secção de cada prédio (não podendo ser identificada mais do que uma fração ou secção mesmo que respeitem ao mesmo artigo matricial) e “AAA” (exclusivamente para prédios rústicos, caso os elementos referentes a árvore/colónia façam parte da identificação matricial);
- Código de registo que corresponde ao número de registo de imóvel cuja localização seja em país diferente de Portugal.

Descrição do ativo imobiliário (Campo 3) – Campo preenchido com a natureza e a denominação do imóvel de acordo com o disposto no n.º 4 do artigo 78.º do Regulamento da CMVM n.º 02/2015.

Tipo de valor em dívida (Campo 4) – Campo que identifica o código de tipo de valor em dívida sendo preenchido com:

- “R”, para um valor de dívida decorrente de renda;
- “V”, para um valor de dívida decorrente de venda.

País do devedor (Campo 5) – Campo preenchido com a identificação do país de residência do devedor.

Código do devedor (Campo 6) – Campo que identifica a entidade devedora, sendo preenchido com:

- Código LEI da entidade contraparte;
- Número de identificação fiscal, não existindo código LEI.

Descrição do devedor (Campo 7) - Campo preenchido com a natureza e a denominação do devedor, sem utilização de abreviaturas.

Valor em dívida (Campo 8) – Campo preenchido com o valor em dívida em euros.

Data de mora (Campo 9) – Campo preenchido com a data a partir da qual se gerou a situação de mora.

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão*
1	País do ativo imobiliário	2 caracteres alfanuméricos
2	Código do ativo imobiliário	28 caracteres alfanuméricos
3	Descrição do ativo imobiliário	200 caracteres alfanuméricos
4	Tipo de valor em dívida	1 carácter alfanumérico
5	País do devedor	2 caracteres alfanuméricos
6	Código do devedor	20 caracteres alfanuméricos
7	Descrição do devedor	200 caracteres alfanuméricos
8	Valor em dívida	16 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
9	Data de mora	ISO 8601

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 7: Informação sobre os imóveis objeto de benfeitorias no mês, com os seguintes campos:

País do ativo imobiliário (Campo 1) - Campo que informa sobre o país onde está localizado o ativo imobiliário no qual o OII detém a participação.

Código do ativo imobiliário (Campo 2) – Campo que identifica o imóvel, sendo preenchido com:

- Código que corresponde a sua estrutura matricial quando o país do imóvel é Portugal. Este código tem por base a estrutura XXXXXX.T.YYYYYY.ZZZZZZZ.AAA sendo que, “XXXXXX” identifica o código da freguesia, “T” identifica o tipo de prédio (“U” para prédio urbano, “R” para prédio rústico e “O” para prédio omissos), “ZZZZZZZ” identifica a fração ou secção de cada prédio (não podendo ser identificada mais do que uma fração ou secção mesmo que respeitem ao mesmo artigo matricial) e “AAA” (exclusivamente para prédios rústicos, caso os elementos referentes a árvore/colónia façam parte da identificação matricial);
- Código de registo que corresponde ao número de registo de imóvel cuja localização seja em país diferente de Portugal.

Descrição do ativo imobiliário (Campo 3) – Campo preenchido com a natureza e a denominação do imóvel de acordo com o disposto no n.º 4 do artigo 78.º do Regulamento da CMVM n.º 02/2015.

Valor da benfeitoria (Campo 4) – Campo preenchido com o valor da benfeitoria reconhecido no mês (montante incorporado no valor de aquisição do imóvel refletido na correspondente subconta das rubricas 31-Terrenos ou 32-Construções do Plano de Contas dos OII.

Campo	1	2	3	4
Identificação	País do ativo imobiliário	Código do ativo imobiliário	Descrição do ativo imobiliário	Valor da benfeitoria
Domínio e Dimensão*	2 caracteres alfanuméricos	2 caracteres alfanuméricos	200 caracteres alfanuméricos	16 caracteres numéricos, com 2 decimais

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 8: Informação sobre a constituição de depósitos (empréstimos) bancários no mês, com os seguintes campos:

País da instituição de crédito (Campo 1) – Campo que informa sobre o país onde está localizada a instituição de crédito onde o OII contratou o depósito (empréstimo).

Código da instituição de crédito (Campo 2) – Campo que identifica a instituição de crédito, sendo preenchido com:

- Código LEI da entidade contraparte;
- Número de identificação fiscal, não existindo código LEI.

Descrição da instituição de crédito (Campo 3) – Campo preenchido com a denominação da instituição de crédito onde foi constituído o depósito (empréstimo), de acordo com o disposto no n.º 4 do artigo 78.º do Regulamento da CMVM n.º 02/2015.

Tipo de depósito (Campo 4) – Campo que identifica o código de tipo de depósito (empréstimo), sendo preenchido com

- “O”, para um depósito à ordem;
- “P”, para um depósito a prazo;
- “E”, para um empréstimo;
- “D”, para um descoberto.

Data de constituição (Campo 5) – Campo preenchido com a data de constituição do depósito (empréstimo).

Data de vencimento (Campo 6) – Campo preenchido com a data de vencimento do depósito (empréstimo).

Código da moeda (Campo 7) – Campo preenchido com a moeda do depósito (empréstimo).

Valor do depósito (Campo 8) – Campo preenchido com o valor do depósito (empréstimo) em euros.

Valor da taxa de juro (Campo 9) – Campo preenchido com a percentagem da taxa de juro do depósito (empréstimo).

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão*
1	País da instituição de crédito	2 carateres alfanuméricos
2	Código da instituição de crédito	20 carateres alfanuméricos
3	Descrição da instituição de crédito	200 carateres alfanuméricos
4	Tipo de depósito	1 carácter alfanumérico
5	Data de constituição	ISO 8601
6	Data de vencimento	ISO 8601
7	Código da moeda	ISO 4217
8	Valor do depósito	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais
9	Valor da taxa de juro	20 carateres numéricos, com 6 casas decimais

* Não são permitidos os carateres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 9: Informação sobre os contratos de promessa de compra e de venda em vigor, com os seguintes campos:

Tipo de transação (Campo 1) – Campo que informa sobre o tipo de transação, sendo preenchido com:

- “C”, Compra;
- “V”, Venda;
- “PA”, Permuta Adquirido;
- “PC”, Permuta Cedido.

País do ativo imobiliário (Campo 2) – Campo que informa sobre o país onde está localizado o ativo imobiliário no qual o OII detém a participação.

Código do ativo imobiliário (Campo 3) – Campo que identifica o imóvel, sendo preenchido com:

- Código que corresponde a sua estrutura matricial quando o país do imóvel é Portugal. Este código tem por base a estrutura XXXXXX.T.YYYYYY.ZZZZZZZ.AAA sendo que, “XXXXXX” identifica o código da freguesia, “T” identifica o tipo de prédio (“U” para prédio urbano, “R” para prédio rústico e “O” para prédio omissivo), “ZZZZZZZ” identifica a fração ou secção de cada prédio (não podendo ser identificada mais do que uma fração ou secção, desde que respeitem ao mesmo artigo matricial) e “AAA” (exclusivamente para prédios rústicos, caso os elementos referentes a árvore/colónia façam parte da identificação matricial);
- Código de registo que corresponde ao número de registo de imóvel cuja localização seja em país diferente de Portugal.

Descrição do ativo imobiliário (Campo 4) – Campo que identifica a natureza e a denominação do ativo imobiliário, sendo preenchido com:

- Natureza e denominação no caso de imóvel ou direito, nos termos do disposto no n.º 4 do artigo 78.º do Regulamento da CMVM n.º 2/2015;
- Denominação social da sociedade imobiliária, sem utilização de abreviaturas.

País da contraparte (Campo 5) – Campo que identifica o país de residência da contraparte da transação.

Código da contraparte (Campo 6) – Campo que identifica a contraparte na transação, sendo preenchido com:

- Código LEI da entidade contraparte;
- Número de identificação fiscal, não existindo código LEI.

Descrição da contraparte (Campo 7) – Campo preenchido com o nome ou denominação da contraparte, sem utilização de abreviaturas.

Tipo de contraparte (Campo 8) – Campo que identifica a relação da contraparte com a entidade responsável pela gestão, sendo preenchido com:

- “SG”, Contraparte é parte relacionada com a entidade responsável pela gestão;
- “DP”, Entidade participante é parte relacionada com o depositário;
- “OUT”, Entidade participante é parte relacionada com outra entidade prevista no artigo 147.º do RGOIC;
- “OIC” Entidade participante corresponde a organismo de investimento coletivo objeto de reporte ou gerido por entidade que com ela se encontre em relação de grupo para efeitos de consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13 do artigo 176.º do RGOIC;
- “NA”, caso a entidade participante não corresponda a nenhuma das entidades previstas no artigo 147.º do RGOIC.

Valor de avaliação 1 (Campo 9) – Campo que identifica o valor de uma das avaliações previstas na alínea b) do n.º 1 do artigo 144.º do RGOIC.

Data I (Campo 10) – Campo preenchido com a data da avaliação I.

Avaliador I (Campo 11) – Campo que identifica o avaliador I do ativo imobiliário e é preenchido com o respetivo n.º de perito responsável pela avaliação I.

Valor de avaliação II (Campo 12) – Campo que identifica o valor de uma das avaliações previstas na alínea b) do n.º 1 do artigo 144.º do RGOIC.

Data II (Campo 13) – Campo preenchido com a data da avaliação II.

Avaliador II (Campo 14) – Campo que identifica o avaliador II do ativo imobiliário e é preenchido com o respetivo n.º de perito responsável pela avaliação II.

Data do contrato promessa de compra e venda (Campo 15) – Campo que identifica a data de celebração do contrato de promessa de compra e venda.

Data prevista para celebração da escritura (Campo 16) – Campo preenchido com a última data em que, nos termos contratuais, a escritura pode ocorrer.

Valor adiantado (Campo 17) – Campo preenchido com o valor pago ou recebido, até à data, em euros.

Valor prometido (Campo 18) – Campo preenchido com o valor acordado transacionar em euros.

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão*
1	Tipo de transação	2 carateres alfanuméricos
2	País do ativo imobiliário	2 carateres alfanuméricos
3	Código do ativo imobiliário	28 carateres alfanuméricos
4	Descrição do ativo imobiliário	200 carateres alfanuméricos
5	País da contraparte	2 carateres alfanuméricos
6	Código da contraparte	20 carateres alfanuméricos
7	Descrição da contraparte	200 carateres alfanuméricos
8	Tipo de contraparte	3 carateres alfanuméricos, NA
9	Valor de avaliação 1	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais
10	Data I	ISO 8601
11	Avaliador I	8 carateres numéricos
12	Valor de avaliação II	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais
13	Data II	ISO 8601
14	Avaliador II	8 carateres numéricos
15	Data do contrato promessa de compra e venda	ISO 8601
16	Data prevista para celebração da escritura	ISO 8601
17	Valor adiantado	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais
18	Valor prometido	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os carateres “ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

ANEXO 15

COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA DA CARTEIRA DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro
----------	--------------------------

Reporte da carteira dos OII	Ficheiro de dados	CFINNNNNNFFFSSSS0AAAAMMDD.XML
	<p>CFI identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.</p>	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "CFI" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_CFI_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre os imóveis da carteira, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo que identifica o código de categoria do elemento patrimonial, sendo preenchido de acordo com o código de categoria da tabela 1.

País do imóvel (Campo 2): É preenchido com a identificação do país do imóvel.

Código do imóvel (Campo 3): Campo que identifica o código do imóvel que integra a carteira sob gestão, sendo preenchido com:

- Imóvel sito em Portugal ou direitos sobre esse imóvel: Caso o campo "país do imóvel" seja preenchido com o código "PT", é preenchido com o código que corresponde à sua identificação matricial, tendo por base a seguinte estrutura:
XXXXXX.T.YYYYYY.ZZZZZZZZ.AAA

Em que:

- 'XXXXXX' identifica o código da freguesia;
- 'T' identifica o tipo de prédio preenchido com as constantes 'U', 'R' ou 'O', consoante se trate de prédio urbano, prédio rústico ou prédio omissivo;
- 'YYYYYY' identifica o número do artigo;
- 'ZZZZZZZZ' identifica a fração ou seção de cada prédio, não podendo ser identificada mais do que uma fração ou secção mesmo que respeitem ao mesmo artigo matricial; e

- 'AAA' identifica, exclusivamente para prédios rústicos, a árvore/colónia. É preenchido caso os referidos elementos façam parte da identificação matricial.
- Imóvel sito fora de Portugal ou direitos sobre esse imóvel: Caso o campo "país do ativo" seja preenchido com o código diferente de "PT", é preenchido com o código que corresponde ao seu registo no país da sua localização.

Descrição do imóvel (Campo 4): Campo que identifica a designação do imóvel, contendo a respetiva natureza e a denominação de acordo com o disposto no n.º 4 do artigo 78.º do Regulamento da CMVM n.º 2/2015, na sua versão atualizada, atendendo, em particular, ao regime de propriedade horizontal.

Código do conjunto imobiliário (Campo 5): Campo que identifica o código do conjunto dos imóveis que integram a carteira sob gestão, sendo preenchido com:

- Conjunto de imóveis sitos em Portugal ou direitos sobre esse imóvel: Caso o campo "país do ativo" seja preenchido com o código "PT", é preenchido com o código que corresponde à sua identificação matricial, tendo por base a seguintes estrutura: XXXXXX.T.YYYYYY

Em que:

- 'XXXXXX' identifica o código da freguesia;
- 'T' identifica o tipo de prédio preenchido com as constantes 'U', 'R' ou 'O', consoante se trate de prédio urbano, prédio rústico ou prédio omissivo;
- 'YYYYYY' identifica o número do artigo;
- Conjunto de imóveis sitos fora de Portugal ou direitos sobre esse imóvel: Caso o campo "país do ativo" seja preenchido com o código diferente de "PT", é preenchido com o código que corresponde ao seu registo no país da sua localização.

Município (Campo 6): Campo que identifica o município onde se localiza o imóvel.

Descrição do conjunto imobiliário (Campo 7): Campo que identifica a designação do conjunto imobiliário ou empreendimento em que o imóvel se encontra integrado.

Utilização (Campo 8): Campo que identifica a utilização dada ao imóvel sendo que deve ser preenchido com os códigos:

- "H", habitação;
- "C", comércio;
- "T", turístico, incluindo hotelaria;
- "S", serviços;
- "I", industrial;
- "L", logística; ou

- “O”, outros.

No que respeito aos terrenos é preenchido com os códigos:

- “A”, arrendados;
- “N”, não arrendados;
- “FA”, florestais arrendados;
- “FN”, florestais não arrendados.

No que respeito aos direitos é preenchido com os códigos:

- “DA”, direitos de arrendamento;
- “DC”, direitos de concessão;
- “DE”, direitos de exploração;
- “DS”, direitos de superfície; e
- “OD”, outros direitos.

Informação sobre o imóvel (Campo 9): Campo que identifica a informação sobre o imóvel e que deve ser preenchido com os códigos:

- “H”, hipoteca;
- “P”, penhora;
- “A”, arresto;
- “S”, servidões;
- “C”, comodato;
- “CR”, consignação de rendimentos;
- “DR”, direitos de retenção;
- “DU”, direitos de usufruto;
- “DS”, direito de superfície; ou
- “O”, outros/não aplicável.

Caso o imóvel possua mais que um dos ónus ou encargos referidos, deverão ser todos reportados.

Área (Campo 10): Campo que identifica a área bruta do imóvel, em metros quadrados, relevante para efeitos da respetiva avaliação.

Valor da renda (Campo 11): Campo que identifica a renda bruta mensal contratada, em euros, no caso do imóvel se encontrar arrendado.

Data de aquisição (Campo 12): Campo que identifica a data em que foi adquirido o ativo.

Preço de aquisição (Campo 13): Campo que identifica o preço de aquisição, incluindo os custos decorrentes da aquisição e encargos relativos a obras de beneficiação do imóvel.

Data I (Campo 14): Campo que identifica a data relativa ao valor de avaliação I.

Avaliador I (Campo 15): Campo que identifica o número de registo na CMVM do perito

responsável pela avaliação I.

Valor da avaliação I (Campo 16): Campo que identifica o valor em euros da menor das avaliações legalmente exigidas.

Data II (Campo 17): Campo que identifica a data relativa ao valor de avaliação II.

Avaliador II (Campo 18): Campo que identifica o número de registo na CMVM do perito responsável pela avaliação II.

Valor da avaliação II (Campo 19): Campo que identifica o valor em euros da maior das avaliações legalmente exigidas.

Data III (Campo 20): Campo que identifica:

- A data relativa ao valor da avaliação III, se aplicável;
- “NA”, caso não aplicável.

Avaliador III (Campo 21): Campo que identifica:

- O número de registo na CMVM do perito avaliador responsável pela avaliação III, se aplicável;
- “NA”, caso não aplicável.

Valor da avaliação III (Campo 22): Campo que identifica:

- O valor da terceira avaliação legalmente exigida, se aplicável;
- “NA”, caso não aplicável.

Código da moeda (Campo 23): Campo que identifica o código da moeda em que o valor originariamente se encontra expresso, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217.

Montante total (Campo 24): Campo que identifica o valor do imóvel na carteira, em euros.

Montante total na moeda de referência da carteira (Campo 25): Campo que identifica o valor total do imóvel na carteira, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão*
1	Código de categoria	Código da tabela 1
2	Pais do imóvel	2 carateres alfanuméricos
3	Código do imóvel	100 carateres numéricos
4	Descrição do imóvel	200 carateres alfanuméricos
5	Código do conjunto imobiliário	100 carateres numéricos
6	Município	50 carateres alfanuméricos
7	Descrição do conjunto imobiliário	200 carateres alfanuméricos
8	Utilização	2 carateres alfanuméricos
9	Informação sobre o imóvel	23 carateres alfanuméricos
10	Área	15 carateres numéricos, sem casas decimais

11	Valor da renda	12 carateres numéricos, com 2 casas decimais
12	Data de aquisição	ISO 8601
13	Preço de aquisição	18 carateres numéricos, com 4 casas decimais
14	Data I	ISO 8601
15	Avaliador I	8 carateres numéricos
16	Valor da avaliação I	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais
17	Data II	ISO 8601
18	Avaliador II	8 carateres numéricos
19	Valor da avaliação II	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais
20	Data III	ISO 8601, NA
21	Avaliador III	8 carateres numéricos, NA
22	Valor da avaliação III	16 carateres numéricos, com 2 casas decimais, NA
23	Código da moeda	ISO 4217
24	Montante total	10 carateres numéricos, com 2 casas decimais
25	Montante total na moeda de referência da carteira	10 carateres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os carateres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Tabela 2 - Códigos de categoria dos ativos em carteira nos OII

Código de Categoria	Designação
IMÓVEIS SITUADOS EM ESTADOS DA UNIÃO EUROPEIA	
CC01	Terrenos Urbanizados
CC02	Terrenos Não Urbanizados
CC03	Projetos de Construção de Reabilitação
CC04	Outros Projetos de Construção
CC05	Construções Acabadas Arrendadas
CC06	Construções Acabadas Não arrendadas
CC07	Direitos
IMÓVEIS SITUADOS FORA DA UNIÃO EUROPEIA	
CC08	Terrenos Urbanizados
CC09	Terrenos Não urbanizados
CC10	Projetos de Construção de Reabilitação
CC11	Outros Projetos de Construção
CC12	Construções Acabadas Arrendadas
CC13	Construções Acabadas Não arrendadas
CC14	Direitos

Bloco de informação número 2: Informação sobre participações na carteira, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo que identifica o código de categoria do elemento patrimonial, sendo preenchido de acordo com o código de categoria da tabela 2.

Código do ativo (Campo 2): Campo que identifica o código do ativo que integra a carteira sob gestão, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number (ISIN)*, nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável;
- O *Classification of Financial Instruments (CFI)*, nos termos definidos na Norma ISO 10962, sempre que não exista ISIN;
- “NA” caso não existam ISIN e CFI.

Código da entidade (Campo 3): Campo que identifica o código LEI, em relação à entidade responsável pela gestão do organismo de investimento coletivo, à sociedade imobiliária, ao emitente ou à contraparte, caso aplicável.

Descrição da entidade (Campo 4): Campo que identifica a denominação da entidade responsável pela gestão do organismo de investimento coletivo, da sociedade imobiliária, do emitente ou o nome ou denominação da contraparte, consoante o caso, e caso aplicável.

País da entidade (Campo 5): Campo que identifica o país da entidade responsável pela gestão do organismo de investimento coletivo, da sociedade imobiliária, do emitente ou da contraparte, caso aplicável.

Grupo (Campo 6): Campo que é preenchido, quando aplicável, com as constantes “S” e “N”, consoante o ativo ou passivo seja ou não:

- Emitido ou garantido por entidades previstas nas alíneas a) a h) do artigo 147.º do RGOIC;
- Emitido por organismo de investimento coletivo gerido pela entidade responsável pela gestão do organismo objeto de reporte ou gerido por entidade que com ela se encontre em relação de grupo para efeitos de consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13 do artigo 176.º do RGOIC; ou
- Emitido por entidade em relação de grupo para efeitos de consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13.º do artigo 176.º do RGOIC, com outro emitente de outro ativo em carteira.

Entidade de grupo (Campo 7): Campo que é preenchido, no caso do campo “Grupo” ser igual a “S”, do seguinte modo:

- Estando em causa a situação prevista na alínea a) do campo “Grupo”, é inserida a abreviatura “SG”, “DP” ou “OUT” consoante a entidade que tenha emitido esteja relacionada com a entidade responsável pela gestão, com o depositário ou com outra

entidade, respetivamente. No caso de a entidade ser enquadrável em mais do que uma opção deverá ser utilizada a abreviatura “SG” em detrimento de “DP” e “OUT” ou “DP” em detrimento de “OUT”.

- Estando em causa a situação prevista na alínea b) do campo “Grupo”, é inserida a abreviatura “OIC”; ou;
- Estando em causa a situação prevista na alínea c) do campo “Grupo”, é inserido o código de identificação do ativo, utilizando para o efeito a abreviatura “G” seguida de um número sequencial (com início em “00001” para o primeiro grupo até “nnnnn” para o grupo “n”), que se estabeleça uma relação historicamente inequívoca e constante com o grupo. Esta identificação deverá ser igual para todo os fundos geridos por uma entidade responsável pela gestão.

Percentagem adquirida (Campo 8): Campo que é preenchido com a percentagem do capital social da sociedade imobiliária detido em carteira.

Método de avaliação (Campo 9): Campo que identifica o critério adotado na valorização de participações em sociedades imobiliárias, sendo preenchido com:

- “D”, fluxos de caixa descontados;
- “M”, múltiplos;
- “T”, transações; ou
- “C”, custo.

Tipo de outros valores (Campo 10): Campo que identifica no caso de organismos de investimento imobiliário sob a forma societária autogerida, sendo preenchido com:

- “I”, caso respeite a outros valores ativos e passivos relativos à carteira de investimento;
- “N”, caso respeite a outros valores necessários ao desenvolvimento da atividade do organismo.

Quantidade do ativo (Campo 11): Campo que identifica a quantidade do ativo em carteira.

Preço do ativo (Campo 12): Campo que é preenchido com o valor unitário do ativo em carteira na moeda em que foi adquirido.

Código da moeda (Campo 13): Campo que identifica o código da moeda em que o valor originariamente se encontra expresso, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217.

Montante total (Campo 14): Campo que identifica o valor total do ativo em carteira, em euros.

Montante total na moeda de referência da carteira (Campo 15): Campo que identifica o valor total do ativo na carteira, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão*
1	Código de categoria	Código da tabela 2
2	Código do ativo	15 carateres numéricos, com 6 casas decimais
3	Código da entidade	20 carateres alfanuméricos
4	Descrição da entidade	30 carateres alfanuméricos
5	Pais da entidade	2 carateres alfanuméricos
6	Grupo	1 carácter alfanumérico
7	Entidade de grupo	6 carateres alfanuméricos
8	Percentagem adquirida	5 carateres numéricos, com 2 casas decimais
9	Método de avaliação	1 carácter alfanumérico
10	Tipo de outros valores	1 carácter alfanumérico
11	Quantidade do ativo	15 carateres numéricos, com 6 casas decimais.
12	Preço do ativo	22 carateres numéricos, com 10 casas decimais
13	Código da moeda	ISO 4217
14	Montante total	10 carateres numéricos, com 2 casas decimais
15	Montante total na moeda de referência da carteira	10 carateres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os carateres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Tabela 2 - Códigos de categoria de participações em carteira nos OII

Código de Categoria	Designação
UP's Domiciliados em Estados da União Europeia	
CC01	Organismos de investimento imobiliário
CC02	Outros
UP's Domiciliados fora da União Europeia	
CC03	Organismos de investimento imobiliário
CC04	Outros
Participações em Sociedades Imobiliárias na UE	
CC05	Ações
CC06	Quotas
CC07	Direitos de subscrição
CC08	Outras participações
Participações em Sociedades Imobiliárias fora da UE	
CC09	Ações
CC10	Quotas
CC11	Direitos de subscrição
CC12	Outras participações

Bloco de informação número 3: Informação sobre outros ativos e passivos na carteira, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo que identifica o código de categoria dos ativos e

passivos, sendo preenchido com o código da tabela 3.

Descrição do ativo (Campo 2): Campo que identifica a designação do ativo ou passivo.

País do emitente ou da contraparte (Campo 3): Campo que identifica, se aplicável, o país do emitente ou contraparte.

Código do emitente (Campo 4): Campo que identifica, se aplicável, o código LEI relativo ao emitente ou contraparte.

Descrição do emitente ou da contraparte (Campo 5): Campo que identifica, se aplicável, o nome ou denominação do emitente ou contraparte.

Data de emissão (Campo 6): Campo que identifica a data de emissão ou constituição do ativo ou passivo, se aplicável.

Data de maturidade (Campo 7): Campo que identifica a data na qual o valor ativo ou passivo se vence, se aplicável.

Grupo (Campo 8): Campo que é preenchido com “S” ou “N”, consoante o ativo ou o passivo seja ou não:

- a. Emitido ou garantido por entidade previstas nas alíneas a) a h) do artigo 147.º do RGOIC;
- b. Emitido por organismo de investimento coletivo gerido pela entidade responsável pela gestão do organismo objeto de reporte ou gerido por entidade que com ela se encontre em relação de grupo para efeitos de consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13 do artigo 176.º do RGOIC; ou
- c. Emitido por entidade em relação de grupo para efeitos de consolidação de contas, na aceção referida no n.º 13 do artigo 176.º do RGOIC, com outro emitente de outro ativo em carteira.

Entidade de grupo (Campo 9): Campo que é preenchido caso o campo “Grupo” ser igual a “S”, do seguinte modo:

- Estando em causa situação prevista na alínea a) do campo “Grupo”, é inserida a abreviatura “SG”, “DP” ou “OUT” consoante a entidade que tenha emitido ou garantido o ativo ou passivo esteja relacionada com a entidade responsável pela gestão, com o depositário ou com outra entidade, respetivamente. No caso de a entidade ser enquadrável em mais do que uma opção deverá ser utilizada a abreviatura “SG” em detrimento de “DP” e “OUT” ou “DP” em detrimento de “OUT”.
- Estando em causa a situação prevista na alínea b) do campo “Grupo”, é inserida a abreviatura “OIC”, ou
- Estando em causa a situação prevista na alínea c) do campo “Grupo”, é inserido o código de identificação do ativo, utilizando para o efeito a abreviatura

“G” seguida de um número sequencial (com início em “00001” para o primeiro grupo até “nnnnn” para o grupo “n”), que estabeleça uma relação historicamente inequívoca e constante com o grupo. Esta identificação deverá ser igual para todos os fundos geridos por uma entidade responsável pela gestão.

Tipo de outros valores (Campo 10): Campo que identifica no caso de organismos de investimento coletivo em valores mobiliários, de organismos de investimento alternativo em valores mobiliários e de organismo de investimento em ativos não financeiros, sob a forma societária autogerida, sendo preenchido com:

- “I”, caso respeite a outros valores ativos e passivos relativos à carteira de investimento;
- “N”, caso respeite a outros valores necessários ao desenvolvimento da atividade do organismo.

Código da moeda (Campo 11): Campo que identifica a moeda em que o ativo ou passivo originariamente se encontra expresso, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217.

Montante total (Campo 12): Campo que identifica o valor total do ativo ou passivo na carteira, em euros.

Montante total na moeda de referência da carteira (Campo 13): Campo que identifica o valor total do ativo ou passivo na carteira, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão*
1	Código de categoria	Código da tabela 3
2	Descrição do ativo	40 caracteres alfanuméricos
3	País do emitente ou da contraparte	2 caracteres alfanuméricos
4	Código do emitente	20 caracteres alfanuméricos
5	Descrição do emitente ou da contraparte	30 caracteres alfanuméricos
6	Data de emissão	ISO 8601
7	Data de maturidade	ISO 8601
8	Grupo	1 carácter alfanumérico
9	Entidade de grupo	6 caracteres alfanuméricos
10	Tipo de outros valores	1 carácter alfanumérico
11	Código da moeda	ISO 4217
12	Montante total	10 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
13	Montante total na moeda de referência da carteira	10 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Tabela 3 - Códigos de categoria dos outros ativos e passivos dos OII

Código de Categoria	Designação
Liquidez	
CC01	Numerário
CC02	Depósitos à Ordem
CC03	Organismos do mercado monetário
CC04	Depósitos com pré-aviso e a prazo
CC05	Certificados de depósito
CC06	Valores mobiliários com prazo de vencimento residual inferior a 12 meses
Empréstimos	
CC07	Empréstimos obtidos
CC08	Descobertos
Valores ativos a regularizar	
CC09	Adiantamentos por conta de imóveis
CC10	Adiantamentos por conta de sociedades imobiliárias
CC11	Valores a receber por conta de transações de imóveis
CC12	Rendas em dívida
CC13	Outros
Valores passivos a regularizar	
CC14	Recebimentos por conta de imóveis
CC15	Recebimentos por conta de sociedades imobiliárias
CC16	Valores a pagar por conta de transações de imóveis
CC17	Cauções
CC18	Rendas adiantadas
CC19	Outros

Bloco de informação número 4: Informação adicional sobre a carteira, com os seguintes campos:

Código da moeda de referência da carteira (Campo 1): Campo que identifica a moeda de referência da carteira, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217 (apenas no caso de ser diferente do euro).

Valor líquido global (Campo 2): Campo que identifica o valor líquido global do OII em euros.

N.º Unidades de participação total (Campo 3): Campo que identifica o total de unidades de participação em circulação dos OII.

Valor líquido global na moeda de referência da carteira (Campo 4): Campo que identifica o valor líquido global do OII, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Ativo sob gestão (Campo 5): Campo que identifica o ativo sob gestão (AUM) para o OII, em euros, sendo calculado nos termos definidos no Regulamento Delegado (EU) n.º 231/2013 da Comissão de 19 de dezembro de 2012.

Ativo sob gestão na moeda de referência da carteira (Campo 6): Campo que identifica o ativo sob gestão (AUM) para os OII, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro), sendo calculado nos termos definidos no Regulamento Delegado (EU) n.º

231/2013 da Comissão de 19 de dezembro de 2012.

Ativos líquidos (Campo 7): Campo que identifica o valor total de ativos líquidos do OII, em euros.

Ativos líquidos na moeda de referência da carteira (Campo 8): Campo que identifica o valor total de ativos líquidos do OII, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Valor de posições equivalentes nos ativos subjacentes relativamente a instrumentos financeiros derivados detidos (Campo 9): Campo que identifica o valor das posições equivalentes nos ativos subjacentes a instrumentos financeiros derivados detidos, em euros.

Valor de posições equivalentes nos ativos subjacentes relativamente a instrumentos financeiros derivados detidos na moeda de referência da carteira (Campo 10): Campo que identifica o valor das posições equivalentes nos ativos subjacentes a instrumentos financeiros derivados detidos, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Valor do investimento noutros OIC geridos pela entidade responsável pela gestão (Campo 11): Campo que identifica o valor do investimento noutros OIC detidos pela entidade responsável pela gestão, em euros.

Valor do investimento noutros OIC geridos pela entidade responsável pela gestão na moeda de referência da carteira (Campo 12): Campo que identifica o valor do investimento noutros OIC detidos pela entidade responsável pela gestão, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão*
1	Código da moeda de referência da carteira	ISO 4217
2	Valor líquido global	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
3	N.º Unidades de participação total	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais
4	Valor líquido global na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
5	Ativo sob gestão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
6	Ativo sob gestão na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
7	Ativos líquidos	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

8	Ativos líquidos na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
9	Valor de posições equivalentes nos ativos subjacentes relativamente a instrumentos financeiros derivados detidos	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
10	Valor de posições equivalentes nos ativos subjacentes relativamente a instrumentos financeiros derivados detidos na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
11	Valor do investimento noutros OIC geridos pela entidade responsável pela gestão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
12	Valor do investimento noutros OIC geridos pela entidade responsável pela gestão na moeda de referência da carteira	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 5: Informação sobre as unidades de participação, com os seguintes campos:

Categoria de unidades de participação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- “C”, seguido de 1 ou 2 caracteres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- “NA”, sempre que não existam categorias de unidades de participação.

N.º Unidades de participação por categoria (Campo 2): Campo que identifica o n.º de unidades de participação por categoria de unidades de participação existente.

Pré-aviso de resgate (Campo 3): Campo que identifica o pré-aviso de resgate em número dias para cada categoria de unidades de participação existente.

Campo	Identificação	Domínio e Dimensão
1	Categoria de unidades de participação	Dimensão mínima de 2 e máxima de 3 caracteres
2	N.º Unidades de participação por categoria	20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais
3	Pré-aviso de resgate	4 caracteres numéricos

Bloco de informação número 6: Informação sobre as responsabilidades extrapatrimoniais, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo que identifica o código de categoria do elemento extrapatrimonial, sendo preenchido com o código da tabela 4.

Descrição do ativo (Campo 2): Campo que identifica a designação da responsabilidade extrapatrimonial.

País do emitente ou da contraparte (Campo 3): Campo que identifica o país do emitente ou

contraparte.

Código do emitente (Campo 4): Campo que identifica o emitente ou contraparte sendo preenchido com o:

- O código LEI, quando aplicável;
- “NA”, quando não aplicável.

Montante total (Campo 5): Campo que identifica o montante total da responsabilidade extrapatrimonial incluindo juros decorridos, em euros.

Montante total na moeda de referência da carteira (Campo 6): Campo que identifica o valor total da responsabilidade extrapatrimonial, na moeda de referência da carteira (apenas no caso de ser diferente do euro).

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Código de categoria	Descrição do ativo	País do emitente ou da contraparte	Código do emitente	Montante total	Montante total na moeda de referência da carteira
Domínio e Dimensão*	Código da tabela 4	40 caracteres alfanuméricos	2 caracteres alfanuméricos	20 caracteres alfanuméricos, NA	10 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	10 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!” e “?”.

Tabela 4 - Códigos de categoria das responsabilidades extrapatrimoniais do OII

Código de Categoria	Designação
Compromissos com e de terceiros	
CC01	Direitos de arrendamento
CC02	Direitos de concessão
CC03	Direitos de exploração
CC04	Direitos de superfície
CC05	Outros direitos

ANEXO 16

VALOR DAS UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do valor das unidades de participação	Ficheiro de dados	VUPNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	VUP identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "VUP" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_VUP_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Código do OIC (Campo 1): Campo que identifica o código do OIC e com o código do compartimento patrimonial autónomo, ambos atribuídos pela CMVM. Caso o organismo de investimento coletivo não integre compartimentos patrimoniais autónomos a componente do compartimento patrimonial é preenchida com '0000'.

Categoria de unidades de participação (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- "C", seguido de 1 ou 2 caracteres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- "NA", sempre que não existam categorias de unidades de participação.

Código da moeda de comercialização (Campo 3): Campo que identifica o código da moeda em que as unidades de participação são comercializadas.

Valor da unidade de participação (Campo 4): Campo que identifica o valor da unidade de participação respeitante à data do ficheiro.

Rendimento distribuído por unidade de participação (Campo 5): Campo que identifica o valor do rendimento distribuído por unidade de participação respeitante à data da carteira utilizada para o cálculo do valor da unidade de participação.

Valor de amortização de capital por unidade de participação (Campo 6): Campo que identifica o valor da amortização de capital por unidade de participação respeitante nas reduções de capital em que não haja reembolso de unidades de participação na data da carteira utilizada

para o cálculo do valor da unidade de participação.

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Código do OIC	Categoria de unidades de participação	Código da moeda de comercialização	Valor da unidade de participação	Rendimento distribuído por unidade de participação	Valor de amortização de capital por unidade de participação
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 8 caracteres numéricos	Dimensão mínima de 2 e máxima de 3 caracteres	ISO 4217	Dimensão máxima de 12 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 12 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 12 caracteres numéricos, com 4 casas decimais

ANEXO 17

DOCUMENTOS CONSTITUTIVOS E OUTRA INFORMAÇÃO RELEVANTE SOBRE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO

I. Especificidades relativas ao reporte do prospeto

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do prospeto	Ficheiro de texto	FPCNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	FPC identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo, 'AAAA' corresponde ao ano, 'MM' ao mês, 'DD' ao dia a que se refere a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

II. Especificidades relativas ao reporte de informações fundamentais destinadas aos investidores

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informações fundamentais destinadas aos investidores	Ficheiro de texto	FIINNNNNNFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	FI identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo, 'AAAA' corresponde ao ano, 'MM' ao mês, 'DD' ao dia a que se refere a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

III. Especificidades relativas ao reporte do prospeto de oferta pública de distribuição

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do prospeto de oferta pública de distribuição	Ficheiro de texto	FPONNNNNNFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	FPO identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo, 'AAAA' corresponde ao ano, 'MM' ao mês, 'DD' ao dia a que se refere a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

IV. Especificidades relativas ao reporte do regulamento de gestão

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do regulamento de gestão	Ficheiro de texto	FRGNNNNNNFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	FRG identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo, 'AAAA' corresponde ao ano, 'MM' ao mês, 'DD' ao dia a que se refere a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

V. Especificidades relativas ao reporte do documento informativo

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do documento informativo	Ficheiro de texto	DIFNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMDD.PDF
	<p>DIF identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo, 'AAAA' corresponde ao ano, 'MM' ao mês, 'DD' ao dia a que se refere a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.</p>	

VI. Especificidades relativas ao reporte de informação relevante

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte da informação relevante	Ficheiro de texto	FIRNNNNNNFFFFSSSSZZS0AAAAMDD.PDF
	<p>Informação relevante OIC: FIR identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' algarismo que corresponde a um carater fixo, 'ZZ' corresponde ao tipo de informação relevante de acordo com a listagem em Anexo, 'S' corresponde a um número sequencial atribuído pela entidade responsável pela gestão que permite a publicação de mais do que uma informação relevante na mesma data para o mesmo organismo, 'AAAA' corresponde ao ano, 'MM' corresponde ao mês, 'DD' ao dia em que se realiza o reporte da informação.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'.</p> <p>Informação relevante SGOIC: o nome do ficheiro segue as regras acima descritas, com as seguintes adaptações: 'FFFF' com os algarismos '0000', 'SSSS' com os algarismos '0000' e 'ZZ' com o código '00'.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.</p>	

A – TABELA QUE IDENTIFICA A LISTAGEM DE INFORMAÇÃO RELEVANTE

ZZ - Tipo de Informação objeto de anúncio

01 - Constituição do OIC

02 - Alteração da denominação do OIC

- 03 - Alteração da Entidade Gestora**
- 04 - Alteração da Entidade Depositária**
- 05 - Alteração das Entidades Comercializadoras**
- 06 - Alteração significativa da política de investimentos**
- 07 - Alteração da política de distribuição de rendimentos**
- 08 - Aumento global das comissões de gestão e de depósito**
- 09 - Outras alterações das comissões**
- 10 - Aumento de capital**
- 11 - Redução de capital**
- 12 - Distribuição de rendimentos**
- 13 - Erro de valorização**
- 14 - Disponibilização do Relatório Anual**
- 15 - Disponibilização do Relatório Semestral**
- 17 - Anúncio de lançamento de oferta pública de distribuição**
- 18 - Adenda ao prospeto de oferta pública**
- 19 - Admissão à negociação**
- 20 - Fusão**
- 21 - Transformação**
- 22 - Liquidação e Extinção**
- 23 - Prorrogação da duração**
- 24 - Prorrogação do prazo de liquidação**
- 25 - Convocatória de Assembleia Geral**
- 26 - Outros factos relevantes**
- 28 - Alteração do Auditor do OIC**
- 29 - Outras alterações da política de investimentos**
- 30 - Alteração do prazo de cálculo ou de divulgação do valor das unidades de participação**
- 31 - Cisão**
- 32 - Factos com impacto no normal funcionamento da atividade do OIC ou dos seus ativos**

**RELATÓRIOS ESPECÍFICOS NO ÂMBITO DA ATIVIDADE DE GESTÃO DE ORGANISMOS
DE INVESTIMENTO COLETIVO**

I. Especificidades relativas ao reporte das memórias da evolução do processo de liquidação dos OII a que alude o artigo 43.º n.º 2, al. b) do RGOIC

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte das memórias da evolução do processo de liquidação dos OII a que alude o artigo 43.º n.º 2, al. b) do RGOIC	Ficheiro de texto	MLINNNNNNFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	MLI identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

II. Especificidades relativas ao reporte de ponto de situação e memória descritiva das diligências efetuadas a que alude o artigo 43.º n.º 10, al. f), ponto iii) do RGOIC

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de ponto de situação e memória descritiva das diligências efetuadas a que alude o artigo 43.º n.º 10, al. f), ponto iii) do RGOIC	Ficheiro de texto	MDINNNNNNFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	MDI identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

III. Especificidades relativas ao reporte das operações vedadas a que alude o

artigo 147.º n.º 5 do RGOIC

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte das operações vedadas a que alude o artigo 147.º n.º 5 do RGOIC	Ficheiro de texto	VEDNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	VED identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

IV. Especificidades relativas ao reporte dos pareceres quando as avaliações dos OIAnF apresentem valores que diverjam entre si, mais de 20% a que alude o artigo 33.º, n.º 2 al. c) do Regulamento da CMVM n.º 2/2015

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte dos pareceres quando as avaliações dos OIAnF apresentem valores que diverjam entre si, mais de 20% a que alude o artigo 33.º, n.º 2 al. c) do Regulamento da CMVM n.º 2/2015	Ficheiro de texto	PADNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	PAD identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

ANEXO 19

RISCOS E ENCARGOS DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

I. Especificidades relativas ao *value at risk* dos organismos de investimento coletivo VAR

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do ficheiro <i>value at risk</i>	Ficheiro de dados	VARNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	VAR identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "VAR" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_VAR_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Código do OIC (Campo 1): Campo que identifica o código de OIC e o código do compartimento patrimonial autónomo, ambos atribuídos pela CMVM. No caso de organismo de investimento coletivo que não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente do compartimento patrimonial autónomo é preenchida com '0000'.

Data da carteira (Campo 2): Campo que identifica a data da carteira.

Tipo de simulação (Campo 3): Campo que identifica o tipo de simulação:

- "M", simulação monte carlo;
- "H", simulação histórica;
- "P", VaR paramétrico.

Valor do VAR (Campo 4): Campo que identifica o VaR (absoluto), em euros, com referência ao último dia do mês a que respeita o reporte, tendo por pressuposto um intervalo de confiança de 99% para um período de 250 dias e assumindo um período de detenção de carteira de investimento em 20 dias. Caso a entidade responsável pela gestão calcule o VaR com pressupostos distintos dos anteriormente assumidos, além do valor apurado naqueles termos, reporta igualmente o VaR com os pressupostos por si assumidos.

Porcentagem do VLG (Campo 5): Campo que identifica o valor, em percentagem, correspondente ao quociente entre o VaR e o valor líquido global do organismo.

Pressupostos do VAR (Campo 6): Campo que identifica a entidade responsável pela gestão do reporte do VaR com pressupostos diferentes dos referidos no campo “Valor do VAR”, com os pressupostos assumidos separados pelo carácter “-”, seguindo a seguinte ordem: intervalo de confiança, período de detenção da carteira de investimento (em dias).

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Código do OIC	Data da carteira	Tipo de simulação	Valor do VAR	Porcentagem do VLG	Pressupostos do VAR
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 8 caracteres	ISO 8601	M, H, P	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

II. Especificidades relativas à rotação média da carteira e indicador sintético de risco e remuneração

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do ficheiro relativo à rotação média da carteira e indicador sintético de risco e remuneração	Ficheiro de dados	TGCNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	TGC identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "TGC" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_TGC_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser

preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Código do OIC (Campo 1): Campo que identifica o código de OIC e com o código do compartimento patrimonial autónomo, ambos atribuídos pela CMVM. No caso de organismo de investimento coletivo que não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente do compartimento patrimonial autónomo é preenchida com '0000'.

Rotação média da carteira (Campo 2): Campo que identifica o valor em percentagem da rotação média da carteira respeitante ao ano civil anterior.

Categoria de unidades de participação (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- “C”, seguido de 1 ou 2 carateres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- “NA”, sempre que não existam categorias de unidades de participação.

Indicador sintético de risco e de remuneração (Campo 4): Campo que identifica o valor em percentagem da volatilidade subjacente ao indicador sintético de risco e de remuneração em vigor.

Campo	1	2	3	4
Identificação	Código do OIC	Rotação média da carteira	Categoria de unidades de participação	Indicador sintético de risco e de remuneração
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 8 carateres	Dimensão máxima de 20 carateres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão mínima de 2 e máxima de 3 carateres	Dimensão máxima de 20 carateres numéricos, com 2 casas decimais

III. Especificidades relativas aos erros ocorridos no cálculo e divulgação do valor da unidade de participação ERR

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do ficheiro relativo aos erros no cálculo e	Ficheiro de dados	ERRNNNNNNFFFFSSSSYAAAAMDD.XML
	ERR identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, 'Y' respeita a	

divulgação do valor da unidade de participação	um número sequencial atribuído pela entidade responsável pela gestão que permite a comunicação de erros para uma mesma data e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação (última data do erro reportado). Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.
---	--

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "ERR" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_ERR_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o erro no valor da unidade de participação, com os seguintes campos:

Data (Campo 1): Campo que identifica a data a que respeita o valor da unidade de participação.

Valor correto (Campo 2): Campo que identifica o valor correto da unidade de participação.

Valor utilizado (Campo 3): Campo que identifica o valor utilizado da unidade de participação.

Diferença do valor da unidade de participação (Campo 4): Campo que identifica a diferença entre o valor correto e o valor utilizado.

Percentagem da diferença no valor da unidade de participação (Campo 5): Campo que identifica o quociente entre a diferença apurada no campo de informação anterior e o valor utilizado.

Operações (Campo 6): Campo que identifica o código de tipo de operação e deve ser preenchido com os códigos:

- "S", caso a operação se trate de subscrição de OIC;
- "R", caso a operação se trate de resgate de OIC.

Número de operações (Campo 7): Campo que identifica o número de operações de subscrição ou de resgate realizadas.

Categoria de unidades de participação (Campo 8): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- "C", seguido de 1 ou 2 caracteres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- "NA", sempre que não existam categorias de unidades de participação.

Quantidade (Campo 9): Campo que identifica o número de unidades de participação.

Valor apurado (Campo 10): Campo que identifica a diferença total considerando a discrepância entre o valor correto e o valor utilizado.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
Identificação	Data	Valor correto	Valor utilizado	Diferença do valor da up	Porcentagem da diferença no valor da up	Operações	Número de operações	Categoria de unidades de participação	Quantidade	Valor apurado
Domínio e Dimensão	ISO 8601	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	S,R	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos	Dimensão mínima de 2 e máxima de 3 caracteres	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais

Bloco de informação número 2: Informação sobre o ressarcimento, com os seguintes campos:

Entidade (Campo 1): Campo que identifica a entidade em função do código de tipo de ressarcimento e deve ser preenchido com os códigos:

- “O”, caso a informação respeite ao ressarcimento do OIC;
- “P”, caso a informação respeite ao ressarcimento dos participantes.

Data (Campo 2): Campo que identifica a data do crédito em conta do organismo de investimento coletivo ou a data do último pagamento para efeitos de conclusão do ressarcimento aos participantes.

Montante (Campo 3): Campo que identifica o valor pago, em euros.

Tipo de operação (Campo 4): Caso o campo “Entidade” seja preenchido com a constante “P”, é preenchido com o código de tipo de operação:

- “S”, caso se trate de subscrições de organismos de investimento coletivo;
- “R”, caso se trate de resgates de organismos de investimento coletivo.

Número de participantes (Campo 5): Caso o campo “Entidade” seja preenchido com a constante “P”, é preenchido com o número de participantes ressarcidos.

Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Entidade	Data	Montante	Tipo Operação	Número de participantes
Domínio e Dimensão	O, P	ISO 8601	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	S, R	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos

IV. Especificidades relativas às operações sobre ações ou valores mobiliários que dão direito à sua aquisição e operações sobre unidades de participação

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do ficheiro sobre transações	Ficheiro de dados	COPNNNNNNYAAAAMMDD.XML
	COP identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'Y' respeita a um número sequencial atribuído pela entidade responsável pela gestão que permite a comunicação de operações numa mesma data, 'AAAA' corresponde ao ano, 'MM' ao mês e 'DD' ao dia a que se refere a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "COP" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_COP_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre as operações sobre valores mobiliários, com os seguintes campos:

Tipo de adquirente ou alienante (Campo 1): Campo que identifica o tipo de adquirente e deve ser preenchido com os códigos:

- "OA", caso o adquirente ou alienante seja membro do órgão de administração da

entidade responsável pela gestão;

- “DI”, caso o adquirente ou alienante seja responsável pelas decisões de investimento;
- “OP”, caso seja outra pessoa com relação com membro do órgão de administração ou com o responsável pelas decisões de investimento.

Descrição do adquirente ou alienante (Campo 2): Campo que identifica o nome ou denominação do adquirente ou alienante, sem utilização de abreviaturas.

NIF do adquirente ou alienante (Campo 3): Campo que identifica o número de identificação fiscal do adquirente ou alienante.

Descrição da pessoa de relação (Campo 4): Caso o campo “Tipo de Adquirente ou Alienante” seja preenchido com a abreviatura “OP”, é preenchido com o nome da pessoa com a qual o adquirente ou alienante se encontra em relação, sem utilização de abreviaturas.

NIF da pessoa de relação (Campo 5): Caso o campo “Tipo de Adquirente ou Alienante” seja preenchido com a abreviatura “OP”, é preenchido com o número de identificação fiscal da pessoa com a qual o adquirente ou alienante se encontra em relação.

Tipo de relação (Campo 6): Caso o campo “Tipo de Adquirente ou Alienante” seja preenchido com a abreviatura “OP”, é preenchido com as abreviaturas “OA” ou “DI”, consoante a pessoa com a qual o adquirente ou alienante se encontra em relação seja membro do órgão de administração da entidade responsável pela gestão ou responsável pelas decisões de investimento.

Código do Ativo (Campo 7): Campo que identifica o código ISIN do valor mobiliário.

Descrição do Ativo (Campo 8): Campo que identifica a designação do ativo, independentemente da existência de código do ativo.

Operação (Campo 9): Campo que identifica o tipo de operação e deve ser preenchido com os códigos:

- “C”, caso se trate de uma operação de compra;
- “V”, caso se trate de uma operação de venda;
- “O”, caso se trate de outro tipo de operação.

Quantidade (Campo 10): Campo que identifica a quantidade de ativos envolvidos na operação.

Preço (Campo 11): Campo que identifica o preço do ativo ao qual a operação foi concretizada.

Descrição do intermediário financeiro (Campo 12): Campo que identifica a denominação do intermediário financeiro que intermediou a operação, sem utilização de abreviaturas.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8
Identificação	Tipo de adquirente ou alienante	Descrição do adquirente ou	NIF do adquirente ou alienante	Descrição da pessoa de relação	NIF da pessoa de relação	Tipo de relação	Código do Ativo	Descrição do Ativo

		alienante						
Domínio e Dimensão	OA, DI, OP	Dimensão máxima de 200 caracteres*	NIF	Dimensão máxima de 200 caracteres*	NIF	OA, DI	ISO 6166	Dimensão máxima de 200 caracteres*

9	10	11	12
Operação	Quantidade	Preço	Descrição
C, V, O	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 200 caracteres*

* Não são permitidos os caracteres “ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 2: Informação sobre a carteira do(s) OIC(s) geridos à data das operações sobre valores mobiliários, com os seguintes campos:

Código do Ativo (Campo 1): Campo que identifica o código ISIN.

Código do OIC (Campo 2): Campo que identifica com o código de OIC e com o código do compartimento patrimonial autónomo, ambos atribuídos pela CMVM. No caso de organismo de investimento coletivo que não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente do compartimento patrimonial autónomo é preenchida com ‘0000’.

Campo	1	2
Identificação	Código do Ativo	Código do OIC
Domínio e Dimensão	ISO 6166	Dimensão máxima de 8 caracteres

Bloco de informação número 3: Informação sobre as transações do(s) OIC(s) geridos à data

da operação sobre valores mobiliários, com os seguintes campos:

Código do Ativo (Campo 1): Campo que identifica o código ISIN.

Código do OIC (Campo 2): Campo que identifica com o código de OIC e com o código do compartimento patrimonial autónomo, ambos atribuídos pela CMVM. No caso de organismo de investimento coletivo que não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente do compartimento patrimonial autónomo é preenchida com '0000'.

Operação (Campo 3): Campo que identifica o tipo de operação e deve ser preenchido com os códigos:

- “C”, caso se trate de uma operação de compra;
- “V”, caso se trate de uma operação de venda;
- “O”, caso se trate de outro tipo de operação.

Quantidade (Campo 4): Campo que identifica a quantidade de ativos envolvidos na operação.

Preço (Campo 5): Campo que identifica o preço do ativo ao qual a operação foi concretizada.

Descrição do intermediário financeiro (Campo 6): Campo que identifica a denominação do intermediário financeiro que intermediou a operação, sem utilização de abreviaturas.

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Código do Ativo	Código do OIC	Operação	Quantidade	Preço	Descrição do intermediário financeiro
Domínio e Dimensão	ISO 6166	Dimensão máxima de 8 caracteres	C, V, O	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 200 caracteres*

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 4: Informação sobre as comunicações de operações sobre unidades de participação realizadas pela entidade responsável pela gestão, com os seguintes campos:

Tipo de adquirente ou alienante (Campo 1): Campo que identifica o tipo de adquirente e deve ser preenchido com os códigos:

- “OA”, caso o adquirente ou alienante seja membro do órgão de administração da entidade responsável pela gestão;

- “DI”, caso o adquirente ou alienante seja responsável pelas decisões de investimento;
- “OP”, caso seja outra pessoa com relação com membro do órgão de administração ou com o responsável pelas decisões de investimento.

Descrição do adquirente ou alienante (Campo 2): Campo que identifica o nome ou denominação do adquirente ou alienante, sem utilização de abreviaturas.

NIF do adquirente ou alienante (Campo 3): Campo que identifica o número de identificação fiscal do adquirente ou alienante.

Descrição da pessoa de relação (Campo 4): Caso o campo “Tipo de Adquirente ou Alienante” seja preenchido com a abreviatura “OP”, é preenchido com o nome da pessoa com a qual o adquirente ou alienante se encontra em relação, sem utilização de abreviaturas.

NIF da pessoa de relação (Campo 5): Caso o campo “Tipo de Adquirente ou Alienante” seja preenchido com a abreviatura “OP”, é preenchido com o número de identificação fiscal da pessoa com a qual o adquirente ou alienante se encontra em relação.

Tipo de relação (Campo 6): Caso o campo “Tipo de Adquirente ou Alienante” seja preenchido com a abreviatura “OP”, é preenchido com as abreviaturas “OA” ou “DI”, consoante a pessoa com a qual o adquirente ou alienante se encontra em relação seja membro do órgão de administração da entidade responsável pela gestão ou responsável pelas decisões de investimento.

Código do OIC (Campo 7): Campo que identifica o código de OIC e com o código do compartimento patrimonial autónomo, ambos atribuídos pela CMVM. No caso de organismo de investimento coletivo que não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente do compartimento patrimonial autónomo é preenchida com ‘0000’.

Operação (Campo 8): Campo que identifica o tipo de operação e deve ser preenchido com os códigos:

- “C”, caso se trate de uma operação de compra;
- “V”, caso se trate de uma operação de venda;
- “O”, caso se trate de outro tipo de operação.

Quantidade (Campo 9): Campo que identifica a quantidade de ativos envolvidos na operação.

Preço (Campo 10): Campo que identifica o preço do ativo ao qual a operação foi concretizada.

Comissões (Campo 11): Campo que identifica o valor das comissões suportadas.

Porcentagem de comissões (Campo 12): Campo que identifica a percentagens de comissões suportadas.

Descrição da entidade comercializadora (Campo 13): Campo que identifica a denominação da entidade comercializadora, sem utilização de abreviaturas. Caso se trate de aquisição ou alienação de unidades de participação admitidas à negociação em mercado, indicar o(s) mercado(s) de realização da operação.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Identificação	Tipo de adquirente ou alienante	Descrição do adquirente ou alienante	NIF do adquirente ou alienante	Descrição da pessoa de relação	NIF da pessoa de relação	Tipo de relação	Código do OIC	Operação	Quantidade
Domínio e Dimensão	OA, DI, OP	Dimensão máxima de 200 caracteres*	NIF	Dimensão máxima de 200 caracteres*	NIF	OA, DI	Dimensão máxima de 8 caracteres	C, V, O	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos

10	11	12	13
Preço	Comissões	Percentagem de comissões	Descrição da entidade comercializadora
Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 200 caracteres*

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

ANEXO 20

INFORMAÇÃO FINANCEIRA RELATIVA AO BALANÇO E DEMONSTRAÇÃO DOS RESULTADOS DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de Rubricas do Balanço, Demonstração dos Resultados	Ficheiro de dados	DEFNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMDD.XML
	DEF identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "DEF" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_DEF_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre as rubricas de balanço de organismos de investimento coletivo (OIC), com os seguintes campos:

Código de conta (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de conta, sendo preenchido de acordo com o código de conta da tabela 1.

Valor de conta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o saldo da conta no final de cada período de reporte, sendo preenchido com um valor positivo para as rubricas de ativo e passivo, e com um valor positivo ou negativo para as rubricas de capital próprio.

Campo	1	2
Identificação	Código de conta	Valor de conta
Domínio e Dimensão	Código da tabela 1	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Tabela 3 - Códigos de conta das rubricas de balanço

Código de Conta	Designação
BL01	Ativo total
BL02	Caixa e depósitos à ordem
BL03	Outras disponibilidades
BL04	Carteira de títulos e participações
BL05	Mais e menos valias de títulos e participações
BL06	Outros ativos da carteira
BL07	Ativos imobiliários
BL08	Ajustamentos em ativos imobiliários
BL09	Devedores
BL10	Acréscimos de proveitos
BL11	Despesas com custo diferido
BL12	Outros ativos
BL13	Capital total
BL14	Unidades de participação
BL15	Variações patrimoniais

BL16	Resultados transitados
BL17	Resultado líquido do exercício
BL18	Outras variações no capital
BL19	Passivo total
BL20	Resgates e rendimentos a pagar a participantes
BL21	Outros credores
BL22	Acréscimos de custos
BL23	Receitas com proveito diferido
BL24	Empréstimos obtidos
BL25	Provisões
BL26	Outros passivos

Bloco de informação número 2: Informação sobre as rubricas da demonstração dos resultados dos OIC, com os seguintes campos:

Código de conta (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de conta, sendo preenchido de acordo com o código de conta da tabela 2.

Valor de conta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o saldo da conta no final de cada período de reporte, sendo preenchido com um valor positivo ou negativo, consoante a rubrica contribua de modo positivo ou negativo para o resultado líquido do exercício.

Campo	1	2
Identificação	Código de conta	Valor de conta
Domínio e Dimensão	Código da tabela 2	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Tabela 4 - Códigos de conta das rubricas da demonstração dos resultados

Código de Conta	Designação
DR01	Juros e proveitos equiparados
DR02	Juros e custos equiparados
DR03	Rendimento de títulos, participações e outros ativos
DR04	Ganhos em operações financeiras
DR05	Perdas em operações financeiras
DR06	Comissões e taxas
DR07	Outros fornecimentos e serviços externos
DR08	Aumentos/reversões de provisões
DR09	Proveitos e ganhos eventuais
DR10	Custos e perdas eventuais
DR11	Outros proveitos e ganhos
DR12	Outros custos e perdas
DR13	Resultado antes de impostos
DR14	Imposto sobre o rendimento do exercício
DR15	Resultado líquido do exercício

ANEXO 21

INFORMAÇÃO RELATIVA AOS DOCUMENTOS DE PRESTAÇÃO DE CONTAS SEMESTRAIS E ANUAIS DOS ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do Relatório e Contas	Ficheiro de texto	FRCNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	FRC identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

ANEXO 22

INFORMAÇÃO RELATIVA AO RELATÓRIO DE AUDITORIA DOS ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informação do relatório de auditoria	Ficheiro de dados	RDANNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMMDD.XML
	RDA identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "RDA" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_RDA_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser

preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o conteúdo do relatório de auditoria (RDA) dos organismos de investimento coletivo (OIC), com os seguintes campos:

Tipo de opinião (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as características do RDA, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “SRE”, para RDA sem reservas e ênfases;
- “CRE”, para RDA com reservas e ênfases;
- “OCR”, para RDA com reservas e sem ênfases;
- “OCE”, para RDA com ênfases e sem reservas;
- “EDO”, para uma escusa de opinião;
- “ADV”, para uma opinião adversa.

Campo	1
Identificação	Tipo de opinião
Domínio e Dimensão	SRE, CRE, OCR, OCE, EDO, ADV

Bloco de informação número 2: Informação sobre as reservas no RDA, com os seguintes campos:

Identificação de reservas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCR”, e que identifica um número sequencial de 1 a n, sendo n o número total de reservas.

Descrição da reserva (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCR”, e que identifica o texto da reserva que consta do RDA.

Campo	1	2
Identificação	Identificação de reservas	Descrição da reserva
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 3 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos *

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 3: Informação sobre as ênfases no RDA, com os seguintes campos:

Identificação de ênfases (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCE”, e que identifica um número sequencial de 1 a n, sendo n o número total de ênfases.

Descrição da ênfase (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCE”, e que identifica o texto da ênfase que consta do RDA.

Campo	1	2
Identificação	Identificação de ênfases	Descrição da ênfase
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 3 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos *

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!” e “?”.

Bloco de informação número 4: Informação sobre o auditor que assina o RDA, com os seguintes campos:

Número de registo do revisor oficial de contas (ROC) (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o número de registo na CMVM do ROC que assina o RDA.

Número de registo da SROC (Campo 2): Campo que identifica o número de registo na CMVM da SROC a qual pertence o revisor oficial de contas (ROC) que assina o RDA.

Campo	1	2
Identificação	Número de registo do ROC	Número de registo da SROC
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 8 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 8 caracteres numéricos

ANEXO 23

INFORMAÇÃO SOBRE PARTICIPAÇÕES EM ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO ESTRANGEIROS COMERCIALIZADOS EM PORTUGAL

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Comercialização de OIC estrangeiros em Portugal	Ficheiro de dados	OVMNNNNNN0AAAAMDD.XML
	OVM identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "OVM" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_OVM_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação (“reporte nulo”)

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de “NULO” nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteúdoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Código ISIN da Participação (Campo 1): Campo que identifica o código ISIN da participação, ou seja, das unidades de participação ou ações comercializadas (de uma determinada categoria ou classe) em Portugal.

Código OIA (Campo 2): Campo a ser preenchido para os organismos de investimento alternativo que não disponham de informação para preencher o campo “Código ISIN da Participação”, sendo preenchido com o código LEI ou, na sua indisponibilidade, com o código da participação atribuído para o efeito pela CMVM, ou seja, das unidades de participação ou ações comercializadas (de um determinado compartimento patrimonial autónomo) em Portugal.

Tipo de investidores (Campo 3): Campo que identifica o tipo de investidores sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NP”, se for investidor não profissional;
- “PR”, se for investidor profissional; ou
- “CE”, se for contraparte elegível.

Valor da participação (Campo 4): Campo que identifica o valor das participações em circulação em Portugal, à data de referência da informação, expresso em euros, considerando o câmbio à data da informação, somente no que respeita à atividade da entidade comercializadora em Portugal.

Valor das subscrições / aquisições (Campo 5): Campo que identifica o valor das subscrições / aquisições efetuadas em Portugal, durante o mês, expresso em euros, considerando o câmbio à data da operação, somente no que respeita à atividade da entidade comercializadora em Portugal.

Valor dos resgates / alienações (Campo 6): Campo que identifica o valor dos resgates / alienações efetuadas em Portugal, durante o mês, expresso em euros, considerando o câmbio à data da operação, somente no que respeita à atividade da entidade comercializadora em Portugal.

Número de participantes (Campo 7): Campo que identifica o número de participantes em Portugal, à data de referência da informação, somente no que respeita à atividade da entidade comercializadora em Portugal.

Número de participações (Campo 8): Campo que identifica o número de unidades de

participação ou ações detidas em Portugal, à data de referência da informação, somente no que respeita à atividade da entidade comercializadora em Portugal.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8
Identificação	Código ISIN da participação	Código OIA	Tipo de investidores	Valor da participação	Valor das subscrições / aquisições	Valor dos resgates / alienações	Número de participantes	Número de participações
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 12 caracteres alfanuméricos*	Dimensão máxima de 20 caracteres alfanuméricos*	Dimensão máxima de 2 caracteres alfanuméricos. * NP, PR, CE	Dimensão máxima de 10 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 10 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 10 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 10 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 10 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres " ", " * ", " ! " e " ? ".

ANEXO 24

Receção e transmissão de ordens por conta de outrem

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Receção e transmissão de ordens por conta de outrem	Ficheiro de dados	RTONNNNNN0AAAAMMDD.XML
	RTO identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "RTO" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_RTO_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação ("reporte nulo")

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de "NULO" nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteúdoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre a atividade de receção e transmissão de ordens por conta de outrem sobre instrumentos financeiros, com os seguintes campos:

Tipo de investidor (Campo 1): Campo que identifica o tipo de investidor que transmitiu a ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NP”, se for investidor não profissional;
- “PR”, se for investidor profissional;
- “CE”, se for contraparte elegível.

Residência do investidor (Campo 2): Campo que identifica a residência do investidor que transmitiu a ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “R”, para investidores residentes em Portugal;
- “N”, para outros investidores.

Canal de receção da ordem (Campo 3): Campo que identifica o tipo de canal de receção da ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “I”, para ordens recebidas através de sítio da Internet disponibilizado para o efeito;
- “E”, para ordens recebidas por outros meios eletrónicos de comunicação à distância, nomeadamente terminais que permitam a receção de ordens;
- “R”, para ordens provenientes de meios de reencaminhamento automático que façam interface com sistemas de outras entidades (*order routing*);
- “T”, para ordens recebidas através de telefone, presencialmente nas instalações da entidade ou por fax;
- “O”, para ordens recebidas através de outros canais.

Tipo de instrumento financeiro (Campo 4): Campo que identifica a tipologia do instrumento financeiro a que se refere a ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo não admitidas à negociação;
- “EF”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (*ETF*);

- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT” para contratos de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;
- “OV”, para contratos de opções de venda;
- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (*CFD*);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);
- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados.

Tipo de subjacente (Campo 5): Campo que identifica a tipologia do subjacente do instrumento financeiro derivado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NA”, quando o instrumento financeiro do campo anterior for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”;
- “AC”, para ações;
- “IN”, para índices;
- “TJ”, para taxas de juro;
- “TC”, para taxas de câmbio;
- “CR”, para crédito;
- “MC”, para mercadorias e licenças de emissão;
- “OT”, para outros subjacentes não especificados anteriormente.

Tipo de ordem (Campo 6): Campo que identifica o tipo de ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “C”, para ordens de compra;
- “V”, para ordens de venda.

Montante (Campo 7): Campo que identifica o montante de instrumentos financeiros das ordens executadas, sendo preenchido com:

- Montante efetivamente pago ou recebido pela realização da transação, excluindo-se os juros corridos no caso de instrumentos de dívida emitidos pelo Estado, entes públicos ou entidades privadas, quando a tipologia do instrumento financeiro no

campo 4 do bloco de informação número 1 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”;

- Montante correspondente ao produto entre o número de contratos negociados, a unidade de negociação dos mesmos e o respetivo preço da transação, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 4 do bloco de informação número 1 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “CT”, “OC”, “OV”, “CD”, “SW” ou “OD”.

Local de Execução (Campo 8): Campo que identifica o local onde ocorreu a execução da ordem, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code (MIC)*, nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as ordens executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada;
- “OEFM”, para as ordens executadas fora de plataformas de negociação e em que a entidade, isenta de risco, intermedia o encontro entre a ordem do comprador e a do vendedor.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8
Identificação	Tipo de investidor	Residência do investidor	Canal de receção da ordem	Tipo de instrumento financeiro	Tipo de subjacente	Tipo de ordem	Montante	Local de execução
Domínio e Dimensão	NP, PR, CE	R, N	I, E, R, T, O	AC, UP, EF, DU, PC, DI, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, OD	NA, AC, IN, TJ, TC, CR, MC, OT	C, V	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	MIC Code, OEFM

Bloco de informação número 2: Informação sobre o detalhe dos instrumentos financeiros objeto da atividade de receção e transmissão de ordens por conta de outrem, com os seguintes campos:

Código do instrumento financeiro (Campo 1): Campo que identifica o código do instrumento financeiro transacionado, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number (ISIN)*, nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável;
- Não existindo ISIN, o *Classification of Financial Instruments (CFI)*, nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Tipo de código do instrumento financeiro (Campo 2): Campo que identifica o tipo de código do instrumento financeiro transacionado, sendo preenchido com:

- “I”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código ISIN;
- “C”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código CFI.

Designação do instrumento financeiro (Campo 3): Campo que identifica a designação do instrumento financeiro.

Mercado de admissão (Campo 4): Campo que identifica o mercado onde o instrumento financeiro está admitido à negociação, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code* (MIC), nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as ordens executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada; Deve ser preenchido com o MIC Code do primeiro mercado onde o instrumento financeiro foi admitido à negociação. Caso exista mais do que um mercado nestas circunstâncias, deve ser considerado o mercado mais líquido;
- “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos em plataformas de negociação.

Tipo de instrumento financeiro (Campo 5): Campo que identifica a tipologia do instrumento financeiro a que se refere a ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo não admitidas à negociação;
- “EF”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (ETF);
- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT” para contratos de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;
- “OV”, para contratos de opções de venda;

- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (*CFD*);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);
- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados.

Tipo de subjacente (Campo 6): Campo que identifica a tipologia do subjacente do instrumento financeiro derivado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NA”, quando o instrumento financeiro do campo 5 do bloco de informação número 2 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”;
- “AC”, para ações;
- “IN”, para índices;
- “TJ”, para taxas de juro;
- “TC”, para taxas de câmbio;
- “CR”, para crédito;
- “MC”, para mercadorias e licenças de emissão;
- “OT”, para outros subjacentes não especificados anteriormente.

Tipo de ordem (Campo 7): Campo que identifica o tipo de ordem recebida pela entidade, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “C”, para ordens de compra;
- “V”, para ordens de venda.

Quantidade (Campo 8): Campo identifica a quantidade transacionada de ordens executadas, sendo preenchido com:

- Número de unidades, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 5 do bloco de informação número 2 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF” ou “ON”;
- Valor nominal, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 5 do bloco de informação número 2 for preenchido com um dos seguintes códigos: “DU”, “PC”, “DI”, “SW” ou “ON”;
- Número de contratos, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 5 do bloco de informação número 2 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “CT”, “OC”, “OV”, “CD”, “SW” ou “OD”.

Montante (Campo 9): Campo que identifica o montante de instrumentos financeiros das ordens executadas, sendo preenchido com o:

- Montante efetivamente pago ou recebido pela realização da transação, excluindo-se os juros corridos no caso de instrumentos de dívida emitidos pelo Estado, entes públicos ou entidades privadas, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 5 do bloco de informação número 2 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”.
- Montante correspondente ao produto entre o número de contratos negociados, a unidade de negociação dos mesmos e o respetivo preço da transação, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 5 do bloco de informação número 2 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “CT”, “OC”, “OV”, “CD”, “SW” ou “OD”.

Local de execução (Campo 10): Campo que identifica o local onde ocorreu a execução da ordem e deve ser preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code (MIC)*, nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as ordens executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.
- “OEFM”, para as ordens executadas fora de plataformas de negociação e em que a entidade, isento de risco, intermedia o encontro entre a ordem do comprador e a do vendedor.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
Identificação	Código do instrumento financeiro	Tipo de código do instrumento financeiro	Designação do instrumento financeiro	Mercado de Admissão	Tipo de instrumento financeiro	Tipo de subjacente	Tipo de Ordem	Quantidade	Montante	Local de Execução
Domínio e Dimensão	ISIN, CFI code	I, C	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*	MIC code, XXXX	AC, UP, EF, DU, PC, DI, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, OD	NA, AC, IN, TJ, TC, CR, MC, OT	C, V	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	MIC code, OEFM

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Anexo 25

Gestão de carteiras por conta de outrem

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro
-----------------	---------------------------------

Reporte de informação sobre o perfil das carteiras sob gestão	Ficheiro de dados	CCGNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	CCG identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "CCG" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_CCG_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação ("reporte nulo")

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de "NULO" nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro. Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes, com os seguintes campos:

Código de identificação de perfil de carteira (Campo 1): Campo que identifica, de forma unívoca, o código do perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes. É preenchido com um código interno definido pela entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem e é repetido nos reportes subsequentes enquanto este perfil estiver em vigor. Caso se trate de um perfil de carteira que não se enquadre em qualquer dos perfis padronizados é preenchido com o código "PNP".

Designação de perfil de carteira (Campo 2): Denominação do perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes. Caso o campo 1 do bloco de informação número 1 tenha sido preenchido com o código "PNP", este campo deve ser preenchido com a seguinte designação "Perfil não padronizado".

Número de carteiras individuais sob gestão (Campo 3): Campo que informa sobre o número de carteiras individuais sob gestão por conta de outrem para cada perfil de carteira à data de referência do reporte.

Montante global sob gestão (Campo 4): Campo que informa sobre o montante global sob gestão para cada perfil de carteira à data de referência do reporte. O montante é preenchido em euro.

Objetivo de referência ou de rentabilidade (Campo 5): Campo que informa sobre o objetivo definido para cada perfil de carteira.

Este campo é preenchido com um dos seguintes códigos:

- “B”, se o perfil de carteira identificar um objetivo de referência;
- “R”, se o perfil de carteira identificar um objetivo de rentabilidade;
- “NA” caso não esteja definido objetivo ou caso o campo 1 do bloco de informação número 1 tenha sido preenchido com o código “PNP”.

Descrição do objetivo do perfil de carteira (Campo 6): Campo que descreve o objetivo do perfil de carteira.

Este campo é preenchido com:

- Descrição do objetivo de referência do perfil de carteira se o campo 5 do bloco de informação número 1 tiver sido preenchido com “B”. Caso o objetivo de referência do perfil da carteira corresponda a um compósito de vários índices, cada um com uma determinada ponderação, deverá ser identificada a ponderação associada a cada um dos índices.
- Quantificação do objetivo de rentabilidade do perfil de carteira se o campo 5 do bloco de informação número 1 tiver sido preenchido com “R”.
- “NA” caso não esteja definido objetivo ou caso o campo 1 do bloco de informação número 1 tenha sido preenchido com o código “PNP”.

Instrumentos financeiros derivados (Campo 7): Campo que informa se o perfil de carteira pode incluir posições em instrumentos financeiros derivados ou transações com passivos contingentes.

Este campo é preenchido com um dos seguintes códigos:

- “PC” se o perfil da carteira admitir a inclusão de passivos contingentes.

- “DR” se o perfil da carteira admitir a inclusão de instrumentos financeiros derivados.
- “PD” se o perfil de carteira admitir a inclusão de passivos contingentes e instrumentos financeiros derivados.
- “NA” se o perfil de carteira não admitir passivos contingentes nem instrumentos financeiros derivados ou caso o campo 1 do bloco de informação número 1 tenha sido preenchido com o código “PNP”.

Caraterização de moeda (Campo 8): Campo que informa se o perfil de carteira inclui exposição a moedas diferentes do euro.

Este campo é preenchido com um dos seguintes códigos:

- “S”, se o perfil de carteira admitir a exposição a moedas diferentes do euro;
- “N”, se o perfil de carteira não admitir a exposição a moedas diferentes do euro;
- “NA” se não houver critério em relação à admissão de moedas diferentes do euro ou caso o campo 1 do bloco de informação número 1 tenha sido preenchido com o código “PNP”.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8
Identificação	Código de identificação de perfil de carteira	Designação de perfil de carteira	Número de carteiras individuais sob gestão	Montante global sob gestão	Objetivo de referência ou de rentabilidade	Descrição do objetivo do perfil de carteira	Instrumentos financeiros derivados	Caraterização de moeda
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 200 caracteres alfanuméricos* ou PNP	Dimensão máxima de 2000 caracteres do alfanuméricos*	Dimensão máxima de 10 caracteres numéricos	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	B, R, NA	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos, NA	PC, DR, PD, NA	S, N, NA

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 2: Informação sobre os limites referentes ao perfil de carteira indicado no campo 1 do bloco de informação número 1, de acordo com o definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes, com os seguintes campos. Caso o campo 1 do bloco de informação número 1 tenha sido preenchido com o código “PNP” este bloco não é incluído.

Código de identificação de perfil de carteira (Campo 1): Campo que identifica, de forma

unívoca, o código do perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes. É preenchido com um código interno definido pela entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem e é repetido nos reportes subsequentes enquanto este perfil estiver em vigor. Devem ser utilizados os mesmos códigos utilizados para o preenchimento do campo 1 do bloco de informação número 1.

Limite mínimo de exposição a ações/similares (Campo 2): Campo que informa sobre o limite inferior, para cada perfil de carteira, referente a ações, fundos de ações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a ações. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite máximo de exposição a ações/similares (Campo 3): Campo que informa sobre o limite superior, para cada perfil de carteira, referente a ações, fundos de ações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a ações. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite mínimo de exposição a obrigações/similares (Campo 4): Campo que informa sobre o limite inferior, para cada perfil de carteira, referente a obrigações, fundos de obrigações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a risco de crédito e de taxa de juro. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite máximo de exposição a obrigações/similares (Campo 5): Campo que informa sobre o limite superior, para cada perfil de carteira, referente a obrigações, fundos de obrigações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a risco de crédito e de taxa de juro. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite mínimo de exposição a ativos líquidos (Campo 6): Campo que informa sobre o limite inferior, para cada perfil de carteira, referente a depósitos à ordem e a prazo e outros instrumentos financeiros de dívida de curto prazo. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite máximo de exposição a ativos líquidos (Campo 7): Campo que informa sobre o limite superior, para cada perfil de carteira, referente a depósitos à ordem e a prazo e outros instrumentos financeiros de dívida de curto prazo. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite,

este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite mínimo de exposição a outros ativos (Campo 8): Campo que informa sobre o limite inferior, para cada perfil de carteira, referente a ativos com exposição ao mercado imobiliário ou outros ativos reais. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite máximo de exposição a outros ativos (Campo 9): Campo que informa sobre o limite superior, para cada perfil de carteira, referente a ativos com exposição ao mercado imobiliário ou outros ativos reais. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Identificação	Código de identificação de perfil de carteira	Limite mínimo ações/similares	Limite máximo ações/similares	Limite mínimo obrigações/similares	Limite máximo obrigações/similares	Limite mínimo ativos líquidos	Limite máximo ativos líquidos	Limite mínimo outros ativos	Limite máximo outros ativos
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 200 caracteres alfanuméricos* ou PNP	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!” e “?”.

Bloco de informação número 3: Informação sobre critérios de elegibilidade/restrições aplicáveis ao perfil de carteira indicado no campo 1 do bloco de informação número 1, de acordo com o definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes, com os seguintes campos. Caso o campo 1 do bloco de informação número 1 tenha sido preenchido com o código “PNP” este bloco de informação não é incluído.

Código de identificação de perfil de carteira (Campo 1): Campo que identifica, de forma unívoca, o código do perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes. É preenchido com um código interno definido pela entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem e é repetido nos reportes subsequentes enquanto este perfil estiver em vigor. Devem ser utilizados os mesmos códigos utilizados para o preenchimento do campo 1 do bloco de informação número 1.

Caraterização de notação de risco (Campo 2): Campo que informa sobre critérios de elegibilidade para cada perfil de carteira, relativas à notação de risco dos emitentes dos

respetivos ativos elegíveis. Caso não sejam aplicados critérios de elegibilidade/ restrições, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Caraterização de área geográfica (Campo 3): Campo que informa sobre critérios de elegibilidade para cada perfil de carteira, relativas a áreas geográficas de localização dos emitentes dos respetivos ativos elegíveis. Caso não sejam aplicados critérios de elegibilidade/ restrições, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Caraterização de sector (Campo 4): Campo que informa sobre critérios de elegibilidade para cada perfil de carteira, relativas aos sectores dos emitentes dos respetivos ativos elegíveis. Caso não sejam aplicados critérios de elegibilidade/ restrições, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Campo	1	2	3	4
Identificação	Código de identificação de perfil de carteira	Caraterização de notação de risco	Caraterização de área geográfica	Caraterização de sector
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 200 caracteres alfanuméricos* ou PNP	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos, NA	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos, NA	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos, NA

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informação sobre as carteiras sob gestão	Ficheiro de dados	GCONNNNNN0AAAAMMDD.XML
	GCO identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "GCO" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_GCO_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação (“reporte nulo”)

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de “NULO” nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro. Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Código de identificação de perfil de carteira (Campo 1): Campo que identifica, de forma unívoca, o código do perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes. É preenchido com um código interno definido pela entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem e é repetido nos reportes subsequentes enquanto este perfil estiver em vigor. Devem ser utilizados os mesmos códigos utilizados para o preenchimento do campo 1 do bloco de informação número 1 do ficheiro CCG.

Tipo de ativo (Campo 2): Campo que identifica a tipologia dos ativos, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo não admitidas à negociação;
- “EF”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (*ETF*);
- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT”, para contratos de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;

- “OV”, para contratos de opções de venda;
- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (*CFD*);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);
- “WR”, para *warrants*;
- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados;
- “UL”, para *unit linked*;
- “DO”, para depósitos à ordem correntes;
- “CM” para depósitos associados a contas margem;
- “DP”, para depósitos a prazo;
- “OT”, para outros ativos.

Tipo de subjacente (Campo 3): Campo que identifica a tipologia do subjacente do instrumento financeiro derivado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NA”, quando o ativo do campo anterior for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI”, “ON”, “UL”, “DO”, “DP” ou “OT”;
- “AC”, para ações;
- “IN”, para índices;
- “TJ”, para taxas de juro;
- “TC”, para taxas de câmbio;
- “CR”, para crédito;
- “MC”, para mercadorias e licenças de emissão;
- “OT”, para outros subjacentes não especificados anteriormente.

Código do ativo que integra a carteira sob gestão (Campo 4): Campo que identifica o código do ativo, sendo preenchido com:

Para instrumentos financeiros:

- O *International Standard Identification Number (ISIN)*, nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável.

- Não existindo ISIN, o *Classification of Financial Instruments* (CFI), nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Para outros ativos que não sejam instrumentos financeiros, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Tipo de código do ativo que integra a carteira sob gestão (Campo 5): Campo que identifica o tipo de código do ativo, sendo preenchido com:

Para instrumentos financeiros:

- “I”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código ISIN.
- “C”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código CFI.

Para outros ativos que não sejam instrumentos financeiros, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Mercado de admissão (Campo 6): Campo que identifica o mercado onde o instrumento financeiro está admitido à negociação, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code* (MIC), nos termos definidos na Norma ISO 10383, para instrumentos financeiros admitidos à negociação em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.

Deve ser preenchido com o MIC Code do primeiro mercado onde o instrumento financeiro foi admitido à negociação. Caso exista mais do que um mercado nestas circunstâncias, deve ser considerado o mercado mais líquido.

- “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos à negociação em plataforma de negociação.

Para outros ativos não sejam instrumentos financeiros, este campo deve ser preenchido com “NA”.

Designação do ativo que integra a carteira sob gestão (Campo 7): Campo relativo à designação do ativo.

Moeda (Campo 8): Campo que identifica a moeda em que o preço dos ativos originariamente se encontram expressos, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217.

Quantidade/Valor nominal (Campo 9): Campo que identifica a quantidade ou valor nominal de cada ativo.

Preço unitário (Campo 10): Campo que é preenchido com valor unitário do ativo em carteira na moeda em que se encontra expresso ou em percentagem quando se trate de um instrumento representativo de dívida.

Indicação de preço unitário (Campo 11): Campo preenchido com “V”, caso o campo anterior tenha sido preenchido com valor, “P”, caso tenha sido preenchido em percentagem.

Montante sob gestão (Campo 12): Campo que identifica o valor sob gestão, expresso em euros.

Exposição (Campo 13): Campo que identifica a exposição inerente aos instrumentos financeiros derivados, expresso em euros. As posições vendedoras deverão ser precedidas de sinal negativo.

Caraterização dos ativos em função da exposição da carteira (Campo 14): Campo que caracteriza o ativo em função da exposição, de acordo com o referido no bloco de informação número 2 do ficheiro CCG, sendo preenchido com:

- “AC”, para ações, fundos de ações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a ações;
- “OB”, para obrigações, fundos de obrigações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a risco de crédito e de taxa de juro;
- “LQ”, depósitos à ordem e a prazo e outros instrumentos financeiros de dívida de curto prazo;
- “AR”, ativos com exposição ao mercado imobiliário ou outros ativos reais;
- “OU” ativos com outras exposições.

Tipo de investidor (Campo 15): Campo que identifica o tipo de investidor que corresponde ao primeiro titular da carteira individual sob gestão, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NP”, se for investidor não profissional.
- “PR”, se for investidor profissional.
- “CE”, se for contraparte elegível.

Notação de risco da emissão ou do emitente (Campo 16): Campo que é preenchido com:

- A notação de risco da emissão do título de dívida, ou na sua inexistência, notação do risco do emitente à data da carteira, atribuído por agências internacionalmente

reconhecidas. No caso da existência de duas ou mais notações, corresponde à notação mais baixa.

- “NA”, no caso de inexistência de notação de risco da emissão ou do emitente.

Tipo de notação de risco (Campo 17): Campo que é preenchido com:

- “O”, se o campo anterior tiver sido preenchido com notação de risco da emissão;
- “E”, se o campo anterior tiver sido preenchido com notação de risco do emitente;
- “NA”, se o campo anterior tiver sido preenchido com “NA”.

País do emitente (Campo 18): Campo que identifica o país do emitente do instrumento financeiro. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Código do emitente (Campo 19): Campo que identifica o código LEI do emitente, sendo preenchido com nos termos da norma ISO 17442, apenas quando aplicável. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Descrição do emitente (Campo 20): Campo que identifica o nome ou denominação do emitente do instrumento financeiro. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8
Identificação	Identificação de perfil de carteira	Tipo de ativo	Tipo de subjacente	Código do ativo que integra a carteira sob gestão	Tipo de código do ativo que integra a carteira sob gestão	Mercado de admissão	Designação do ativo que integra a carteira sob gestão	Moeda
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 200 caracteres alfanuméricos* ou PNP	AC, DU, PC, DI, UP, EF, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, WR, OD, UL, DO, DP, OT	NA, AC, IN, TJ, TC, CR, MC, OT	ISIN, CFI, NA	I, C, NA	MIC Code, XXXX, NA	Dimensão máxima de 200 caracteres alfanuméricos	ISO 4217

* Não são permitidos os caracteres “ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Campo	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
-------	---	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----

Identificação	Quantidade/valor nominal	Preço unitário	Indicação do preço unitário	Montante sob gestão	Exposição	Caraterização dos ativos em função da exposição da carteira	Tipo de investidor	Notação de risco da emissão ou do emitente	Tipo de notação de risco	País do emitente	Código do emitente	Descrição do emitente
Domínio e Dimensão	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	V, P	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	AC, OB, LQ, AR, OU	NP, PR, CE	Dimensão máxima de 4 caracteres alfanuméricos *, NA	O, E, NA	Dimensão máxima de 2 caracteres alfanuméricos*	Código LEI, NA	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!” e “?”.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de operações das carteiras sob gestão	Ficheiro de dados	OPRNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	OPR identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "OPR" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_OPR_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação (“reporte nulo”)

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de “NULO” nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Data da operação (Campo 1): Campo que identifica a data da operação, nos termos da norma ISO 8601, verificada nas carteiras sob gestão. Deve ser preenchido para todos os dias do período

de referência em que se verificaram operações com impacto nas carteiras sob gestão, agregando todas as operações de determinado dia.

Tipo de operação (Campo 2): Campo que identifica o tipo de operação verificada, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “C”, para aquisições e outras operações similares, incluindo subscrições de OIC;
- “V”, para alienações e outras operações similares, incluindo resgates de OIC;
- “L” para levantamento de ativos e/ou numerário;
- “D”, para reforços de ativos e/ou numerário.

Código da origem da operação (Campo 3): Campo que identifica a origem da operação verificada na carteira sob gestão, sendo preenchido com:

- “GC”, para operações com origem no contrato de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrado com o cliente decididos pelo gestor;
- “OV”, para operações com origem em ordens vinculativas transmitidas pelo cliente.

Código do instrumento financeiro objeto da operação (Campo 4): Campo que identifica o código do instrumento financeiro objeto da operação, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number* (ISIN), nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável.
- Não existindo ISIN, o *Classification of Financial Instruments* (CFI), nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Para operações sobre outros ativos que não sejam instrumentos financeiros, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Tipo de código do instrumento financeiro objeto da operação (Campo 5): Campo que identifica o tipo de código do instrumento financeiro objeto da operação identificado no campo 4, sendo preenchido com:

- “I”, quando o código de instrumento financeiro no campo 4 for preenchido com um código ISIN;
- “C”, quando o código de instrumento financeiro no campo 4 for preenchido com um código CFI.

Se o campo 4 tiver sido preenchido com “NA”, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Tipo de ativo (Campo 6): Campo que identifica a tipologia dos ativos, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo não admitidas à negociação;
- “EF”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (*ETF*);
- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT”, para contratos de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;
- “OV”, para contratos de opções de venda;
- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (*CFD*);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);
- “WR”, para *warrants*;
- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados;
- “UL”, para *unit linked*;
- “DO”, para depósitos à ordem correntes;
- “CM”, para depósitos associados a contas margem;
- “DP”, para depósitos a prazo;
- “OT”, para outros ativos.

Mercado de admissão (Campo 7): Campo que identifica o mercado onde o instrumento financeiro identificado no campo 4 está admitido à negociação, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code (MIC)*, nos termos definidos na Norma ISO 10383, para instrumentos financeiros admitidos à negociação em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.

Deve ser preenchido com o MIC Code do primeiro mercado onde o instrumento financeiro foi admitido à negociação. Caso exista mais do que um mercado nestas circunstâncias, deve ser considerado o mercado mais líquido.

- “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos à negociação em plataforma de negociação.

Se o campo 4 tiver sido preenchido com “NA”, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Local de Execução (Campo 8): Campo que identifica o local onde ocorreu a operação sobre o instrumento financeiro identificado no campo 4, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code (MIC)*, nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as transações executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.
- “OECF”, para as operações executadas fora de plataformas de negociação e contra a carteira própria da entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem (internalização).
- “OEFM”, para as operações executadas fora de plataformas de negociação e em que a entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem, isenta de risco, intermedia o encontro entre a ordem do comprador e a do vendedor, não sendo ambos clientes da atividade de gestão de carteiras por conta de outrem.
- “OEGC”, para as operações executadas fora de plataformas de negociação e em que a entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem, isenta de risco, intermedia o encontro entre a ordem do comprador e a do vendedor, sendo ambos clientes da atividade de gestão de carteiras por conta de outrem.

Este campo apenas deve ser preenchido se o campo 2 tiver sido preenchido com o código “C” ou “V”.

Para outros ativos/operações, incluindo subscrições e resgates de unidades de participação, este campo deve ser preenchido com “NA”.

Código LEI da entidade que executou a transação (Campo 9): Campo que identifica o código LEI da entidade que executou a operação ou efetuou a subscrição ou resgate sobre o instrumento financeiro identificado no campo 4.

Este campo apenas deve ser preenchido se o campo 2 foi preenchido com o código “C” ou “V”. Para outros ativos/ operações, este campo deve ser preenchido com “NA”.

Quantidade (Campo 10): Campo que identifica a quantidade do ativo transacionado na operação, se aplicável. Este campo deve ser preenchido com “NA” se o campo 2 tiver sido preenchido com os códigos “L” e “D”.

Não havendo ativos envolvidos na operação, este campo deve ser preenchido com “NA”.

Preço unitário médio (Campo 11): Campo que é preenchido com o preço unitário médio do ativo objeto da operação, sendo preenchido em valor, na moeda da operação, ou em percentagem, Este campo deve ser preenchido com “NA” se o campo 2 tiver sido preenchido com os códigos “L” e “D”.

Indicação de preço unitário médio (Campo 12): Campo preenchido com “V”, caso o campo anterior tenha sido preenchido com valor, “P”, caso tenha sido preenchido em percentagem. Este campo deve ser preenchido com “NA” se o campo 2 tiver sido preenchido com os códigos “L” e “D”.

Moeda (Campo 13): Campo que identifica a moeda da operação.

Montante (Campo 14): Campo que identifica o montante de cada operação, incluindo juros corridos se aplicável, expresso na moeda da operação.

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Data de transação	Tipo de operação	Código de origem de operação	Código do instrumento financeiro	Tipo de código do instrumento financeiro	Tipo de ativo
Domínio e Dimensão	ISO 8601	C, V, L, D	GC, OV	ISIN, CFI, NA	I, C, NA	AC, DU, PC, DI, UP, EF, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, WR, OD, UL, DO, DP, OT

Campo	7	8	9	10	11	12	13	14
Identificação	Mercado de admissão	Local de Execução	Código LEI da entidade que executou a transação	Quantidade	Preço unitário médio	Indicação do preço unitário	Moeda	Montante
Domínio e Dimensão	MIC Code, XXXX, NA	MIC Code, OECP, OEFM, NA	Código LEI, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	V, P, NA	ISO 4217	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

ANEXO 26

INFORMAÇÃO RELATIVA AO REGISTO E DEPÓSITO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO POR CONTA DE OUTREM

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de Informação relativa ao registo e depósito de UPs por conta de outrem	Ficheiro de dados	RUPNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	RUP identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "RUP" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_RUP_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação ("reporte nulo")

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de "NULO" nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve

ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Código do instrumento financeiro (Campo 1): Campo que identifica o código da unidade de participação, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number (ISIN)*, nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável
- Não existindo ISIN, o código LEI do organismo de investimento coletivo, nos termos definidos na Norma ISO 17442.

Tipo de código do instrumento financeiro (Campo 2): Campo que identifica o tipo de código da unidade de participação, sendo preenchido com:

- “I”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código ISIN;
- “L”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código LEI.

Designação do instrumento financeiro (Campo 3): Campo que identifica a designação da unidade de participação.

Mercado de admissão (Campo 4): Campo que identifica o mercado onde a unidade de participação está admitida à negociação, sendo preenchido com:

- O *Market Identifier Code (MIC)*, nos termos definidos na Norma ISO 10383, para instrumentos financeiros admitidos em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada. Deve ser preenchido com o MIC Code do primeiro mercado onde o instrumento financeiro foi admitido à negociação. Caso exista mais do que um mercado nestas circunstâncias, deve ser considerado o mercado mais líquido.
- “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos à negociação em plataformas de negociação.

Central de valores mobiliários (Campo 5): Campo que identifica o código LEI da central de valores mobiliários onde estão integradas as unidades de participação, sendo preenchido apenas quando aplicável. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Código do emitente (Campo 6): Campo que identifica o código LEI do emitente, sendo preenchido apenas quando aplicável. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Descrição do emitente (Campo 7): Campo que identifica a denominação do emitente. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

País do emitente (Campo 8): Campo que identifica o país do emitente. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Residência do titular (Campo 9): Campo que identifica a residência do primeiro titular da conta da unidade de participação e deve ser preenchido com um dos seguintes códigos:

- “R”, para titulares residentes;
- “N”, para titulares não residentes.

Tipo de titular (Campo 10): Campo que identifica o tipo do primeiro titular da conta da unidade de participação, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NP”, se for investidor não profissional;
- “PR”, se for investidor profissional;
- “CE”, se for contraparte elegível.

Quantidade (Campo 11): Campo que identifica a quantidade de instrumentos financeiros, sendo preenchido com o número de unidades de participação.

Montante (Campo 12): Campo que identifica o montante das unidades participação, em euros.

Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Código	Tipo código	Designação	Mercado admissão	Central VM
Domínio e Dimensão	ISO 6166, ISO 17442	I, L	Dimensão máxima de 200 caracteres*	ISO 10383, XXXX	ISO 17442, NA

6	7	8
Código emitente	Descrição emitente	País emitente
ISO 17442, NA	Dimensão máxima de 200 caracteres*, NA	ISO 3166, NA

9	10	11	12
Residência titular	Tipo Titular	Quantidade	Montante
R, N	NP, PR, CE	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

ANEXO 27

MODELO DE DIVULGAÇÃO DA CARTEIRA DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO EM VALORES MOBILIÁRIOS DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO EM VALORES MOBILIÁRIOS E DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO EM ATIVOS NÃO FINANCEIROS

1. Instrumentos financeiros admitidos, em processo de admissão ou não admitidos à negociação em plataformas de negociação

1.1. Instrumentos Financeiros admitidos à negociação em Plataformas

Negociação (PN)

- 1.1.1. Títulos de dívida pública
- 1.1.2. Outros fundos públicos e equiparados
- 1.1.3. Obrigações diversas
- 1.1.4. Ações
- 1.1.5. Unidades de participação/ações de OIC que não OII (ETFs)
- 1.1.6. Direitos
- 1.1.7. Warrants autónomos
- 1.1.8. Opções
- 1.1.9. Unidades de participação/ações de OII (ETFs)
- 1.1.10. Ações emitidas por sociedades imobiliárias
- 1.1.11. Papel comercial
- 1.1.12. Outros instrumentos de dívida de curto prazo
- 1.1.13. Outros instrumentos financeiros

1.2. Instrumentos Financeiros em processo de admissão à negociação em PN

- 1.2.1. Títulos de dívida pública
- 1.2.2. Outros fundos públicos e equiparados
- 1.2.3. Obrigações diversas
- 1.2.4. Ações
- 1.2.5. Unidades de participação/ações de OIC que não OII (ETFs)
- 1.2.6. Direitos
- 1.2.7. Warrants autónomos
- 1.2.8. Opções
- 1.2.9. Unidades de participação/ações de OII (ETFs)
- 1.2.10. Ações emitidas por sociedades imobiliárias
- 1.2.11. Papel comercial
- 1.2.12. Outros instrumentos de dívida de curto prazo
- 1.2.13. Outros instrumentos financeiros

1.3. Instrumentos Financeiros não admitidos à negociação em PN

- 1.3.1. Títulos de dívida pública
- 1.3.2. Outros fundos públicos e equiparados
- 1.3.3. Obrigações diversas
- 1.3.4. Ações
- 1.3.5. Unidades de participação/ações de OIC que não OII
- 1.3.6. Direitos
- 1.3.7. Warrants autónomos
- 1.3.8. Opções

- 1.3.9. Unidades de participação/ações de OII
- 1.3.10. Ações emitidas por sociedades imobiliárias
- 1.3.11. Papel comercial
- 1.3.12. Outros instrumentos de dívida de curto prazo
- 1.3.13. Outros instrumentos financeiros
- 2. Ativos não financeiros da carteira**
 - 2.1. Outros Ativos da Carteira**
 - 2.1.1. Ativos Não Financeiros
 - 2.1.2. Imóveis
 - 2.1.3. Outros Ativos
- 3. Outros ativos e passivos da carteira**
 - 3.1. Liquidez**
 - 3.1.1. Numerário
 - 3.1.2. Depósitos à Ordem
 - 3.1.3. Aplicações nos mercados monetários
 - 3.1.4. Depósitos a prazo
 - 3.2. Empréstimos**
 - 3.2.1. Empréstimos obtidos
 - 3.2.2. Descobertos
 - 3.3. Outros Valores a Regularizar**
 - 3.3.1. Valores ativos
 - 3.3.2. Valores passivos
- 4. Valor líquido global (VLGF)**
- 5. N.º Unidades de participação total**
 - 5.1. Categoria C1**
 - 5.2. Categoria C2**
 - (...)
 - 5.3. Categoria C3**
- 6. Ativo sob gestão**
- 7. Ativos líquidos**
- 8. Valor de posições equivalentes nos ativos subjacentes relativamente a instrumentos financeiros derivados**
- 9. Valor do investimento noutros OIC geridos pela entidade responsável pela gestão**
- 10. Responsabilidades extrapatrimoniais**
 - 10.1. Contratos Cambiais admitidos à negociação em PN**
 - 10.1.1. Futuros
 - 10.1.2. Opções
 - 10.1.3. Outros
 - 10.2. Contratos Cambiais não admitidos à negociação em PN**
 - 10.2.1. Forwards
 - 10.2.2. Opções
 - 10.2.3. Swaps
 - 10.2.4. Outros
 - 10.3. Contratos sobre taxas de juro admitidos à negociação em PN**
 - 10.3.1. Futuros
 - 10.3.2. Opções
 - 10.3.3. Outros
 - 10.4. Contratos sobre taxa de juro não admitidos à negociação em PN**
 - 10.4.1. FRA
 - 10.4.2. Opções
 - 10.4.3. Swaps

10.4.4. Outros

10.5. Contratos sobre cotações admitidos à negociação em PN

10.5.1. Futuros

10.5.2. Opções

10.5.3. Outros

10.6. Contratos sobre cotações não admitidos à negociação em PN

10.6.1. Opções

10.6.2. Swaps

10.6.3. Outros

ANEXO 28

**MODELO DE DIVULGAÇÃO DA CARTEIRA DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO
IMOBILIÁRIO**

1. Imóveis

1.1. Imóveis situados em Estados da União Europeia

1.1.1. Terrenos Urbanizados

1.1.2. Terrenos Não Urbanizados

1.1.3. Projetos de Construção de Reabilitação

1.1.4. Outros Projetos de Construção

1.1.5. Construções Acabadas Arrendadas

1.1.6. Construções Acabadas Não arrendadas

1.1.7. Direitos

1.2. Imóveis situados fora da União Europeia

1.2.1. Terrenos Urbanizados

1.2.2. Terrenos Não urbanizados

1.2.3. Projetos de Construção de Reabilitação

1.2.4. Outros Projetos de Construção

1.2.5. Construções Acabadas Arrendadas

1.2.6. Construções Acabadas Não arrendadas

1.2.7. Direitos

2. Participações

2.1. UP's Domiciliados em Estados da União Europeia

2.1.1. Organismos de investimento imobiliário

2.1.2. Outros

2.2. UP's Domiciliados fora da União Europeia

2.2.1. Organismos de investimento imobiliário

2.2.2. Outros

2.3. Participações em Sociedades Imobiliárias na UE

2.3.1. Ações

2.3.2. Quotas

2.3.3. Direitos de subscrição

2.3.4. Outras participações

2.4. Participações em Sociedades Imobiliárias fora da UE

2.4.1. Ações

2.4.2. Quotas

2.4.3. Direitos de subscrição

2.4.4. Outras participações

3. Outros ativos e passivosLiquidez

- 3.1.1. Numerário
- 3.1.2. Depósitos à Ordem
- 3.1.3. Organismos do mercado monetário
- 3.1.4. Depósitos com pré-aviso e a prazo
- 3.1.5. Certificados de depósito
- 3.1.6. Valores mobiliários com prazo de vencimento residual inferior a 12 meses
- 3.2. Empréstimos**
 - 3.2.1. Empréstimos obtidos
 - 3.2.2. Descobertos
- 3.3. Valores ativos a regularizar**
 - 3.3.1. Adiantamentos por conta de imóveis
 - 3.3.2. Adiantamentos por conta de sociedades imobiliárias
 - 3.3.3. Valores a receber por conta de transações de imóveis
 - 3.3.4. Rendas em dívida
 - 3.3.5. Outros
- 3.4. Valores passivos a regularizar**
 - 3.4.1. Recebimentos por conta de imóveis
 - 3.4.2. Recebimentos por conta de sociedades imobiliárias
 - 3.4.3. Valores a pagar por conta de transações de imóveis
 - 3.4.4. Cauções
 - 3.4.5. Rendas adiantadas
 - 3.4.6. Outros
- 4. Valor líquido global (VLGF)**
- 5. N.º Unidades de participação total**
 - 5.1. Categoria C1**
 - 5.2. Categoria C2**
 - (...)
 - 5.3. Categoria C3**
- 6. Ativo sob gestão**
- 7. Ativos líquidos**
- 8. Valor de posições equivalentes nos ativos subjacentes relativamente a instrumentos financeiros derivados**
- 9. Valor do investimento noutros OIC geridos pela entidade responsável pela gestão**
- 10. Responsabilidades extrapatrimoniais**
 - 10.1. Compromissos com e de terceiros**
 - 10.1.1. Direitos de arrendamento
 - 10.1.2. Direitos de concessão
 - 10.1.3. Direitos de exploração
 - 10.1.4. Direitos de superfície
 - 10.1.5. Outros direitos

ANEXO B

(A que se refere o artigo 5.º)

ANEXO II

INFORMAÇÃO RELATIVA À COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA E AQUISIÇÃO E ALIENAÇÃO DE ELEMENTOS PATRIMONIAIS DOS ORGANISMOS DE INVESTIMENTO EM CAPITAL DE RISCO (OICR) [FUNDOS DE

**CAPITAL DE RISCO (FCR) E SOCIEDADES DE INVESTIMENTO EM CAPITAL DE RISCO (SICR)],
SOCIEDADES GESTORAS DE FUNDOS DE CAPITAL DE RISCO (SGFCR), SOCIEDADES DE CAPITAL DE
RISCO (SCR), SOCIEDADES DE EMPREENDEDORISMO SOCIAL (SES) E FUNDOS DE
EMPREENDEDORISMO SOCIAL (FES)**

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informação relativa à composição da Carteira, Aquisição e Alienação de elementos patrimoniais	Ficheiro de dados	CRTNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMMDD.XML
	CRT identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "CRT" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_CRT_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre a carteira dos organismos de investimento em capital de risco (OICR), das sociedades de capital de risco (SCR), das sociedades gestoras de fundos de capital de risco (SGFCR), sociedades de empreendedorismo social (SES) e fundos de empreendedorismo social (FES), com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de categoria do elemento patrimonial, sendo preenchido com o código de categoria da tabela 1.

Código do elemento (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código do elemento patrimonial, sendo preenchido com:

- Para instrumentos financeiros:
 - O *International Standard Identification Number* (ISIN), sempre que aplicável;
 - O *Classification of Financial Instruments* (CFI), não existindo ISIN;

- “NA”, para outros elementos patrimoniais que não sejam instrumentos financeiros.

Descrição (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a designação do elemento patrimonial.

Mercado de admissão (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o mercado onde o elemento patrimonial está admitido à negociação, sendo preenchido com:

- Para instrumentos financeiros:
 - O *Market Identifier Code* (MIC), para instrumentos financeiros admitidos à negociação em plataformas de negociação (PN);
 - “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos em PN.
- “NA”, para outros elementos patrimoniais que não sejam instrumentos financeiros.

Código do emitente (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código da entidade visada pelo investimento em capital de risco, sendo preenchido com:

- O *Legal Entity Identifier* (LEI), sempre que aplicável;
- O número de identificação fiscal, não existindo LEI.

Grupo (Campo 6): Campo de preenchimento obrigatório que identifica se o elemento patrimonial é referente à mesma sociedade ou grupo de sociedades, para efeitos de consolidação de contas, de outros elementos patrimoniais da carteira, sendo preenchido com “G” seguido de um número sequencial, com início em “0001” para a primeira sociedade ou grupo de sociedades até “nnnnn” para a n-ésima sociedade ou grupo de sociedades a que o elemento patrimonial é referente.

Data de aquisição (Campo 7): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a primeira data de aquisição do elemento patrimonial.

Valor de aquisição (Campo 8): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor de aquisição à data a que respeita a informação, sendo preenchido com o valor a que o elemento patrimonial foi adquirido e refletindo as posteriores aquisições e alienações.

Fase de investimento (Campo 9): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a fase de investimento à primeira entrada no capital da sociedade, sendo preenchido com:

- “SSE”, para *seed capital, start-up ou early stage*;
- “EXP”, para expansão;
- “TUR”, para *turnaround*;
- “MBO”, para *management buy-out*;
- “MBI”, para *management buy-in*;
- “OUT”, para outra fase de investimento.

Porcentagem (Campo 10): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a percentagem detida no capital da sociedade a que o elemento patrimonial é referente, sendo preenchido com:

- Percentagem detida do capital social da participada, quando o código de categoria do campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com CC01 a CC05 ou

CC13;

- Percentagem detida do ativo líquido da participada, para os elementos patrimoniais de CC01, CC06 a CC10 ou CC13.

Critério Valorimétrico (Campo 11): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o critério valorimétrico utilizado na valorização do elemento patrimonial, sendo preenchido com:

- “MER”, para instrumentos financeiros admitidos em PN;
- “AQU”, para valor de aquisição;
- “TMR”, para transações materialmente relevantes efetuadas nos últimos doze meses face ao momento da avaliação;
- “MUL”, para múltiplos de sociedades comparáveis;
- “DCF”, para fluxos de caixa descontados;
- “NAV”, para *net asset value*, quando respeite a participações em organismos de investimento coletivo;
- “OUT”, para outros critérios internacionalmente reconhecidos.

Quantidade (Campo 12): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a quantidade do elemento patrimonial, sendo preenchido com:

- Número de unidades, quando o código de categoria do campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com CC01 a CC05 ou CC13;
- Valor nominal, quando o código de categoria do campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com CC06 a CC10 ou CC13;
- Número de contratos, quando o código de categoria do campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com CC11 a CC13.

Código da moeda (Campo 13): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código da moeda em que o elemento patrimonial se encontra denominado.

Valor (Campo 14): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor em carteira do elemento patrimonial em euros, sendo preenchido com um valor positivo ou negativo, consoante o valor contribua de modo positivo ou negativo para o valor líquido global do OICR ou FES ou para o capital próprio da SCR, SGFCR ou SES.

Campo	1	2	3	4
Identificação	Código categoria	Código elemento	Descrição	Mercado admissão
Domínio e Dimensão	Código da tabela 1	ISO 6166, ISO 10962, NA	Dimensão máxima de 200 caracteres*	ISO 10383, XXXX, NA

5	6	7	8	9
Código emitente	Grupo	Data aquisição	Valor aquisição	Fase investimento

ISO 17442, NIPC	Gnnnnn	ISO 8601	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	SSE, EXP, TUR, MBO, MBI, OUT
-----------------	--------	----------	--	------------------------------

10	11	12	13	14
Percentagem	Critério valorimétrico	Quantidade	Código moeda	Valor
Dimensão máxima de 8 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	MER, AQU, TMR, MUL, DCF, NAV, OUT	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	ISO 4217	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Tabela 5 - Códigos de categoria dos elementos patrimoniais

Código de categoria	Designação do elemento patrimonial
CC01	Instrumentos financeiros admitidos em plataformas de negociação
CC02	Ações
CC03	Quotas
CC04	Unidades de participação em fundos de capital de risco
CC05	Outras unidades de participação
CC06	Prestações suplementares
CC07	Prestações acessórias
CC08	Suprimentos
CC09	Obrigações e outros títulos de dívida
CC10	Empréstimos
CC11	Opções de compra
CC12	Opções de venda
CC13	Outros elementos patrimoniais

Bloco de informação número 2: Informação sobre outros ativos e passivos na carteira dos OICR, SCR, SGFCR, SES e FES, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código da categoria do ativo ou passivo, sendo preenchido com o código de categoria da tabela 2.

Descrição (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a designação do ativo ou passivo.

Código de moeda (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de moeda em que o ativo ou passivo se encontra denominado.

Valor (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor do ativo ou passivo em euros, sendo preenchido com um valor positivo ou negativo, consoante o valor contribua de modo positivo ou negativo para o valor líquido global do OICR ou FES ou para o capital próprio

da SCR, SGFCR ou SES.

Campo	1	2	3	4
Identificação	Código categoria	Descrição	Código moeda	Valor
Domínio e Dimensão	Código da tabela 2	Dimensão máxima de 200 caracteres*	ISO 4217	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!” e “?”.

Tabela 6 - Códigos de categoria de outros ativos e passivos

Código de categoria	Designação de outros ativos e passivos
CC14	Caixa e depósitos à ordem
CC15	Depósitos a prazo
CC16	Empréstimos obtidos
CC17	Outros ativos
CC18	Outros passivos

Bloco de informação número 3: Informação sobre os elementos extrapatrimoniais da carteira dos OICR, SCR, SGFCR, SES e FES, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de categoria do elemento extrapatrimonial, sendo preenchido com o código de categoria da tabela 3.

Código do elemento (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código do elemento extrapatrimonial, sendo preenchido com:

- O ISIN, sempre que aplicável;
- O CFI, não existindo ISIN.

Descrição (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a designação do elemento extrapatrimonial.

Objetivo (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a finalidade subjacente à transação do elemento extrapatrimonial, sendo preenchido com:

- “E”, para beneficiar de diferenças entre o preço de compra e venda;
- “H”, para cobertura de risco.

Posição (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a posição aberta do contrato, sendo preenchido com:

- “C”, para posições compradoras;
- “V”, para posições vendedoras.

Quantidade (Campo 6): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a quantidade do

elemento extrapatrimonial, sendo preenchido com o número de contratos.

Exposição (Campo 7): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a exposição inerente ao elemento extrapatrimonial, sendo preenchido com o valor correspondente ao produto entre o número de contratos negociados, a unidade de negociação e o valor de mercado do ativo subjacente.

Campo	1	2	3	4	5	6	7
Identificação	Código categoria	Código elemento	Descrição	Objetivo	Posição	Quantidade	Exposição
Domínio e Dimensão	Código da tabela 3	ISO 6166, ISO 10962	Dimensão máxima de 200 caracteres*	E, H	C, V	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!” e “?”.

Tabela 7 - Códigos de categoria de elementos extrapatrimoniais

Código de categoria	Designação do elemento extrapatrimonial
CC19	Opções de compra
CC20	Opções de venda
CC21	Futuros
CC22	<i>Fowards</i>
CC23	<i>Swaps</i>
CC24	Outros elementos extrapatrimoniais

Bloco de informação número 4: Informação adicional sobre a carteira, com os seguintes campos:

Valor líquido global do OICR ou capital próprio da entidade gestora (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor líquido global dos OICR ou FES ou o valor do capital próprio da SCR, SGFCR ou SES, em euros.

Ativo sob gestão (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o ativo sob gestão (AUM) do respetivo OICR ou FES ou o total do ativo sob gestão da SCR, SGFCR ou SES e dos OICR ou FES por si geridos, em euros, sendo calculado nos termos definidos no Regulamento Delegado (UE) n.º 231/2013 da Comissão de 19 de dezembro de 2012.

Ativos líquidos (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor total de ativos líquidos, em euros; por ativos líquidos entendem-se os previstos no n.º 1 do artigo 416.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, excluindo a condição prevista na alínea d) do n.º 3 do referido artigo, e as disponibilidades e aplicações em outras instituições de crédito com prazo

residual inferior a 30 dias ou mobilizáveis sem penalização num prazo máximo de 30 dias

Campo	1	2	3
Identificação	VLGF ou CP	AUM	Ativos Líquidos
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 5: Informação sobre a aquisição e alienação de elementos patrimoniais da carteira, com os seguintes campos:

Tipo de operação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o tipo de operação, sendo preenchido com:

- “AQ”, para aquisição de elementos patrimoniais;
- “AL”, para alienação de elementos patrimoniais.

Código de categoria (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código da categoria do elemento patrimonial adquirido ou alienado, sendo preenchido com o código de categoria da tabela 1.

Descrição (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a designação do elemento patrimonial adquirido ou alienado.

Data da operação (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a data de aquisição ou da alienação do elemento patrimonial.

Código do emitente (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código da entidade visada pelo elemento patrimonial, sendo preenchido com:

- O LEI, sempre que aplicável;
- O número de identificação fiscal, não existindo LEI.

Código da contraparte (Campo 6): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código da contraparte que alienou ou adquiriu o elemento patrimonial, sendo preenchido com:

- Para operações executadas em plataformas de negociação, o respetivo MIC;
- Para operações executadas fora de PN:
 - O LEI, sempre que aplicável;
 - O número de identificação fiscal, não existindo LEI.

Designação da contraparte (Campo 7): Campo que identifica a descrição da contraparte que alienou ou adquiriu o elemento patrimonial, sendo de preenchimento obrigatório quando a operação é executada fora de PN.

Jurisdição da contraparte (Campo 8): Campo que identifica o país de residência da contraparte que alienou ou adquiriu o elemento patrimonial, sendo de preenchido obrigatório quando a operação é executada fora de PN.

Valor de aquisição (Campo 9): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor de

aquisição do elemento patrimonial no caso do tipo de operação do campo 1 do bloco de informação número 5 ser “AL”, sendo preenchido com o valor de aquisição do elemento patrimonial registado na carteira à data de alienação, em euros.

Valor em carteira (Campo 10): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor do elemento patrimonial no caso do tipo de operação do campo 1 do bloco de informação número 5 ser “AL”, sendo preenchido com o valor do elemento patrimonial registado na carteira à data de alienação, em euros.

Valor da operação (Campo 11): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor de aquisição ou alienação do elemento patrimonial, em euros.

Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Tipo operação	Código categoria	Descrição	Data operação	Código emitente
Domínio e Dimensão	AQ, AL	Código da tabela 1	Dimensão máxima de 200 caracteres*	ISO 8601	ISO 17442, NIPC

6	7	8	9	10	11
Código contraparte	Designação contraparte	Jurisdição contraparte	Valor aquisição	Valor carteira	Valor operação
ISO 10383, ISO 17442, NIPC, NIF	Dimensão máxima de 200 caracteres*	ISO 3166 (Alpha-2 code)	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 6: Informação sobre o desreconhecimento de elementos patrimoniais da carteira, com os seguintes campos:

Código de categoria (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código do elemento patrimonial desreconhecido, sendo preenchido com o código de categoria da tabela 1.

Descrição (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a designação do elemento patrimonial desreconhecido.

Data da operação (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a data do desreconhecimento do elemento patrimonial.

Código do emitente (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código da entidade visada pelo elemento patrimonial, sendo preenchido com:

- LEI, sempre que aplicável;
- O número de identificação fiscal, não existindo LEI.

Valor de aquisição (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor de aquisição do elemento patrimonial desreconhecido, sendo preenchido com o valor de aquisição à data do desreconhecimento, em euros.

Valor em carteira (Campo 6): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor em carteira do elemento patrimonial desreconhecido, sendo preenchido com o valor em carteira à data do desreconhecimento, em euros.

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Código conta	Descrição	Data operação	Código emitente	Valor aquisição	Valor carteira
Domínio e Dimensão	Código da tabela 1	Dimensão máxima de 200 caracteres*	ISO 8601	ISO 17442, NIPC	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres " ", "*", "!" e "?".

ANEXO III

INFORMAÇÃO RELATIVA AO CAPITAL E PARTICIPANTES DOS ORGANISMOS DE INVESTIMENTO EM CAPITAL DE RISCO (OICR) [FUNDOS DE CAPITAL DE RISCO (FCR) E SOCIEDADES DE INVESTIMENTO EM CAPITAL DE RISCO (SICR)], FUNDOS DE EMPREENDEDORISMO SOCIAL (FES) E ORGANISMOS DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (OIAE), INCLUINDO OS OIAE DE CRÉDITOS

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informação relativa ao Capital e Participantes	Ficheiro de dados	CEPNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMDD.XML
	CEP identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "CEP" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_CEP_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteúdoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o capital dos fundos de capital de risco (FCR), sociedades de investimento em capital de risco (SICR), fundos de empreendedorismo social (FES) e organismos de investimento alternativo especializado (OIAE), incluindo os OIAE de créditos, com os seguintes campos:

Categoria de unidades de participação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- “C”, seguido de 1 ou 2 caracteres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- “NA”, sempre que não existam categorias de unidades de participação.

Capital subscrito (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor do capital subscrito, imputado à respetiva categoria de unidades de participação, à data do reporte, em euros.

Capital realizado (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor do capital realizado, imputado à respetiva categoria de unidades de participação, à data do reporte, em euros.

Valor líquido global (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o VLG do FCR, SICR, FES e OIAE, incluindo OIAE de créditos, imputado à respetiva categoria de unidades de participação, em euros.

Devolução de capital realizado (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor acumulado das devoluções de capital realizado efetuadas ao longo da vida do FCR, SICR, FES e OIAE, incluindo OIAE de créditos, imputado à respetiva categoria de unidades de participação, em euros.

Distribuição de rendimentos (Campo 6): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor acumulado das distribuições de rendimentos efetuados ao longo da vida do FCR, SICR, FES e OIAE, incluindo OIAE de créditos, imputado à respetiva categoria de unidades de participação, em euros.

Quantidade (Campo 7): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o número de unidades de participação em circulação de cada categoria de unidades de participação.

Campo	1	2	3
Identificação	Categoria	Capital subscrito	Capital realizado

Domínio e Dimensão	Dimensão mínima de 2 e máxima de 3 caracteres	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
---------------------------	---	--	--

4	5	6	7
VLGF	Devolução capital realizado	Distribuição rendimentos	Quantidade
Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 2: Informação sobre os participantes dos FCR, SICR, FES e OIAE, incluindo OIAE de créditos, com os seguintes campos:

Categoria de unidades de participação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as diferentes categorias de unidades de participação, sendo preenchido com:

- “C”, seguido de 1 ou 2 caracteres, que correspondem à identificação da categoria nos documentos constitutivos;
- “NA”, sempre que não existam categorias de unidades de participação.

Tipo (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o tipo de participante, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NP”, para participantes não profissionais;
- “PR”, para participantes profissionais;
- “CE”, para contrapartes elegíveis.

Residência (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a residência do participante, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “R”, para participantes residentes em Portugal;
- “N”, para outros participantes.

Número (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o número de participantes, sendo preenchido com o número de cada combinação de tipo e residência do participante.

Quantidade (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o número de unidades de participação, sendo preenchido com o número de cada combinação de tipo e residência do participante.

Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Categoria	Tipo	Residência	Número	Quantidade
Domínio e Dimensão	Dimensão mínima de 2 e	NP, PR, CE	R, N	Dimensão máxima de 20	Dimensão máxima de 20 caracteres

	máxima de 3 carateres		carateres numéricos	numéricos, com 2 casas decimais
--	--------------------------	--	------------------------	------------------------------------

ANEXO IV

INFORMAÇÃO FINANCEIRA RELATIVA AO BALANÇO E DEMONSTRAÇÃO DOS RESULTADOS DOS FUNDOS DE CAPITAL DE RISCO (FCR), SOCIEDADES DE INVESTIMENTO EM CAPITAL DE RISCO (SICR) HETEROGERIDAS, FUNDOS DE EMPREENDEDORISMO SOCIAL (FES), FUNDOS DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (FIAE), SOCIEDADES DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (SIAE) HETEROGERIDAS E ORGANISMOS DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (OIAE), INCLUINDO OS OIAE DE CRÉDITOS

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de Rubricas do Balanço, Demonstração dos Resultados	Ficheiro de dados	DFINNNNNFFFFSSSS0AAAAMDD.XML
	DFI identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "DFI" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_DFI_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre as rubricas de balanço dos fundos de capital de risco (FCR), sociedades de investimento em capital de risco (SICR) heterogeridas, fundos de empreendedorismo social (FES), fundos de investimento alternativo especializado (FIAE), sociedades de investimento alternativo especializado (SIAE) heterogeridas e organismos de investimento alternativo especializado (OIAE), incluindo os OIAE de créditos, com os seguintes campos:

Código de conta (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de conta, sendo preenchido de acordo com o código de conta da tabela 1.

Valor de conta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o saldo da conta no final de cada período de reporte, sendo preenchido com um valor positivo para as rubricas de ativo e passivo, e com um valor positivo ou negativo para as rubricas de capital próprio.

Campo	1	2
Identificação	Código de conta	Valor de conta
Domínio e Dimensão	Código da tabela 1	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Tabela 8 - Códigos de conta das rubricas de balanço

Código de Conta	Designação
BL01	Ativo Total
BL02	Caixa e disponibilidades bancárias
BL03	Aplicações em instituições de crédito
BL04	Despesas com encargo diferido
BL05	Acréscimos de rendimentos
BL06	Ativos por impostos correntes
BL07	Investimentos financeiros ao justo valor
BL08	Outros investimentos financeiros
BL09	Outras contas a receber
BL10	Participantes
BL11	Outros ativos
BL12	Capital próprio total
BL13	Capital subscrito realizado
BL14	Capital subscrito não realizado
BL15	Prémios de emissão
BL16	Reservas legais
BL17	Outras reservas
BL18	Resultados transitados
BL19	Resultado líquido do exercício
BL20	Outras variações no capital próprio
BL21	Passivo total
BL22	Credores e outros recursos
BL23	Receitas com rendimento diferido
BL24	Acréscimos de gastos
BL25	Passivos por impostos correntes
BL26	Financiamentos obtidos
BL27	Provisões
BL28	Outros passivos

Bloco de informação número 2: Informação sobre as rubricas da demonstração dos resultados dos FCR, SICR heterogeridas, FES, FIAE, SIAE heterogeridas e OIAE, incluindo OIAE de créditos, com os seguintes campos:

Código de conta (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de conta, sendo preenchido de acordo com o código de conta da tabela 2.

Valor de conta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o saldo da conta no final de cada período de reporte, sendo preenchido com um valor positivo ou negativo, consoante a rubrica contribua de modo positivo ou negativo para o resultado líquido do exercício.

Campo	1	2
Identificação	Código de conta	Valor de conta
Domínio e Dimensão	Código da tabela 2	Dimensão máxima de 20 caracteres, com 2 casas decimais

Tabela 9 - Código de conta das rubricas da demonstração dos resultados

Código de Conta	Designação
DR01	Juros e rendimentos similares
DR02	Encargos com comissões
DR03	Outros fornecimentos e serviços externos
DR04	Ganhos/perdas de investimentos financeiros ao justo valor
DR05	Ganhos/perdas de investimentos em subsidiárias, empreendimentos conjuntos e associadas
DR06	Perdas/reversões de imparidade de dívidas a receber
DR07	Perdas/reversões de imparidade de investimentos não depreciáveis
DR08	Aumentos/reversões de provisões
DR09	Juros e encargos similares
DR10	Outros rendimentos
DR11	Outros gastos
DR12	Resultado antes de impostos
DR13	Imposto sobre o rendimento do exercício
DR14	Resultado líquido do exercício

ANEXO V

INFORMAÇÃO RELATIVA AOS DOCUMENTOS DE PRESTAÇÃO DE CONTAS ANUAIS DOS FUNDOS DE CAPITAL DE RISCO (FCR), SOCIEDADES DE INVESTIMENTO EM CAPITAL DE RISCO (SICR) HETEROGERIDAS, FUNDOS DE EMPREENDEDORISMO SOCIAL (FES), SOCIEDADES DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (SIAE) HETEROGERIDAS, FUNDOS DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (FIAE) E ORGANISMOS DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (OIAE), INCLUINDO OS OIAE DE CRÉDITOS

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro
	Ficheiro de texto FRCNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF

Reporte do Relatório e Contas Anual	FRC identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.
--	--

ANEXO VI

INFORMAÇÃO RELATIVA AO RELATÓRIO DE AUDITORIA (RDA) DOS FUNDOS DE CAPITAL DE RISCO (FCR), SOCIEDADES DE INVESTIMENTO EM CAPITAL DE RISCO (SICR) HETEROGERIDAS, FUNDOS DE EMPREENDEDORISMO SOCIAL (FES), SOCIEDADES DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (SIAE) HETEROGERIDAS, FUNDOS DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (FIAE) E ORGANISMOS DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (OIAE), INCLUINDO OS OIAE DE CRÉDITOS.

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informação do relatório de auditoria	Ficheiro de dados	RDANNNNNNFFFSSSS0AAAAMDD.XML
	RDA identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "RDA" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_RDA_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o conteúdo do relatório de auditoria (RDA) dos fundos de capital de risco (FCR), sociedades de investimento em capital de risco (SICR)

heterogeridas, fundos de empreendedorismo social (FES), sociedades de investimento alternativo especializado (SIAE) heterogeridas, fundos de investimento alternativo especializado (FIAE) e organismos de investimento alternativo especializado (OIAE), incluindo os OIAE de créditos, com os seguintes campos:

Tipo de opinião (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as características do RDA, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “SRE”, para RDA sem reservas e ênfases;
- “CRE”, para RDA com reservas e ênfases;
- “OCR”, para RDA com reservas e sem ênfases;
- “OCE”, para RDA com ênfases e sem reservas;
- “EDO”, para uma escusa de opinião;
- “ADV”, para uma opinião adversa.

Campo	1
Identificação	Tipo de opinião
Domínio e Dimensão	SRE, CRE, OCR, OCE, EDO, ADV

Bloco de informação número 2: Informação sobre as reservas no RDA, com os seguintes campos:

Identificação de reservas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCR”, e que identifica um número sequencial de 1 a n, sendo n o número total de reservas.

Descrição da reserva (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCR”, e que identifica o texto da reserva que consta do RDA.

Campo	1	2
Identificação	Identificação de reservas	Descrição da reserva
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 3 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos *

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 3: Informação sobre as ênfases no RDA, com os seguintes campos:

Identificação de ênfases (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCE”, e que identifica um número sequencial de 1 a n, sendo n o número total de ênfases.

Descrição da ênfase (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCE”, e que identifica o texto da ênfase que consta do RDA.

Campo	1	2
Identificação	Identificação de ênfases	Descrição da ênfase
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 3 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos *

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!” e “?”.

Bloco de informação número 4: Informação sobre o auditor que assina o RDA, com os seguintes campos:

Número de registo do revisor oficial de contas (ROC) (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o número de registo na CMVM do ROC que assina o RDA.

Número de registo da SROC (Campo 2): Campo que identifica o número de registo na CMVM da SROC a qual pertence o revisor oficial de contas (ROC) que assina o RDA.

Campo	1	2
Identificação	Número de registo do ROC	Número de registo da SROC
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 8 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 8 caracteres numéricos

ANEXO VII

INFORMAÇÃO RELATIVA AO REGULAMENTO DE GESTÃO DOS ORGANISMOS DE INVESTIMENTO EM CAPITAL DE RISCO (OICR) [FUNDOS DE CAPITAL DE RISCO (FCR) E SOCIEDADES DE INVESTIMENTO EM CAPITAL DE RISCO (SICR)], FUNDOS DE EMPREENDEDORISMO SOCIAL (FES) E ORGANISMOS DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (OIAE), INCLUINDO OIAE DE CRÉDITOS

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do Regulamento de Gestão	Ficheiro de texto	FRGNNNNNNFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	FRG identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'.	

	Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.
--	--

ANEXO C

(A que se refere o artigo 7.º)

ANEXO I

CARTEIRA DE FUNDOS DE TITULARIZAÇÃO DE CRÉDITOS (FTC)

Especificidades relativas à composição da carteira de fundos de titularização de créditos

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informação sobre as carteiras de fundos de titularização de créditos	Ficheiro de dados	CFTNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMDD.XML
	CFT identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "CFT" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_CFT_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre carteira de aplicações, com os seguintes campos:

Código de rubrica (Campo 1): Campo que identifica o código de rubrica, sendo preenchido

com o código da tabela 1 seguido dos seguintes campos. Relativamente às rubricas dos créditos titularizáveis, deve ser feita a separação por entidade cedente, sempre que tal se aplique.

Código do valor (Campo 2): Campo que identifica o código do valor, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number* (ISIN), nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável;
- No caso dos códigos de rubrica “111- Crédito Hipotecários” a “126-Outros Créditos” este campo não deve ser preenchido; e
- Nos restantes casos, a codificação é livre, devendo a mesma ser consistentemente utilizada no tempo e nos diferentes fundos sob gestão.

Descrição do valor (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que identifica a designação do valor, independentemente da existência de código do valor. No caso do valor corresponder a um crédito titularizável, deve ser preenchido com a identificação da entidade cedente do crédito.

Código da moeda (Campo 4): Campo que identifica o código da moeda em que o valor se encontra expresso, nos termos da Norma ISO 4217.

Cotação da moeda (Campo 5): Campo que identifica a cotação da moeda em que o valor se encontra expresso para efeitos de avaliação.

Quantidade do valor (Campo 6): Campo que identifica a quantidade do valor em carteira ou o valor nominal no caso de instrumentos de dívida que nesta forma sejam expressos. No caso de o valor corresponder a créditos titularizáveis, deve ser preenchido com o valor total de aquisição dos créditos.

Preço do valor (Campo 7): Campo que identifica o preço unitário do valor em carteira na moeda em que foram adquiridos ou em percentagem do valor nominal quando se tratem de valores representativos de dívida. No caso dos créditos titularizáveis, deve ser preenchido com o valor total nominal ainda não amortizado do total dos créditos considerados.

Juros decorridos e rendimentos de créditos (Campo 8): Campo que é preenchido com o montante de juros decorridos e rendimentos de créditos, em euros.

Valor total (Campo 9): Campo que identifica o montante global do valor integrante da carteira incluindo juros decorridos e rendimentos de créditos, em euros. Relativamente aos créditos titularizáveis, este campo compreende a soma dos campos “Preço do Valor” e “Juros decorridos e rendimentos dos créditos”, em euros.

Campo	1	2	3	4	5
-------	---	---	---	---	---

Identificação	Código de Rubrica	Código do valor	Descrição do valor	Código da moeda	Cotação da moeda
Domínio e Dimensão	Código da tabela 1	Dimensão máxima de 12 caracteres alfanuméricos*	Dimensão máxima de 200 caracteres alfa numéricos*	ISO 4217	Dimensão máxima de 14 caracteres numéricos, com 10 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!”, “?” “\” e “&”.

6	7	8	9
Quantidade do valor	Preço do valor	Juros decorridos e rendimentos de créditos	Valor total
Dimensão máxima de 22 caracteres numéricos, com 6 casas decimais	Dimensão máxima de 22 caracteres numéricos, com 10 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 10 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais

Tabela 10 - Códigos de rubrica da carteira de aplicações

Código de rubrica	Designação
	CRÉDITOS TITULARIZÁVEIS
	Entidades Cedentes Nacionais
111	Crédito Hipotecários
112	Crédito ao Consumo
113	Crédito sobre o Estado ou Outras Pessoas Coletivas
114	Crédito de Fundos de Pensões
115	Créditos Futuros
116	Outros Créditos
	Entidades Cedentes Estrangeiras
121	Crédito Hipotecários
122	Crédito ao Consumo

123	Crédito sobre o Estado ou Outras Pessoas Coletivas
124	Crédito de Fundos de Pensões
125	Créditos Futuros
126	Outros Créditos
	INSTRUMENTOS FINANCEIROS ADMITIDOS À NEGOCIAÇÃO
	Plataformas de negociação nacionais
211	Títulos de dívida pública
212	Outros fundos públicos e equiparados
213	Obrigações diversas
214	Ações
215	Títulos de participação
216	Direitos
217	Outros
	Plataformas de negociação estrangeiras
221	Títulos de dívida pública
222	Outros fundos públicos e equiparados
223	Obrigações diversas
224	Ações
225	Títulos de participação
226	Direitos
227	Outros
	INSTRUMENTOS DE DÍVIDA DE CURTO PRAZO
311	Títulos de dívida pública
312	Papel comercial
313	Outros
	PARTICIPAÇÕES EM FUNDOS
41	Unidades de titularização de créditos
42	Unidades de participação de outros fundos
	LIQUIDEZ
	Excedentes de Liquidez
511	Excedentes de Liquidez por Sobrecolateralização
512	Fundo de Garantia
	À vista
531	Numerário

532	Depósitos à ordem
	A prazo
541	Depósitos com pré-aviso e a prazo
542	Aplicações nos mercados monetários
6	EMPRÉSTIMOS
	OUTROS VALORES A REGULARIZAR
71	Valores activos
72	Valores passivos

Bloco de informação número 2: Informação adicional sobre a carteira, com os seguintes campos:

Valor líquido global (Campo 1): Campo que identifica o valor líquido global do fundo, em euros.

N.º Unidades de titularização (Campo 2): Campo que identifica o total de unidades de titularização.

Campo	1	2
Identificação	Valor líquido global	N.º Unidades de titularização
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais

Bloco de informação número 3: Informação sobre as unidades de titularização, com os seguintes campos:

Código de tranche (Campo 1): Campo que identifica o código de tranche das unidades de titularização, sendo preenchido com o código da tabela 2.

Tipo de participante (Campo 2): Campo que identifica o tipo de participante, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NP”, para participantes não profissionais;
- “PR”, para participantes profissionais;
- “CE”, para contrapartes elegíveis

Número de participante (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o

número de participantes, sendo preenchido com o número de cada combinação de tranche e tipo de participante.

Quantidade de unidades de titularização (Campo 4): Campo que identifica a quantidade de unidades de titularização.

Campo	1	2	3	4
Identificação	Código de tranche	Tipo de participante	Número de participante	Quantidade de unidades de titularização
Domínio e Dimensão	Código da tabela 2	NP, PR, CE	10 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais

Tabela 2 - Códigos de tranches das Unidades de Titularização

Código de tranche	Designação
	Unidades de titularização de Créditos
	Número total
1211	Tranche sénior
1212	Tranche subordinada
1213	Tranche residual
	Emitidas no período
1221	Tranche sénior
1222	Tranche subordinada
1223	Tranche residual

Bloco de informação número 4: Informação sobre as responsabilidades extrapatrimoniais da carteira, com os seguintes campos:

Código de rubrica (Campo 1): Campo que identifica o código de rubrica das responsabilidades extrapatrimoniais, sendo preenchido com o código da tabela 3.

Código do valor (Campo 2): Campo que identifica o código do elemento extrapatrimonial, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number (ISIN)*, nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável;

- No caso dos códigos da rubrica “Outras Operações de Cobertura”: “111- Sobrecolateralização” a “114- Garantias Prestadas por Terceiras Entidades” este campo não deve ser preenchido; e
- Nos restantes casos, a codificação é livre, devendo a mesma ser consistentemente utilizada no tempo e nos diferentes fundos sob gestão.

Descrição do valor (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que identifica a designação do elemento extrapatrimonial.

Código da moeda (Campo 4): Campo que identifica o código da moeda em que o elemento extrapatrimonial se encontra expresso, nos termos da Norma ISO 4217.

Cotação da moeda (Campo 5): Campo que identifica a cotação da moeda em que o elemento extrapatrimonial se encontra expresso para efeitos de avaliação.

Quantidade (Campo 6): Campo que é preenchido com a quantidade do elemento extrapatrimonial.

Preço do valor (Campo 7): Campo que identifica o preço unitário do elemento extrapatrimonial em carteira na moeda em que foi adquirido.

Valor total (Campo 8): Campo que identifica o montante global do elemento extrapatrimonial, em euros. As posições vendedoras deverão ser precedidas de sinal negativo.

Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Código de Rubrica	Código do valor	Descrição do valor	Código da moeda	Cotação da moeda
Domínio e Dimensão	Código da tabela 3	Dimensão máxima de 12 caracteres alfanuméricos*	Dimensão máxima de 200 caracteres alfa numéricos*	ISO 4217	Dimensão máxima de 14 caracteres numéricos, com 10 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “ ”, “ * ”, “ ! ”, “ ? ” “ \ ” e “ & ”.

6	7	8
	Preço do valor	Valor total

Quantidade do valor		
Dimensão máxima de 22 caracteres numéricos, com 6 casas decimais	Dimensão máxima de 22 caracteres numéricos, com 10 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 6 casas decimais

Tabela 3 - Códigos de rubrica das responsabilidades extrapatrimoniais

Código de rubrica	Designação
	OPERAÇÕES CAMBIAIS
	Em plataformas de negociação
811	Futuros
812	Opções
813	Outros
	Fora de plataformas de negociação
821	Forwards
822	Opções
823	Swaps
824	Outros
	OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO
	Em plataformas de negociação
911	Futuros
912	Opções
913	Outros
	Fora de plataformas de negociação
921	Forwards
922	Opções
923	Swaps
924	Outros
	OPERAÇÕES SOBRE INSTRUMENTOS DE CRÉDITO
	Em plataformas de negociação
1011	Futuros

1012	Opções
1013	Outros
	Fora de plataformas de negociação
1021	Forwards
1022	Opções
1023	Swaps
1024	Outros
	OUTRAS OPERAÇÕES DE COBERTURA
111	Sobrecolaterização
112	Fundo de Garantia
113	Linhas de Crédito
114	Garantias Prestadas por Terceiras Entidades

ANEXO V

INFORMAÇÃO FINANCEIRA RELATIVA AO BALANÇO E DEMONSTRAÇÃO DOS RESULTADOS DOS FUNDOS DE TITULARIZAÇÃO DE CRÉDITO (FTC)

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de Rubricas do Balanço, Demonstração dos Resultados	Ficheiro de dados	DFTNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMDD.XML
	DFT identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "DFT" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_DFT_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteúdoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre as rubricas de balanço dos fundos de titularização de crédito (FTC), com os seguintes campos:

Código de conta (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de conta, sendo preenchido de acordo com o código de conta da tabela 1.

Valor de conta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o saldo da conta no final de cada período de reporte, sendo preenchido com um valor positivo para as rubricas de ativo e passivo.

Campo	1	2
Identificação	Código de conta	Valor de conta
Domínio e Dimensão	Código da tabela 1	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Tabela 11 - Códigos de conta das rubricas de balanço

Código de Conta	Designação
BL01	Ativo Total
BL02	Caixa e disponibilidade bancárias
BL03	Outras disponibilidades
BL04	Instrumentos financeiros
BL05	Créditos titularizáveis
BL06	Conta de regularização de créditos
BL07	Devedores
BL08	Outras contas de regularização
BL09	Passivo total
BL10	Unidades de titularização
BL11	Variações face ao valor nominal
BL12	Sobrecolaterização
BL13	Excedente de responsabilidade do fundo
BL14	Resultados transitados
BL15	Resultado líquido do exercício
BL16	Credores
BL17	Empréstimos
BL18	Detentores de unidades de titularização
BL19	Outras contas de regularização

Bloco de informação número 2: Informação sobre as rubricas da demonstração dos resultados dos FTC, com os seguintes campos:

Código de conta (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de conta, sendo preenchido de acordo com o código de conta da tabela 2.

Valor de conta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o saldo da conta no final de cada período de reporte, sendo preenchido com um valor positivo ou negativo, consoante a rubrica contribua de modo positivo ou negativo para o resultado líquido do exercício.

Campo	1	2
Identificação	Código de conta	Valor de conta
Domínio e Dimensão	Código da tabela 2	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Tabela 12 - Código de conta das rubricas da demonstração dos resultados

Código de Conta	Designação
DR01	Juros e rendimentos similares
DR02	Juros e gastos similares
DR03	Comissões
DR04	Ganhos/perdas em operações financeiras
DR05	Aumentos/reversões de provisões
DR06	Outros ganhos correntes
DR07	Outros gastos correntes
DR08	Ganhos eventuais
DR09	Gastos eventuais
DR10	Resultado antes de impostos
DR11	Imposto sobre o rendimento do exercício
DR12	Resultado líquido do exercício

ANEXO VI

INFORMAÇÃO RELATIVA AO REGULAMENTO DE GESTÃO DOS FUNDOS DE TITULARIZAÇÃO DE CRÉDITO (FTC)

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do Regulamento de Gestão	Ficheiro de texto	FRGNNNNNNFFFSSSS0AAAAMDD.PDF
	FRG identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

ANEXO VII

INFORMAÇÃO RELATIVA AOS DOCUMENTOS DE PRESTAÇÃO DE CONTAS ANUAIS DOS FUNDOS DE TITULARIZAÇÃO DE CRÉDITOS (FTC)

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do Relatório e Contas Anual	Ficheiro de dados	FRCNNNNNNFFFFSSSS0AAAAMMDD.PDF
	FRC identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

ANEXO VIII

INFORMAÇÃO RELATIVA AO RELATÓRIO DE AUDITORIA (RDA) DOS FUNDOS DE TITULARIZAÇÃO DE CRÉDITOS (FTC)

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informação do relatório de auditoria	Ficheiro de dados	RDANNNNNNFFFFSSSS0AAAAMMDD.XML
	RDA identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'FFFF' corresponde ao número do organismo atribuído pela CMVM, 'SSSS' corresponde ao número do compartimento patrimonial autónomo atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Caso o organismo não integre compartimentos patrimoniais autónomos, a componente 'SSSS' é preenchida com '0000'. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "RDA" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_RDA_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteúdoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o conteúdo do relatório de auditoria (RDA) (RDA) dos fundos de titularização de créditos (FTC), com os seguintes campos:

Tipo de opinião (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as características do RDA, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “SRE”, para RDA sem reservas e ênfases;
- “CRE”, para RDA com reservas e ênfases;
- “OCR”, para RDA com reservas e sem ênfases;
- “OCE”, para RDA com ênfases e sem reservas;
- “EDO”, para uma escusa de opinião;
- “ADV”, para uma opinião adversa.

Campo	1
Identificação	Tipo de opinião
Domínio e Dimensão	SRE, CRE, OCR, OCE, EDO, ADV

Bloco de informação número 2: Informação sobre as reservas no RDA, com os seguintes campos:

Identificação de reservas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCR”, e que identifica um número sequencial de 1 a n, sendo n o número total de reservas.

Descrição da reserva (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCR”, e que identifica o texto da reserva que consta do RDA.

Campo	1	2
Identificação	Identificação de reservas	Descrição da reserva
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 3 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos *

* Não são permitidos os caracteres “ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 3: Informação sobre as ênfases no RDA, com os seguintes campos:

Identificação de ênfases (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCE”, e que identifica um número sequencial de 1 a n, sendo n o número total de ênfases.

Descrição da ênfase (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCE”, e que identifica o texto da ênfase que consta do RDA.

Campo	1	2
Identificação	Identificação de ênfases	Descrição da ênfase
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 3 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos *

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 4: Informação sobre o auditor que assina o RDA, com os seguintes campos:

Número de registo do revisor oficial de contas (ROC) (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o número de registo na CMVM do ROC que assina o RDA.

Número de registo da SROC (Campo 2): Campo que identifica o número de registo na CMVM da SROC a qual pertence o revisor oficial de contas (ROC) que assina o RDA.

Campo	1	2
Identificação	Número de registo do ROC	Número de registo da SROC
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 8 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 8 caracteres numéricos

ANEXO D

(A que se refere o artigo 9.º)

Anexo 1

Notificação prévia do DIF à CMVM

É enviado à CMVM um ficheiro com extensão “.ZIP”, agregando dois ficheiros, um com extensão “.XML” e o outro com extensão “.PDF”.

O ficheiro com extensão “.PDF” contém uma cópia do DIF notificado por meio deste Anexo. Caso exista mais do que uma versão linguística do mesmo DIF, nos termos admitidos pelo artigo 4.º do presente regulamento, o ficheiro com extensão “.PDF” inclui cada uma das versões.

Quanto aos nomes dos ficheiros:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura dos ficheiros	
1	Notificação prévia do DIF	Ficheiro de dados	ZNPNNNNNNSAAAAMMDD.XML
		Ficheiro de texto	ZNPNNNNNNSAAAAMMDD.PDF
		Ficheiro	ZNPNNNNNNSAAAAMMDD.ZIP

		<p>ZNP identifica a informação notificada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade notificante atribuído pela CMVM, 'SS' algarismo que corresponde a um número sequencial de notificações em cada dia e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia da notificação.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.</p>
--	--	--

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "ZNP" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_ZNP_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação que identifica a entidade notificante do DIF («Entidade Notificante»), com os seguintes campos:

Denominação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a denominação legal da Entidade Notificante.

LEI (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o código LEI (*legal entity identifier*) da Entidade Notificante.

País (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o país do domicílio fiscal ou sede efetiva da Entidade Notificante.

Qualidade (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a qualidade em que a Entidade Notificante notifica o DIF, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

PN — Produtor Nacional;

PE — Produtor Estrangeiro;

CM — Comercializador;

RC — Representante comum designado pelo produtor.

Endereço de correio eletrónico (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o endereço de correio eletrónico da Entidade Notificante para o qual deverá ser enviado o código do PRIIP.

Bloco de informação número 2: Informação que identifica o produtor do PRIIP («Produtor») a que se refere o DIF notificado, com os seguintes campos:

Denominação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a denominação legal do Produtor.

LEI (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o código LEI (*legal entity identifier*) do Produtor.

País (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o país do domicílio fiscal ou sede efetiva do Produtor.

Autoridade (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o nome da autoridade competente responsável pela supervisão do produtor do PRIIP no que diz respeito ao DIF.

Website (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o endereço do sítio da Internet do produtor onde será publicado o DIF notificado.

Bloco de informação número 3: Informação que identifica a(s) entidade(s) comercializadora(s) do PRIIP a que se refere o DIF notificado («Comercializador»), com um registo por cada Comercializador, com os seguintes campos:

Denominação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a denominação legal do Comercializador.

LEI (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o código LEI (*legal entity identifier*) do Comercializador.

País (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o país do domicílio fiscal ou sede efetiva do Comercializador.

Data de início da comercialização (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a data em que o Comercializador iniciará a comercialização do PRIIP.

Data de fim da comercialização (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 1 do bloco de informação número 7 for preenchido com o código «N», que indica a data em que o Comercializador cessará a comercialização do PRIIP.

Bloco de informação número 4: Informação que identifica o PRIIP a que se refere o DIF notificado («PRIIP»), com os seguintes campos:

Designação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o nome do PRIIP, tal como consta do DIF.

Tipo (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o tipo de PRIIP, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

IFD — instrumentos financeiros derivados;

PLT — PRIIPs não admitidos à negociação e negociados em plataformas de negociação eletrónica;

VMD — valores mobiliários de estrutura derivada;

OVD — outros valores mobiliários representativos de dívida com possibilidade de reembolso abaixo do valor nominal por efeito da sua associação a outro produto ou evento, nomeadamente *Notes*;

DUA — produtos duais, produtos que compreendem a comercialização combinada de dois ou mais produtos financeiros, resultando, da combinação, um produto com a designação e com características específicas e incidíveis em relação aos elementos que o compõem;

VOP – valores mobiliários comercializados através de oferta pública com prospeto aprovado pela CMVM;

OUT — outros investimentos ou produtos.

ISIN (Campo 3): Campo que indica, caso exista, o *International Securities Identification Number* (ISIN) do PRIIP.

UPI (Campo 4): Campo que indica, caso exista, o *Unique Product Identifier* (UPI) do PRIIP.

Código padrão de PLT (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 2 for preenchido com o código «PLT». Este campo é preenchido com um código padrão de letras e/ou números escolhido pela Entidade Notificante. O código padrão considera-se escolhido no momento da notificação do primeiro DIF relativo à plataforma, devendo a Entidade Notificante preencher este campo com um único código padrão sempre que notificar DIF relativos à mesma plataforma de negociação eletrónica, de modo a permitir a associação dos vários DIF à respetiva plataforma. Os DIF que não apresentem o mesmo código padrão não serão considerados, para todos os efeitos, como DIF associados à mesma plataforma.

Bloco de informação número 5: Informação que indica se o DIF notificado tem carácter genérico e se o PRIIP oferece uma gama de opções de investimento (*multi-option* PRIIP, doravante «MOP»), com os seguintes campos:

Tipo de DIF (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que indica o tipo de DIF notificado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

GEN — o DIF notificado tem carácter genérico (incluindo o previsto na alínea b) do artigo 10.º do Regulamento Delegado DIF);

ESP — o DIF notificado não tem carácter genérico.

MOP (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica se o PRIIP é um MOP, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

S — sim (o PRIIP é um MOP);

N — não (o PRIIP não é um MOP).

Código padrão (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 1 for preenchido com o código «ESP» e o campo 2 for preenchido com o código «S». Este campo é preenchido com um código padrão de letras e/ou números escolhido pela Entidade Notificante, obrigatoriamente igual para os vários DIF de tipo «ESP» relativos a opções de investimento do mesmo MOP, de modo a permitir a respetiva associação. O código padrão considera-se escolhido no momento da notificação do primeiro DIF de tipo «ESP» de um MOP, devendo a notificação dos DIF subsequentes apresentar o mesmo código padrão. Os DIF de tipo «ESP» que não apresentem o mesmo código padrão não serão considerados, para todos os efeitos, como DIF de tipo «ESP» relativos ao mesmo MOP.

Bloco de informação número 6: Informação que identifica as opções de investimento referidas no DIF de tipo «GEN». Todos os campos são de preenchimento obrigatório se o campo 1 do bloco de informação número 5 for preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 for preenchido com o código «S», com um registo por cada opção de investimento, com os seguintes campos:

Número da opção (Campo 1): Campo de controlo que indica a ordem em que a opção de investimento surge apresentada no DIF notificado, devendo ser preenchido, para cada registo, com o número de ordem em termos sequenciais, começando no número 1.

Nome da opção (Campo 2): Campo que indica o nome da opção de investimento correspondente ao número de ordem indicado no campo 1, devendo esse nome ser igual ao constante do DIF notificado.

Bloco de informação número 7: Informação relativa à comercialização do PRIIP a que se refere o DIF notificado («Comercialização»), com os seguintes campos:

Tipo de comercialização (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica se a Comercialização é contínua ou não, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

S — sim (a comercialização é contínua);

N — não (a comercialização não é contínua).

Tipo de oferta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o tipo de oferta inerente à Comercialização, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

PUB — oferta pública ou similar;

PAR — oferta particular.

Montante global da oferta (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 1 for preenchido com o código «N», que indica o montante global da oferta; caso não exista montante global da oferta, preencher com '0'.

Data de início da oferta (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a data de início da oferta inerente à Comercialização.

Data de fim da oferta (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 1 for preenchido com o código «N», que indica a data de fim da oferta inerente à Comercialização.

Bloco de informação número 8: Informação relativa a datas relevantes do PRIIP a que se refere o DIF notificado («PRIIP»), com os seguintes campos:

Data de emissão ou produção (Campo 1): Campo que indica a data de emissão ou produção do PRIIP, quando exista ou seja determinada.

Maturidade (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica se o PRIIP tem uma data de maturidade definida no DIF notificado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

S — sim (o PRIIP tem uma data de maturidade);

N — não (o PRIIP não tem uma data de maturidade).

Data de maturidade (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 2 for preenchido com o código «S», que indica a data de maturidade do PRIIP definida no DIF notificado.

Bloco de informação número 9: Informação relativa ao DIF notificado, com os seguintes campos:

Tradução (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica se o DIF notificado corresponde a uma tradução de um DIF já divulgado no sítio da Internet do produtor do PRIIP, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

S — sim (o DIF notificado corresponde a uma tradução de um DIF já divulgado no sítio da Internet do produtor do PRIIP);

N — não (o DIF notificado não corresponde a uma tradução de um DIF já divulgado no sítio da Internet do produtor do PRIIP).

Data de divulgação do DIF original (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 1 for preenchido com o código «S», que indica a data de divulgação do DIF original no sítio da Internet do produtor do PRIIP.

Data estimada de divulgação do DIF notificado (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a data estimada de divulgação do DIF notificado no sítio da Internet do produtor do PRIIP.

Bloco de informação número 10: Informação relativa ao risco do PRIIP a que se refere o DIF notificado («PRIIP»), com os seguintes campos. Se o campo 1 do bloco de informação número 5 for preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 for preenchido com o código «S», insere-se um registo por cada opção de investimento, devendo entender-se a referência a PRIIP constante dos campos 2 a 5 como uma referência a cada opção de investimento.

Número da opção (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório. Se o campo 1 do bloco de informação número 5 for preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 for preenchido com o código «S», este campo é preenchido com o número de cada opção de investimento indicado no campo 1 do bloco de informação número 6; caso contrário, este campo é preenchido com '0'.

Classe da medida de risco de mercado (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a classe da medida de risco de mercado (MRM) do PRIIP, sendo preenchido com um número de 1 a 7.

Categoria do risco de mercado (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a categoria do risco de mercado do PRIIP, sendo preenchido com um número de 1 a 4.

Medida de risco de crédito (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a medida de risco de crédito (CRM) do PRIIP, sendo preenchido com um número de 1 a 6.

Indicador sumário de risco (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o indicador sumário de risco (SRI) do PRIIP, sendo preenchido com um número de 1 a 7.

Bloco de informação número 11: Informação relativa a outros dados relevantes do PRIIP a que se refere o DIF notificado («PRIIP»), com os seguintes campos. Se o campo 1 do bloco de informação número 5 for preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação

número 5 for preenchido com o código «S», insere-se um registo por cada opção de investimento, devendo entender-se a referência a PRIIP constante dos campos 2 a 9 como uma referência a cada opção de investimento.

Número da opção (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório. Se o campo 1 do bloco de informação número 5 for preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 for preenchido com o código «S», este campo é preenchido com o número de cada opção de investimento indicado no campo 1 do bloco de informação número 6; caso contrário, este campo é preenchido com '0'.

Período de detenção recomendado (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o horizonte temporal do período de detenção recomendado do PRIIP, sendo preenchido com o número de dias; caso o horizonte temporal seja apresentado no DIF com referência a uma data específica, este campo deverá ser preenchido com essa data.

Tipo de ativos subjacentes (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que indica o tipo valores de referência ou de ativos subjacentes ao PRIIP, sendo preenchido com um ou vários dos seguintes códigos:

- STK — Ações;
- SVD — Dívida Pública;
- IDX — Índices;
- DBT — Entidades/Obrigações/Ativos de Referência;
- IRB — Taxas de juro de referência;
- CUR — Moeda/Taxas de câmbio;
- FTR — Contratos de Futuros;
- COM — *Commodities*;
- OIC — Organismos de investimento coletivo em valores mobiliários;
- OIA — Organismos de investimento alternativo;
- ETF — ETF;
- OUT — Outros.

Proteção de capital (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, que indica se o PRIIP garante o reembolso do capital investido, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- TOTAL — para PRIIP que garantam a 100% o reembolso do capital investido;
- PARCIAL — para PRIIP que garantam menos do que 100% o reembolso do capital investido;
- NADA — para PRIIP que não garantam o reembolso do capital investido.

Rendibilidade garantida (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, que indica se o PRIIP apresenta rendibilidade garantida, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

S — sim (o PRIIP apresenta rendibilidade garantida);

N — não (o PRIIP não apresenta rendibilidade garantida).

Custos ao longo do tempo (Campo 6): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a percentagem de custos em caso de resgate no fim do período de detenção recomendado, tal como consta do DIF notificado.

Custos de entrada (Campo 7): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a percentagem de custos de entrada, tal como consta do DIF notificado.

Custos de saída (Campo 8): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a percentagem de custos de saída, tal como consta do DIF notificado.

Barreiras do PRIIP (Campo 9): Campo de preenchimento obrigatório, que indica as barreiras do PRIIP, sendo preenchido com, pelo menos, um dos seguintes códigos, consoante aplicável:

KN – O PRIIP prevê barreira de *knock* (inclui *knock-out*, *knock-in* ou *knock-opt*);

BI – O PRIIP incorpora opção binária;

NA – Nenhuma das anteriores.

Entidade notificante do DIF					
Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Denominação	LEI	País	Qualidade	Endereço de correio eletrónico
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 100 caracteres	ISO 17442	ISO 3166	PN PE CM RC	Dimensão máxima de 100 caracteres

Produtor do PRIIP					
Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Denominação	LEI	País	Autoridade	<i>Website</i>
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 100 caracteres	ISO 17442	ISO 3166	Dimensão máxima de 100 caracteres	Dimensão máxima de 100 caracteres

Entidade(s) comercializadora(s)					
Campo	1	2	3	4	5

Identificação	Denominação	LEI	País	Data de início da comercialização	Data de fim da comercialização
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 100 caracteres	ISO 17442	ISO 3166	ISO 8601	ISO 8601

Identificação do PRIIP					
Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Designação	Tipo	ISIN	UPI	Código padrão de PLT
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 100 caracteres	IFD PLT VMD OVD DUA VOP OUT	ISO 6166	Dimensão máxima de 100 caracteres	Dimensão máxima de 100 caracteres

DIF Genérico e MOP			
Campo	1	2	3
Identificação	Tipo de DIF	MOP	Código padrão
Domínio e Dimensão	GEN ESP	S N	Dimensão máxima de 100 caracteres

DIF genérico de um MOP		
Campo	1	2
Identificação	Número da opção	Nome da opção
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 6 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 100 caracteres

Comercialização do PRIIP					
Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Tipo de comercialização	Tipo de oferta	Montante global da oferta	Data de início da oferta	Data de fim da oferta
Domínio e Dimensão	S N	PUB PAR	Dimensão máxima de 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	ISO 8601	ISO 8601

Datas relevantes do PRIIP			
Campo	1	2	3
Identificação	Data de emissão ou produção	Maturidade	Data de maturidade
Domínio e Dimensão	ISO 8601	S N	ISO 8601

DIF notificado			
Campo	1	2	3
Identificação	Tradução	Data de divulgação do DIF original	Data de divulgação do DIF notificado
Domínio e Dimensão	S N	ISO 8601	ISO 8601

Risco do PRIIP					
Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Número da opção	Classe da medida de risco de mercado	Categoria do risco de mercado	Medida de risco de crédito	Indicador sumário de risco

Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 6 caracteres numéricos	1	1	1	1
		2		2	2
		3		3	3
		4		4	4
		5		5	5
		6		6	6
		7		7	7

Outros dados relevantes									
Campo	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Identificação	Número da opção	Período de detenção recomendado	Tipo de ativos subjacentes	Proteção de capital	Rendibilidade e garantida	Custo ao longo do tempo	Custo de entrada	Custo de saída	Barreiras do PRIIP
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 6 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 100 caracteres numéricos	STK SVD IDX DBT IRB CUR FTR COM OIC OIA ETF OUT	TOTAL, PARCIAL, NADA	S, N	Dimensão máxima: 8 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima: 8 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima: 8 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	KN, BI, NA

Anexo 2

Disponibilização de outra versão linguística do DIF

É enviado à CMVM um ficheiro de texto com extensão “.PDF” contendo outra versão linguística do DIF.

Quanto ao nome do ficheiro:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
2	Disponibilização de outra versão linguística do DIF	Ficheiro de texto	OVLNNNNNNPPPPPXXXXX0AAAAMMDD.PDF
		OVL identifica a informação notificada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'PPPPPXXXXX' corresponde ao código do PRIIP, '0' algarismo que corresponde a um número fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia da notificação. Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.	

Anexo 3

Alteração de comercializadores de PRIIPs

É enviado à CMVM um ficheiro de dados com extensão “.XML”.

Quanto ao nome do ficheiro:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
3	Alteração de comercializadores de PRIIPs	Ficheiro de dados	DECNNNNNNPPPPXXXXX0AAAAMMDD.XML
		DEC identifica a informação notificada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'PPPPXXXXX' corresponde ao código do PRIIP, '0' algarismo que corresponde a um número fixo e 'AAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia da notificação. Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "DEC" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_DEC_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação que identifica a cessação de comercialização de PRIIP por entidade comercializadora indicada no âmbito da notificação prévia do DIF («Entidade Cessante»), com os seguintes campos:

LEI (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o código LEI (*legal entity identifier*) da Entidade Cessante.

Data de fim da comercialização (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a data em que a Entidade Cessante cessou a comercialização do PRIIP.

Bloco de informação número 2: Informação que identifica a nova entidade comercializadora de PRIIP («Nova Entidade»), com os seguintes campos:

Denominação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a denominação legal da Nova Entidade.

LEI (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o código LEI (*legal entity identifier*) da Nova Entidade.

País (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o país do domicílio fiscal ou sede efetiva da Nova Entidade.

Data de início da comercialização (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a data em que a Nova Entidade iniciará a comercialização do PRIIP.

Data de fim da comercialização (Campo 5): Campo que indica, caso exista, a data em que a Nova Entidade cessará a comercialização do PRIIP.

Cessação da comercialização por entidade designada no âmbito da notificação prévia do DIF		
Campo	1	2
Identificação	LEI	Data de fim da comercialização
Domínio e Dimensão	ISO 17442	ISO 8601

Nova entidade comercializadora de PRIIP					
Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Denominação	LEI	País	Data de início da comercialização	Data de fim da comercialização
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 100 caracteres	ISO 17442	ISO 3166	ISO 8601	ISO 8601

Anexo 4

Notificação prévia do DIF revisto à CMVM

É enviado à CMVM um ficheiro agregador com extensão “.ZIP”, agregando três ficheiros, um com extensão “.XML” e dois com extensão “.PDF”:

- a) Um dos ficheiros com extensão “.PDF” deve conter o DIF revisto em versão limpa, correspondendo ao documento divulgado no sítio da Internet do produtor de PRIIPs;
- b) O outro ficheiro com extensão “.PDF” deve conter o DIF revisto com alterações marcadas face à anterior versão do DIF, por forma a permitir a visualização gráfica e imediata das alterações efetuadas no documento.

Caso exista mais do que uma versão linguística do mesmo DIF, nos termos admitidos pelo artigo 4.º do presente regulamento, os ficheiros com extensão “.PDF” referidos nas alíneas a) e b) do parágrafo anterior incluem cada uma das versões linguísticas.

Quanto aos nomes dos ficheiros:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura dos ficheiros	
4	Informação sobre a revisão do DIF	Ficheiro de dados	ZRDNNNNNNPPPPPXXXXX0AAAAMMDD.XML
		Ficheiro de texto	ZRDNNNNNNPPPPPXXXXX0AAAAMMDD.PDF
		Ficheiro de texto	ZRDNNNNNNPPPPPXXXXX0AAAAMMDD_TC.PDF
		Ficheiro agregador	ZRDNNNNNNPPPPPXXXXX0AAAAMMDD.ZIP
		<p>ZRD identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade notificante atribuído pela CMVM, 'PPPPPXXXXX' corresponde ao Código de PRIIP, de acordo com a comunicação feita pela CMVM após notificação prévia do DIF (dimensão fixa de dez caracteres), '0' algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.</p>	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "ZRD" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_ZRD_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra

Bloco de informação número 1: Informação sobre o procedimento de revisão do DIF, com os seguintes campos:

Data de divulgação no sítio da Internet do produtor (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que identifica a data em que o Produtor irá divulgar o DIF revisto no seu sítio da Internet.

Observações complementares (Campo 2): Campo de preenchimento opcional para inclusão de eventuais observações e informações de enquadramento sobre os factos comunicados.

Bloco de informação número 2: Informação sobre as secções revistas, com os seguintes campos:

Identificação das Secções do DIF objeto de revisão (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que identifica o número da(s) Secção(ões) alterada(s) de acordo com os seguintes Códigos:

Identificação da Secção do DIF	Código
Secção de informação de carácter geral	1
Secção «Em que consiste este produto?»	2
Secção «Quais são os riscos e qual poderá ser o meu retorno?»	3
Secção «O que sucede se [nome do Produtor do PRIIP] não puder pagar?»	4
Secção «Quais são os custos?»	5
Secção «Por quanto tempo devo manter o PRIIP? E posso fazer mobilizações antecipadas de capital?»	6
Secção «Como posso apresentar queixa?»	7
Secção «Outras informações relevantes»	8

Descrição sintética dos fundamentos da revisão (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, com texto sucinto, que identifica de forma sintética, para cada Secção objeto de revisão, quais os fundamentos considerados para rever o DIF.

Bloco de informação número 3: Informação que identifica o produtor do PRIIP («Produtor») a que se refere o DIF notificado, com os seguintes campos:

Denominação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a denominação legal do Produtor.

LEI (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o código LEI (*legal entity identifier*) do Produtor.

País (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o país do domicílio fiscal ou sede efetiva do Produtor.

Autoridade (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o nome da autoridade competente responsável pela supervisão do produtor do PRIIP no que diz respeito ao DIF.

Website (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o endereço do sítio da Internet do produtor onde será publicado o DIF notificado.

Bloco de informação número 4: Informação que identifica o PRIIP a que se refere o DIF notificado («PRIIP»), com os seguintes campos:

Designação (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o nome do PRIIP, tal como consta do DIF.

ISIN (Campo 2): Campo que indica, caso exista, o *International Securities Identification Number* (ISIN) do PRIIP.

UPI (Campo 3): Campo que indica, caso exista, o *Unique Product Identifier* (UPI) do PRIIP.

Bloco de informação número 5: Informação que identifica as opções de investimento referidas no DIF de tipo «GEN», com os seguintes campos. Todos os campos são de preenchimento obrigatório se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «S», com um registo por cada opção de investimento.

Número da opção (Campo 1): Campo de controlo que indica a ordem em que a opção de investimento surge apresentada no DIF notificado, devendo ser preenchido, para cada registo, com o número de ordem em termos sequenciais, começando no número 1.

Nome da opção (Campo 2): Campo que indica o nome da opção de investimento correspondente ao número de ordem indicado no campo 1, devendo esse nome ser igual ao constante do DIF notificado.

Bloco de informação número 6: Informação relativa à comercialização do PRIIP a que se refere o DIF notificado («Comercialização»), com os seguintes campos:

Tipo de comercialização (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, que indica se a Comercialização é contínua ou não, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

S — sim (a comercialização é contínua);

N — não (a comercialização não é contínua).

Data de fim da oferta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 1 for preenchido com o código «N», que indica a data de fim da oferta inerente à Comercialização.

Bloco de informação número 7: Informação relativa a datas relevantes do PRIIP a que se refere o DIF notificado («PRIIP»), com os seguintes campos:

Data de emissão ou produção (Campo 1): Campo que indica a data de emissão ou produção do PRIIP, quando exista ou seja determinada.

Maturidade (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica se o PRIIP tem uma data de maturidade definida no DIF notificado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

S — sim (o PRIIP tem uma data de maturidade);

N — não (o PRIIP não tem uma data de maturidade).

Data de maturidade (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 2 for preenchido com o código «S», que indica a data de maturidade do PRIIP definida no DIF notificado.

Bloco de informação número 8: Informação relativa ao risco do PRIIP a que se refere o DIF notificado («PRIIP»), com os seguintes campos. Se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «S», insere-se um registo por cada opção de investimento, devendo entender-se a referência a PRIIP constante dos campos 2 a 5 como uma referência a cada opção de investimento.

Número da opção (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «S», preenchendo-se com o número de cada opção de investimento indicado no campo 1 do bloco de informação número 6 do Anexo 1; caso contrário, este campo é preenchido com '0'.

Classe da medida de risco de mercado (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a classe da medida de risco de mercado (MRM) do PRIIP, sendo preenchido com um número de 1 a 7.

Categoria do risco de mercado (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a categoria do risco de mercado do PRIIP, sendo preenchido com um número de 1 a 4.

Medida de risco de crédito (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a medida de risco de crédito (CRM) do PRIIP, sendo preenchido com um número de 1 a 6.

Indicador sumário de risco (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o indicador sumário de risco (SRI) do PRIIP, sendo preenchido com um número de 1 a 7.

Bloco de informação número 9: Informação relativa a outros dados relevantes do PRIIP a que se refere o DIF notificado («PRIIP»), com os seguintes campos. Se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «S», insere-se um registo por cada opção de investimento, devendo entender-se a referência a PRIIP constante dos campos 2 a 9 como uma referência a cada opção de investimento.

Número da opção (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «S», preenchendo-se com o número de cada opção de investimento indicado no campo 1 do bloco de informação número 6 do Anexo 1; caso contrário, este campo é preenchido com '0'.

Período de detenção recomendado (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica o horizonte temporal do período de detenção recomendado do PRIIP, sendo preenchido com o número de dias; caso o horizonte temporal seja apresentado no DIF com referência a uma data específica, este campo deverá ser preenchido com essa data.

Tipo de ativos subjacentes (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório que indica o tipo valores de referência ou de ativos subjacentes ao PRIIP, sendo preenchido com um ou vários dos seguintes códigos:

STK — Ações;

SVD — Dívida Pública;

IDX — Índices;

DBT — Entidades/Obrigações/Ativos de Referência;

IRB — Taxas de juro de referência;

CUR — Moeda/Taxas de câmbio;

FTR — Contratos de Futuros;

COM — *Commodities*;

OIC — Organismos de investimento coletivo em valores mobiliários;

OIA — Organismos de investimento alternativo;

ETF — ETF;

OUT — Outros.

Proteção de capital (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, que indica se o PRIIP garante o reembolso do capital investido, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

TOTAL — para PRIIP que garantam a 100% o reembolso do capital investido;

PARCIAL — para PRIIP que garantam menos do que 100% o reembolso do capital investido;

NADA — para PRIIP que não garantam o reembolso do capital investido.

Rendibilidade garantida (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, que indica se o PRIIP apresenta rendibilidade garantida, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

S — sim (o PRIIP apresenta rendibilidade garantida);

N — não (o PRIIP não apresenta rendibilidade garantida).

Custos ao longo do tempo (Campo 6): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a percentagem de custos em caso de resgate no fim do período de detenção recomendado, tal como consta do DIF notificado.

Custos de entrada (Campo 7): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a percentagem de custos de entrada, tal como consta do DIF notificado.

Custos de saída (Campo 8): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a percentagem de custos de saída, tal como consta do DIF notificado.

Barreiras do PRIIP (Campo 9): Campo de preenchimento obrigatório, que indica as barreiras do PRIIP, sendo preenchido com, pelo menos, um dos seguintes códigos, consoante aplicável:

KN – O PRIIP prevê barreira de *knock* (inclui *knock-out*, *knock-in* ou *knock-opt*);

BI – O PRIIP incorpora opção binária;

NA – Nenhuma das anteriores.

Informação sobre o procedimento de revisão do DIF		
Campo	1	2
Identificação	Data de divulgação no sítio da Internet do produtor	Observações complementares
Domínio e Dimensão	ISO 8601	Dimensão máxima de 2500 carateres

Secções Revistas		
Campo	1	2
Identificação	Secções Revistas	Fundamentos da revisão
Domínio e Dimensão	1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8	Dimensão máxima de 2500 carateres

Produtor do PRIIP					
Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Denominação	LEI	País	Autoridade	<i>Website</i>
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 100 carateres	ISO 174 42	ISO 3166	Dimensão máxima de 100 carateres	Dimensão máxima de 100 carateres

Identificação do PRIIP			
Campo	1	2	3
Identificação	Designação	ISIN	UPI
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 100 carateres	ISO 6166	Dimensão máxima de 100 carateres

DIF genérico de um MOP		
Campo	1	2
Identificação	Número da opção	Nome da opção
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 6 carateres	Dimensão máxima de 100 carateres

Comercialização do PRIIP		
Campo	1	2
Identificação	Tipo de comercialização	Data de fim da oferta
Domínio e Dimensão	S N	ISO 8601

Datas relevantes do PRIIP			
Campo	1	2	3
Identificação	Data de emissão ou produção	Maturidade	Data de maturidade
Domínio e Dimensão	ISO 8601	S N	ISO 8601

Risco do PRIIP					
Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Número da opção	Classe da medida de risco de mercado	Categoria do risco de mercado	Medida de risco de crédito	Indicador sumário de risco
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 6 carateres	1 2 3 4 5 6	1 2 3 4	1 2 3 4 5 6	1 2 3 4 5 6

		7			7
--	--	---	--	--	---

Outros dados relevantes									
Campo	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Identificação	Número da opção	Período de detenção recomendado	Tipo de ativos subjacentes	Proteção de capital	Rendibilidade garantida	Custo ao longo do tempo	Custo de entrada	Custo de saída	Barreiras do PRIIP
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 6 caracteres	Dimensão máxima de 100 caracteres	STK SVD IDX DBT IRB CUR FTR COM OIC OIA ETF OUT	T O T A L , P A R C I A L , N A D A	S N	Dimensão máxima: 8 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima: 8 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima: 8 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	KN BI NA

Anexo 5

Informação contínua à CMVM - resultado da comercialização do PRIIP

É enviado à CMVM um ficheiro com extensão “.XML”.

Os PRIIPs relativamente aos quais tenha sido reportado o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 como “GEN” e o campo 2 do Bloco de informação número 5 do Anexo 1 com o código «S», deverão poder reportar, para cada um dos campos *infra*, tantas linhas quantas as opções reportadas no bloco de informação número 6 do Anexo 1. Se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 com o código «S», insere-se uma linha por cada opção de investimento.

Quanto ao nome do ficheiro:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
5	Resultado da comercialização	Ficheiro de dados	RESNNNNNNPPPPPXXXXX0AAAAMM DD.XML
		<p>RES identifica a informação reportada, 'NNNNNN'⁵ corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'PPPPPXXXXX' corresponde ao Código de PRIIP, de acordo com a comunicação feita pela CMVM após notificação prévia do DIF (dimensão fixa de dez caracteres), '0' algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.</p>	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "RES" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_RES_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação (“reporte nulo”)

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de “NULO” nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve

ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções *infra*.

Número da opção (Campo 1): Campo de controlo que indica a ordem em que a opção de investimento surge apresentada no DIF notificado, devendo ser preenchido, para cada registo, com o número de ordem em termos sequenciais, começando no número 1, se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido como “GEN” e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 com o código «S»; caso contrário este campo é preenchido com ‘0’.

Montante colocado (Campo 2): Campo que identifica o montante global colocado.

Moeda de referência (Campo 3): Campo que identifica a moeda de referência do PRIIP, definido tendo por base a Norma ISO 4217.

Montante colocado junto de Investidores Não Profissionais (INP) (Campo 4): Campo que identifica o montante colocado junto de Investidores Não Profissionais.

Número de Investidores Não Profissionais que subscreveram o PRIIP (Campo 5): Campo que indica o número de Investidores Não Profissionais que subscreveram o PRIIP.

Informação sobre o resultado da comercialização do PRIIP					
Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Número da opção	Montante colocado	Moeda	Montante Colocado INP	Número de INP
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 6 caracteres numéricos	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	ISO 4217	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 6 caracteres numéricos

Anexo 6

Informação sobre fluxos monetários e preço unitário representativo

É enviado à CMVM um ficheiro de dados com extensão “.XML”, sendo os valores reportados baseados nos fluxos verificados durante o período de reporte.

Os PRIIPs relativamente aos quais tenha sido reportado o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 como “GEN” e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 com o código «S», deverão reportar, para cada um dos campos *infra*, tantos registos quantas as opções reportadas no bloco de informação número 6 do Anexo 1. Se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 com o código «S», insere-se um registo por cada opção de investimento.

Quanto ao nome do ficheiro:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
6	Fluxos monetários	Ficheiro de dados	FLXNNNNNNPPPPXXXXX0AAAAMMDD.XML
		<p>FLX identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'PPPPXXXXX' corresponde ao Código de PRIIP, de acordo com a comunicação feita pela CMVM após notificação prévia do DIF (dimensão fixa de dez caracteres), '0' algarismo que corresponde a um caráter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.</p>	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "FLX" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_FLX_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação ("reporte nulo")

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de "NULO" nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Número da opção (Campo 1): Campo de controlo que indica a ordem em que a opção de investimento surge apresentada no DIF notificado, devendo ser preenchido, para cada registo, com o número de ordem em termos sequenciais, começando no número 1, se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido como "GEN" e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 com o código «S»; caso contrário este campo é preenchido com '0'.

Montante entregue ao Investidor (Campo 2): Campo que identifica o montante pago ao Investidor.

Moeda de referência (Campo 3): Campo que identifica a moeda de referência do montante reportado no campo 2, de acordo com a Codificação prevista na Norma ISO 4217.

Data em que a entrega foi feita ao Investidor (Campo 4): Campo que identifica a data em que o montante foi entregue ao Investidor.

Identificação da justificação/tipologia de fluxo (Campo 5): Campo que identifica o tipo/natureza do fluxo monetário de acordo com os seguintes Códigos:

Justificação do fluxo	Código
Pagamento de cupão/juro periódico	JUR
Reembolso Antecipado	REA
Amortização Parcial	AMP
Reembolso na Data de Maturidade	RDM
Entrega periódica	EPR
Resgate	RES
Outros	OUT

Preço unitário representativo (Campo 6): Campo que indica o preço unitário representativo do PRIIP. Caso o PRIIP não se encontre admitido à negociação, ou caso o preço formado não seja representativo, deve ser introduzido o valor teórico calculado de acordo com metodologias tecnicamente adequadas às respetivas características. O preço representativo deverá ser aquele que melhor representa o valor do PRIIP à data de referência do reporte.

Informação sobre os fluxos monetários do PRIIP e sobre preço unitário						
Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Número da opção	Montante entregue	Moeda	Data de entrega ao investidor	Tipo de fluxo	Preço unitário
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 6 caracteres	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	ISO 4217	ISO 8601	JUR REA AMP RDM EPR RES OUT	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais

Anexo 7

Reporte plataformas de negociação eletrónica

É enviado à CMVM um ficheiro de dados com extensão “.XML”.

Este Anexo é de reporte obrigatório caso tenha sido reportado “PLT” no campo 2 do bloco de informação número 4 do Anexo 1. Se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «S», insere-se uma linha por cada opção de investimento.

Quanto ao nome do ficheiro:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
7	Reporte Plataformas	Ficheiro de dados	PLTNNNNNNPPPPXXXXX0AAAAM MDD.XML
		<p>PLT identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'PPPPXXXXX' corresponde ao Código de PRIIP, de acordo com a comunicação feita pela CMVM após notificação prévia do DIF (dimensão fixa de dez caracteres), '0' algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.</p>	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "PLT" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_PLT_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação (“reporte nulo”)

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de “NULO” nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Número da opção (Campo 1): Campo de controlo que indica a ordem em que a opção de investimento surge apresentada no DIF notificado, devendo ser preenchido, para cada registo, com o número de ordem em termos sequenciais, começando no número 1, se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido como “GEN” e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 com o código «S»; caso contrário este campo é preenchido com ‘0’.

Tipo de PRIIP (Campo 2): campo de preenchimento obrigatório, que indica a tipologia do PRIIP, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- MR – Contratos derivados sobre mercadorias;
- FT – Contratos de futuros;
- CT – Contratos de *forwards*;
- SW – Contratos de troca (*Swap*);
- OC – Contratos de opções de compra;
- OV – Contrato de opções de venda;
- CD – Contratos diferenciais;
- OB – Opções binárias;
- ID – Contratos derivados sobre índices financeiros ou indicadores financeiros;
- DV – Outros contratos de derivados sobre divisas;
- TX - Outros contratos de derivados sobre taxas de juro;
- UD –Outros contratos de derivados;
- OP –Outros PRIIPs.

Volume negociado (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que identifica o valor nominal das posições abertas durante o semestre por Investidores na plataforma de negociação eletrónica.

Moeda de referência (Campo 4): Campo que identifica a moeda de referência do montante reportado no campo 3, de acordo com a Codificação prevista na Norma ISO 4217.

Posições fechadas com ganho (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, que identifica a percentagem de posições sobre o PRIIP fechadas com ganho no semestre, relativamente ao total de posições fechadas no semestre.

Posições fechadas com perda (Campo 6): Campo de preenchimento obrigatório, que identifica a percentagem de posições sobre o PRIIP fechadas com perda no semestre, relativamente ao total de posições fechadas no semestre.

Montante de ganhos (Campo 7): Campo monetário de preenchimento obrigatório, que identifica o montante dos ganhos verificados nas posições sobre o PRIIP fechadas no semestre.

Número de Investidores associado ao montante de ganhos (Campo 8): Campo numérico de preenchimento obrigatório, que identifica o número de Investidores que fechou posições com ganho no semestre.

Montante de perdas (Campo 9): Campo monetário de preenchimento obrigatório, que identifica o montante de perdas verificadas nas posições sobre o PRIIP fechadas no semestre.

Número de Investidores associados ao montante de perdas: (Campo 10): Campo numérico de preenchimento obrigatório, que identifica o número de Investidores que fechou posições com perda no semestre.

Número de Investidores que negociaram o PRIIP durante o semestre (Campo 11): Campo numérico de preenchimento obrigatório, que identifica o número de Investidores que deteve posições abertas sobre o PRIIP durante o semestre.

Observações (Campo 12): Este campo serve para as entidades apresentarem quaisquer observações relevantes.

Reporte PRIIPS negociados em plataformas eletrónicas							
Campo	1	2	3	4	5	6	7
Identificação	Número da opção	Tipo de PRIIP	Volume negociado	Moeda	Posições fechadas com ganho	Posições fechadas com perda	Montante de ganhos
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 6 caracteres	MR FT CT SW OC OV CD ID DV TX UD OP	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	ISO 4217	Dimensão máxima: 8 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima: 8 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais

Campo	8	9	10	11	12
Identificação	Número de Investidores associado a ganhos	Montante de perdas	Número de Investidores associado a perdas	Número de Investidores que negociaram PRIIP	Observações
Domínio e	Dimensão	Dimensão	Dimensão	Dimensão	Dimensão

Dimensão	máxima de 6 caracteres numéricos	máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	máxima de 6 caracteres numéricos	máxima de 6 caracteres numéricos	máxima de 250 caracteres
-----------------	----------------------------------	---	----------------------------------	----------------------------------	--------------------------

Anexo 8

Reporte de PRIIPs com tipologia de derivados não admitidos à negociação e que não sejam comercializados em plataformas de negociação eletrónica

É enviado à CMVM um ficheiro de dados com extensão “.XML”.

Se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «GEN» e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido com o código «S», insere-se um registo por cada opção de investimento.

Quanto ao nome do ficheiro:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
8	Reporte e Derivados	Ficheiro de dados	DERNNNNNNPPPPXXXXX0AAAAMMDD.XML
		DER identifica a informação reportada, NNNNNN corresponde ao código da entidade atribuído pela CMVM, 'PPPPXXXXX' corresponde ao Código de PRIIP, de acordo com a comunicação feita pela CMVM após notificação prévia do DIF (dimensão fixa de dez caracteres), '0' algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "DER" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_DER_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação (“reporte nulo”)

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de “NULO” nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve

ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Número da opção (Campo 1): Campo de controlo que indica a ordem em que a opção de investimento surge apresentada no DIF notificado, devendo ser preenchido, para cada registo, com o número de ordem em termos sequenciais, começando no número 1, se o campo 1 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 tiver sido preenchido como “GEN” e o campo 2 do bloco de informação número 5 do Anexo 1 com o código «S»; caso contrário este campo é preenchido com ‘0’.

Tipo de derivado (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, que indica a tipologia do derivado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- MR – Contratos derivados sobre mercadorias;
- FT – Contratos de futuros;
- CT – Contratos de *forwards*;
- SW – Contratos de troca (*Swap*);
- OC – Contratos de opções de compra;
- OV – Contrato de opções de venda;
- CD – Contratos diferenciais;
- OB – Opções binárias;
- ID – Contratos derivados sobre índices financeiros ou indicadores financeiros;
- DV – Outros contratos de derivados sobre divisas;
- TX - Outros contratos de derivados sobre taxas de juro;
- UD –Outros contratos de derivados.

Volume negociado (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, que identifica o valor nominal das posições abertas durante o semestre por Investidores para negociação do PRIIP.

Moeda de referência (Campo 4): Campo que identifica a moeda de referência do montante reportado no campo 3, de acordo com a Codificação prevista na Norma ISO 4217.

Posições fechadas com ganho (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, que identifica a percentagem de posições sobre o PRIIP fechadas com ganho no semestre, relativamente ao total de posições fechadas no semestre.

Posições fechadas com perda (Campo 6): Campo de preenchimento obrigatório, que identifica a percentagem de posições sobre o PRIIP fechadas com perda no semestre, relativamente ao total de posições fechadas no semestre.

Montante de ganhos (Campo 7): Campo monetário de preenchimento obrigatório, que identifica o montante dos ganhos verificados nas posições sobre o PRIIP fechadas no semestre.

Número de Investidores associado ao montante de ganhos (Campo 8): Campo numérico de preenchimento obrigatório, que identifica o número de Investidores que fechou posições com ganho no semestre.

Montante de perdas (Campo 9): Campo monetário de preenchimento obrigatório, que identifica o montante o montante de perdas verificadas nas posições sobre o PRIIP fechadas no semestre.

Número de Investidores associados ao montante de perdas: (Campo 10): Campo numérico de preenchimento obrigatório, que identifica o número de Investidores que fechou posições com perda no semestre.

Número de Investidores que negociaram o PRIIP durante o semestre (Campo 11): Campo numérico de preenchimento obrigatório, que identifica o número de Investidores que deteve posições abertas sobre o PRIIP durante o semestre.

Observações (Campo 12): Este campo serve para as entidades apresentarem quaisquer observações relevantes.

Reporte de PRIIPs com tipologia de derivados não admitidos à negociação e que não sejam comercializados em plataformas de negociação eletrónica							
Campo	1	2	3	4	5	6	7
Identificação	Número da opção	Tipo de derivado	Volume negociado	Moeda	Posições fechadas com ganho	Posições fechadas com perda	Montante de ganhos
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 6 caracteres	MR FT CT SW OC OV CD ID DV TX UD	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	ISO 4217	Dimensão máxima: 8 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima: 8 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais

Campo	8	9	10	11	12
Identificação	Número de Investidores associado a ganhos	Montante de perdas	Número de Investidores associado a perdas	Número de Investidores que negociaram PRIIP	Observações

Domínio e Dimensão	Campo do tipo numérico	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 6 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 6 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 250 caracteres
---------------------------	------------------------	--	---	---	-----------------------------------

Anexo 9

Regras relativas à informação a prestar à CMVM durante a vigência de produtos financeiros complexos

As entidades comercializadoras enviam semestralmente à CMVM um ficheiro referente à informação referida no presente anexo até à data de maturidade do PFC, até ao 10.º dia útil seguinte ao termo do semestre, por referência ao último dia útil do semestre civil a que a informação respeita, constituído pelos seguintes Campos, quando aplicável:

Quanto ao nome do ficheiro:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
9	Informação durante a vigência dos PFC	Ficheiro de dados	A05NNNNNNPPPPXXXX0AAAAM MDD.XML
		<p>A05 identifica a informação reportada, NNNNNN corresponde ao código da entidade atribuído pela CMVM, 'PPPPXXXX' corresponde ao Código do PFC, de acordo com a comunicação feita pela CMVM (dimensão fixa de dez caracteres), '0' algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.</p>	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "A05" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_A05_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação ("reporte nulo")

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de "NULO" nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteúdoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação a prestar na vigência do PFC, com os seguintes campos:

Tipo de mercado (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o tipo de mercado de admissão à negociação do PFC. Deve ser preenchido com um dos seguintes códigos:

MER	-	Mercado regulamentado
MNR	-	Mercado não regulamentado
NAN	-	Não admitido à negociação

Mercado de admissão à negociação (Campo 2): Campo que identifica o mercado ao qual o PFC se encontra admitido, atribuído nos termos da norma ISO 10383, (código MIC), sempre que aplicável.

Preço unitário representativo (Campo 3): Campo monetário, que corresponde ao preço unitário representativo do PFC. Caso o PFC não se encontre admitido à negociação, ou caso o preço formado não seja representativo, deve ser introduzido o valor teórico calculado de acordo com metodologias tecnicamente adequadas às respetivas características. O preço representativo deverá ser aquele que melhor representa o valor do PFC à data de referência do reporte.

Preço unitário do PFC em termos percentuais (Campo 4): Campo que identifica o preço unitário do PFC em termos percentuais. Este Campo só deve ser preenchido caso não tenham sido preenchidos os campos 2 e 3.

Observações (Campo 5): Este campo serve para as entidades apresentarem quaisquer observações relevantes.

Bloco de informação número 2: Informação sobre os montantes amortizados semestralmente durante a vigência do PFC, com os seguintes campos:

Montante amortizado (Campo 1): Campo monetário que identifica o(s) montante(s) do PFC ilíquido(s) de tributação e comissionamento, amortizado(s) no período, sempre que aplicável.

Data de amortização (Campo 2): Campo do tipo data que identifica a(s) respetiva(s) data(s) de amortização no período.

Bloco de informação número 3: Informação sobre os rendimentos do PFC distribuídos semestralmente durante a sua vigência, com os seguintes campos:

Rendimento do PFC (Campo 1): Campo monetário que identifica o(s) rendimento(s) do PFC, ilíquido(s) de tributação e comissionamento, pago(s) no período sempre que aplicável.

Data de rendimento (Campo 2): Campo do tipo data que identifica a(s) respetiva(s) data(s) de rendimento no período.

Informação durante a vigência dos PFC					
Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Tipo de mercado	Mercado de admissão à negociação	Preço unitário representativo	Preço unitário do PFC em termos percentuais	Observações
Domínio e Dimensão	MER MNR NAN	ISO 10383	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 250 caracteres

Informação durante a vigência dos PFC		
Campo	1	2
Identificação	Montante amortizado	Data de amortização
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	ISO 8601

Informação durante a vigência dos PFC		
Campo	1	2
Identificação	Rendimento do PFC	Data do rendimento
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima: 16 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	ISO 8601

Anexo 10

Regras relativas à informação a prestar à CMVM no termo dos produtos financeiros complexos

As entidades emitentes, gestoras ou um seu representante legal, desde que sujeitas à supervisão da CMVM, ou as entidades comercializadoras, enviam à CMVM um ficheiro referente à informação a prestar no termo do PFC, até ao 10.º dia útil após a respetiva liquidação/extinção, constituído pelos seguintes Campos:

Quanto ao nome do ficheiro:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
10	Informação no termo dos PFC	Ficheiro de dados	A08NNNNNNPPPPPXXXX0AAAAM MDD.XML
		<p>A08 identifica a informação reportada, NNNNNN corresponde ao código da entidade atribuído pela CMVM, 'PPPPPXXXX' corresponde ao Código do PFC, de acordo com a comunicação feita pela CMVM (dimensão fixa de dez caracteres), '0' algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação.</p> <p>Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.</p>	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "A08" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_A08_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação no termo dos PFC, com os seguintes campos:

Valor unitário de reembolso (Campo 1): Campo monetário que identifica o valor unitário de reembolso do PFC.

Rendimentos pagos (Campo 2): Campo monetário que identifica o total de rendimentos pagos pelo PFC, ilíquidos de tributação e comissionamento.

Observações (Campo 3): Este campo serve para as entidades apresentarem quaisquer observações relevantes.

Bloco de informação número 2: Informação no termo dos PFC, com os seguintes campos:

Montante reembolsado (Campo 1): Campo monetário que identifica o montante líquido de tributação e comissionamento reembolsado em cada data.

Data de reembolso (Campo 2): Campo do tipo data que identifica as datas de reembolso do PFC.

Informação no termo do PFC			
Campo	1	2	3
Identificação	Valor unitário do reembolso	Rendimentos pagos	Observações
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima: 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima: 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	Dimensão máxima de 250 caracteres

Informação no termo do PFC		
Campo	1	2
Identificação	Montante reembolsado	Data do reembolso
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima: 20 caracteres numéricos, com 4 casas decimais	ISO 8601

Anexo 11

Informação Relevante de produtos financeiros complexos

As entidades emitentes, gestoras ou um seu representante legal, desde que sujeitas à supervisão da CMVM, ou as entidades comercializadoras, enviam à CMVM sempre que necessário o ficheiro UIR.

Este ficheiro refere-se à Informação Relevante do PFC e é prestada sempre que necessária, em formato PDF.

Quanto ao nome do ficheiro:

Anexo	Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
11	Informação relevante de PFC	Ficheiro de dados	UIRNNNNNNPPPPXXXXZZSAAAA MMDD.PDF
		'UIR' identifica o tipo de informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, 'PPPPXXXX' corresponde ao código do PFC, de acordo com a comunicação feita pela CMVM (dimensão fixa de dez caracteres), 'ZZ' corresponde ao código do tipo de informação relevante de acordo com a listagem infra, 'S' respeita a um número sequencial atribuído pela entidade que permita a publicação de mais do que uma IR numa mesma data, e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.	

Lista Tipo de Informação Relevante (IR):

Código	Descritivo
01	- Alteração da denominação de Fundo(s) Autónomo(s)
02	- Alteração da denominação de PFC
03	- Alteração da política de distribuição de rendimentos
04	- Alteração da política de investimento
05	- Alteração da(s) entidade(s) emitente(s), gestora(s) ou comercializadora(s)
06	- Alteração do período de comercialização
07	- Atuação do agente de cálculo
08	- Aumento/redução de capital
09	- Aumento/redução de comissões
10	- Distribuição de rendimentos
11	- Erros de valorização
12	- Exercício de direitos de voto

- 13 - Fim de comercialização de Fundo(s) Autónomo(s)
- 14 - Fusão de Fundos Autónomos
- 15 - Inclusão de Fundo(s) Autónomo(s)
- 16 - Liquidação/Extinção de Fundo Autónomo
- 17 - Liquidação/Extinção de PFC
- 18 - Prorrogação da duração do PFC
- 19 - Resultados da oferta pública de PFC
- 20 - Suspensão da comercialização do PFC e respetivos fundamentos
- 21 - Outra informação relevante

ANEXO E

(A que se refere o artigo 11.º)

ANEXO I

INFORMAÇÃO SOBRE REQUISITOS PRUDENCIAIS DAS SOCIEDADES GESTORAS DE ORGANISMOS DE INVESTIMENTO COLETIVO (SGOIC)

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte relativo aos requisitos prudenciais	Ficheiro de dados	SGONNNNNN0AAAAMMDD.XML
	SGO identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "SGO" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_SGO_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser

preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o valor líquido sob gestão das SGOIC, com os seguintes campos:

Valor líquido global dos organismos de investimento coletivo em valores mobiliários

(Campo 1): Campo que identifica o valor líquido global dos organismos de investimento coletivo em valores mobiliários (OICVM), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do Regime Geral dos Organismos de Investimento Coletivo (RGOIC).

Valor líquido global dos organismos de investimento em capital de risco (Campo 2):

Campo que identifica o valor líquido global dos organismos de investimento em capital de risco (OICR), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC.

Valor líquido global dos fundos de empreendedorismo social (Campo 3):

Campo que identifica o valor líquido global dos fundos de empreendedorismo social (FES), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC.

Valor líquido global dos organismos de investimento alternativo especializado (Campo 4):

Campo que identifica o valor líquido global dos organismos de investimento alternativo especializado (OIAE), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC.

Valor líquido global dos organismos de investimento alternativo em valores mobiliários

(Campo 5): Campo que identifica o valor líquido global dos organismos de investimento alternativo em valores mobiliários (OIAVM), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC.

Valor líquido global dos organismos de investimento imobiliário (Campo 6):

Campo que identifica o valor líquido global dos organismos de investimento imobiliário (OII), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC.

Valor líquido global dos organismos de investimento em ativos não financeiros (Campo

7): Campo que identifica o valor líquido global dos organismos de investimento em ativos não financeiros (OIANF), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC.

Valor líquido global dos fundos de titularização de créditos (Campo 8):

Campo que identifica o valor líquido global dos fundos de titularização de créditos (FTC), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC.

Valor líquido global de outros organismos de investimento coletivo (Campo 9):

Campo que identifica o valor líquido global de outros organismos de investimento coletivo previstos nas alíneas f) e g) do n.º 3 do artigo 71.º - B do RGOIC conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do referido diploma.

Campo	1	2	3	4
Identificação	VLG OICVM	VLG OICR	VLG FES	VLG OIAE
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais
5	6	7	8	9
VLG OIAVM	VLG OII	VLG OIA nF	VLG FTC	VLG outros OIC
Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 2: Informação sobre os valores de referência para o cálculo dos fundos próprios, com os seguintes campos:

Despesas gerais fixas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o montante total das despesas gerais fixas do ano anterior a que a informação respeita, conforme alínea a) do n.º 1 do artigo 71.º-M do RGOIC. Por despesas gerais fixas entendem-se as previstas no n.º 2 do artigo 34.º-B do Regulamento da (UE) n.º 241/2014.

Capital inicial (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o montante do capital inicial detido, calculado de acordo com o previsto na alínea b) do n.º 1 do artigo 2.º do RGOIC.

Garantia (Campo 3): Campo que identifica o valor da garantia prestada por instituição de crédito ou empresa de seguros com sede na União Europeia, conforme alínea c) do n.º 2 do artigo 71.º-M do RGOIC.

Campo	1	2	3
Identificação	Despesas gerais fixas	Capital inicial	Garantia
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 3: Informação sobre medidas suplementares para cobertura de risco decorrente da atividade de gestão de organismos de investimento alternativo (OIA), com os seguintes campos:

Valor do ativo dos OIA geridos (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a soma do valor absoluto de todos os ativos de todos os OIA geridos pela SGOIC, incluindo os ativos adquiridos através do recurso ao efeito de alavanca, sendo os instrumentos derivados avaliados pelo seu valor de mercado, de acordo com o previsto na alínea a) do n.º 3 do artigo 71.º - M do RGOIC.

Seguro de responsabilidade civil profissional (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a existência de seguro de responsabilidade civil profissional, de acordo com o previsto na subalínea ii) da alínea a) do n.º 3 do artigo 71.º - M do RGOIC, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “S”, caso tenha sido celebrado um seguro de responsabilidade civil profissional;
- “N”, caso não tenha sido celebrado um seguro de responsabilidade civil profissional.

Campo	1	2
Identificação	Valor das carteiras dos OIA geridos	Seguro de responsabilidade civil profissional
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	S, N

Bloco de informação número 4: Informação sobre os fundos próprios e ativos líquidos da SGOIC, com os seguintes campos:

Fundos próprios (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica os fundos próprios totais detidos pela SGOIC, calculados de acordo com a alínea v) do n.º 1 do artigo 2.º RGOIC.

Ativos líquidos (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor total de ativos líquidos detidos pela SGOIC e que preenchem as condições previstas no n.º 4 do artigo 71.º - M do RGOIC; por ativos líquidos entendem-se os previstos no n.º 1 do artigo 416.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, excluindo a condição prevista na alínea d) do n.º 3 do referido

artigo, e as disponibilidades e aplicações em outras instituições de crédito com prazo residual inferior a 30 dias ou mobilizáveis sem penalização num prazo máximo de 30 dias.

Campo	1	2
Identificação	Fundos próprios	Ativos líquidos
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

ANEXO II

INFORMAÇÃO SOBRE REQUISITOS PRUDENCIAIS DAS SOCIEDADES GESTORAS DE FUNDOS DE TITULARIZAÇÃO DE CRÉDITOS (SGFTC)

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte das SGFTC relativa aos requisitos prudenciais	Ficheiro de dados	GTCNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	GTC identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "GTC" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_GTC_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o valor líquido sob gestão das SGFTC, com os seguintes campos:

Valor líquido global dos fundos de titularização de créditos (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor líquido global dos fundos de titularização de créditos (FTC), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC, *ex vi* artigo 19.º do

Regime Jurídico da Titularização de Créditos (RJTC).

Campo	1
Identificação	VLG FTC
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 carateres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 2: Informação sobre os valores de referência para o cálculo dos fundos próprios, com os seguintes campos:

Despesas gerais fixas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o montante total das despesas gerais fixas do ano anterior a que a informação respeita, conforme alínea a) do n.º 1 do artigo 71.º-M do RGOIC, *ex vi* artigo 19.º do RJTC. Por despesas gerais fixas entendem-se as previstas no n.º 2 do artigo 34.º-B do Regulamento da (UE) n.º 241/2014.

Capital inicial (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o montante do capital inicial detido, calculado de acordo com o previsto no n.º 3 do artigo 17.º do RJTC.

Garantia (Campo 3): Campo que identifica o valor da garantia prestada por instituição de crédito ou empresa de seguros com sede na União Europeia, conforme alínea c) do n.º 2 do artigo 71.º-M do RGOIC, *ex vi* artigo 19.º do RJTC.

Campo	1	2	3
Identificação	Despesas gerais fixas	Capital inicial	Garantia
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 carateres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 carateres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 carateres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 3: Informação sobre os valores de fundos próprios e ativos líquidos da SGFTC, com os seguintes campos:

Fundos próprios (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica os fundos próprios totais detidos pela SGFTC, calculados de acordo com o previsto na alínea v), do n.º 1 do artigo 2.º do RGOIC, *ex vi* artigo 19.º do RJTC.

Ativos líquidos (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor total de ativos líquidos detidos pela SGFTC e que preenchem as condições previstas no n.º 4 do artigo 71.º-M do RGOIC, *ex vi* artigo 19.º do RJTC; por ativos líquidos entendem-se os previstos no n.º 1 do artigo 416.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, excluindo a condição prevista na alínea d) do n.º 3 do referido artigo, e as disponibilidades e aplicações em outras instituições de crédito com prazo residual inferior a 30 dias ou mobilizáveis sem penalização num prazo máximo de 30 dias.

Campo	1	2
Identificação	Fundos próprios	Ativos líquidos
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

ANEXO III

INFORMAÇÃO RELATIVA AO PLANO DE VIABILIDADE ECONÓMICA E FINANCEIRA PARA REGULARIZAÇÃO DOS REQUISITOS PRUDENCIAIS APLICÁVEIS

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do Plano de Viabilidade Económica e Financeira	Ficheiro de texto	PVENNNNNN0AAAAMMDD.PDF
	PVE identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e dia de calendário em que a CMVM foi informada do incumprimento. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

ANEXO IV

INFORMAÇÃO FINANCEIRA RELATIVA AO BALANÇO, DEMONSTRAÇÃO DOS RESULTADOS E DEMONSTRAÇÃO DO OUTRO RENDIMENTO INTEGRAL

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de Rubricas do Balanço, da Demonstração dos Resultados e da Demonstração do Outro Rendimento Integral	Ficheiro de dados	RDBNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	RDB identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "RDB" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_RDB_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre as rubricas de balanço, com os seguintes campos:

Código de conta (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de conta, sendo preenchido de acordo com o código de conta da tabela 1.

Valor de conta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o saldo da conta no final de cada período de reporte, sendo preenchido com um valor positivo para as rubricas de ativo e passivo, e com um valor positivo ou negativo para as rubricas de capital próprio.

Campo	1	2
Identificação	Código de conta	Valor de conta
Domínio e Dimensão	Código de conta da tabela 1	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Tabela 13 - Códigos de conta das rubricas de balanço

Código de Conta	Designação
BL01	Ativo total
BL02	Caixa e disponibilidades bancárias
BL03	Aplicações em instituições de crédito
BL04	Clientes
BL05	Outras contas a receber
BL06	Ativos financeiros ao justo valor através de resultados
BL07	Ativos financeiros ao justo valor através de outro rendimento integral
BL08	Ativos financeiros ao custo amortizado
BL09	Despesas com encargo diferido
BL10	Ativos por impostos correntes
BL11	Acionistas

BL12	Investimentos em subsidiárias, empreendimentos conjuntos e associadas
BL13	Ativos fixos tangíveis
BL14	Propriedades de investimento
BL15	Ativos por impostos diferidos
BL16	Ativos do fundo de pensões de benefício definido
BL17	Ativos intangíveis
BL18	Goodwill
BL19	Outros ativos
BL20	Capital próprio total
BL21	Ações ordinárias
BL22	Ações preferenciais
BL23	Capital subscrito não realizado
BL24	Ações próprias
BL25	Prémios de emissão de ações ordinárias
BL26	Prémios de emissão de ações preferenciais
BL27	Outros instrumentos de capital próprio
BL28	Reservas legais
BL29	Reserva de reavaliação
BL30	Outras reservas
BL31	Interesses minoritários
BL32	Resultados transitados
BL33	Resultado líquido do exercício
BL34	Outro rendimento integral acumulado
BL35	Outras variações no capital próprio
BL36	Passivo total
BL37	Credores e outros recursos
BL38	Adiantamento de clientes
BL39	Receitas com rendimento diferido
BL40	Passivos por impostos correntes
BL41	Acionistas
BL42	Passivos por impostos diferidos
BL43	Obrigações do fundo de pensões de benefício definido
BL44	Provisões
BL45	Passivos financeiros
BL46	Outros passivos

Bloco de informação número 2: Informação sobre as rubricas da demonstração dos resultados, com os seguintes campos:

Código de conta (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de conta, sendo preenchido de acordo com o código de conta da tabela 2.

Valor de conta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o saldo da conta no final de cada período de reporte, sendo preenchido com um valor positivo ou negativo, consoante a rubrica contribua de modo positivo ou negativo para o resultado líquido do exercício.

Campo	1	2
Identificação	Código de conta	Valor de conta
Domínio e Dimensão	Código de conta da tabela 2	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Tabela 14 - Código de conta das rubricas da demonstração dos resultados

Código de Conta	Designação
DR01	Vendas, serviços prestados e comissões
DR02	Encargos com serviços e comissões
DR03	Juros e rendimentos similares
DR04	Juros e encargos similares
DR05	Ganhos/perdas de ativos financeiros ao justo valor através de resultados
DR06	Gastos com o pessoal
DR07	Gastos gerais administrativos
DR08	Depreciações e amortizações do exercício
DR09	Perdas/reversões de imparidade de dívidas a receber
DR10	Perdas/reversões de imparidade de ativos depreciables/amortizáveis
DR11	Perdas/reversões de imparidade de outros ativos não depreciables
DR12	Aumentos/reversões de provisões
DR13	Ganhos/perdas de investimentos em subsidiárias, empreendimentos conjuntos e associadas
DR14	Outros rendimentos e ganhos
DR15	Outros gastos e perdas
DR16	Resultado antes de impostos
DR17	Imposto sobre o rendimento do exercício
DR18	Resultado líquido do exercício

Bloco de informação número 3: Informação sobre as rubricas da demonstração do outro rendimento integral, com os seguintes campos:

Código de conta (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o código de conta, sendo preenchido de acordo com o código de conta da tabela 3.

Valor de conta (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o saldo da conta no final de cada período de reporte, sendo preenchido com um valor positivo ou negativo, consoante a rubrica contribua de modo positivo ou negativo para o rendimento integral total.

Campo	1	2
Identificação	Código de conta	Valor de conta
Domínio e Dimensão	Código de conta da tabela 3	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Tabela 15 - Código de conta das rubricas da demonstração do outro rendimento integral

Código de Conta	Designação
RI01	Ganhos/perdas em ativos financeiros ao justo valor através de outro rendimento integral
RI02	Ganhos/perdas na conversão cambial
RI03	Ganhos/perdas atuariais com planos de pensões de benefício definido
RI04	Outros ganhos/perdas que contribuam para outro rendimento integral
RI05	Rendimento integral total

ANEXO V

INFORMAÇÃO RELATIVA AOS DOCUMENTOS DE PRESTAÇÃO DE CONTAS ANUAIS

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte do Relatório e Contas Anual	Ficheiro de texto	RECNNNNN0AAAAMDD.PDF
	REC identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

ANEXO VI

INFORMAÇÃO RELATIVA À CERTIFICAÇÃO LEGAL DAS CONTAS (CLC)

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte da Certificação Legal das Contas	Ficheiro de dados	CLCNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	CLC identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "CLC" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_CLC_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o conteúdo da certificação legal das contas (CLC) do relatório e contas anual, com os seguintes campos:

Tipo de opinião (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica as características da CLC, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- "SRE", para CLC sem reservas e ênfases;
- "CRE", para CLC com reservas e ênfases;
- "OCR", para CLC com reservas e sem ênfases;
- "OCE", para CLC com ênfases e sem reservas;
- "EDO", para uma escusa de opinião;
- "ADV", para uma opinião adversa.

Campo	1
--------------	----------

Identificação	Tipo de opinião
Domínio e Dimensão	SRE, CRE, OCR, OCE, EDO, ADV

Bloco de informação número 2: Informação sobre as reservas na certificação legal das contas, com os seguintes campos:

Identificação de reservas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCR”, e que identifica um número sequencial de 1 a n, sendo n o número total de reservas.

Descrição da reserva (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCR”, e que identifica o texto da reserva que consta da CLC.

Campo	1	2
Identificação	Identificação de reservas	Descrição da reserva
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 3 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos *

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 3: Informação sobre as ênfases na CLC, com os seguintes campos:

Identificação de ênfases (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCE”, e que identifica um número sequencial de 1 a n, sendo n o número total de ênfases.

Descrição da ênfase (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório quando o tipo de opinião no campo 1 do bloco de informação número 1 for preenchido com o código “CRE” ou “OCE”, e que identifica o texto da ênfase que consta da CLC.

Campo	1	2
Identificação	Identificação de ênfases	Descrição da ênfase
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 3 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos *

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 4: Informação sobre o auditor que assina a CLC, com os seguintes campos:

Número de registo do revisor oficial de contas (ROC) (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o número de registo na CMVM do ROC que assina a CLC.

Número de registo da SROC (Campo 2): Campo que identifica o número de registo na CMVM da SROC a qual pertence o revisor oficial de contas (ROC) que assina a CLC.

Campo	1	2
Identificação	Número de registo do ROC	Número de registo da SROC
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 8 caracteres numéricos	Dimensão máxima de 8 caracteres numéricos

ANEXO VII

INFORMAÇÃO SOBRE REQUISITOS PRUDENCIAIS DAS SOCIEDADES DE TITULARIZAÇÃO DE CRÉDITOS (STC)

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte das STC relativa aos requisitos prudenciais	Ficheiro de dados	STCNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	STC identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "STC" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_STC_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o valor das obrigações emitidas e não amortizadas das sociedades de titularização de créditos (STC), com os seguintes campos:

Valor das obrigações emitidas e não amortizadas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor das obrigações emitidas e não amortizadas da STC, conforme

alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC, *ex vi* artigo 19.º, *ex vi* n.º 1 do artigo 43.º, ambos do Regime Jurídico da Titularização de Créditos (RJTC).

Campo	1
Identificação	Valor das obrigações emitidas e não amortizadas
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 2: Informação sobre os valores de referência para o cálculo dos fundos próprios da STC, com os seguintes campos:

Despesas gerais fixas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o montante total das despesas gerais fixas do ano anterior a que a informação respeita, conforme alínea a) do n.º 1 do artigo 71.º - M do RGOIC, *ex vi* artigo 19.º, *ex vi* n.º 1 do artigo 43.º, ambos do RJTC. Por despesas gerais fixas entendem-se as previstas no n.º 2 do artigo 34.º-B do Regulamento da (EU) n.º 241/2014.

Capital inicial (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o montante do capital inicial detido pela STC, calculado de acordo com o previsto no n.º 3 do artigo 17.º, *ex vi* n.º 2 do artigo 40.º, ambos do RJTC.

Garantia (Campo 3): Campo que identifica o valor da garantia prestada por instituição de crédito ou empresa de seguros com sede na União Europeia, conforme alínea c) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC, *ex vi* artigo 19.º, *ex vi* n.º 1 do artigo 43.º, ambos do RJTC.

Campo	1	2	3
Identificação	Despesas gerais fixas	Capital inicial	Garantia
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 3: Informação sobre os valores de fundos próprios e ativos líquidos da STC, com os seguintes campos:

Fundos próprios (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica os fundos próprios totais detidos pela STC, calculados de acordo com o previsto na alínea v), do n.º 1 do artigo 2.º do RGOIC, *ex vi* artigo 19.º, *ex vi* n.º 1 do artigo 43.º, ambos do RJTC.

Ativos líquidos (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor total de ativos líquidos detidos pela STC e que preencham as condições previstas no n.º 4 do artigo 71.º - M do RGOIC, *ex vi* artigo 19.º, *ex vi* n.º 1 do artigo 43.º, ambos do RJTC.

Por ativos líquidos entendem-se os previstos no n.º 1 do artigo 416.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, excluindo a condição prevista na alínea d) do n.º 3 do referido artigo, e as

disponibilidades e aplicações em outras instituições de crédito com prazo residual inferior a 30 dias ou mobilizáveis sem penalização num prazo máximo de 30 dias.

Campo	1	2
Identificação	Fundos próprios	Ativos líquidos
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

ANEXO VIII

INFORMAÇÃO SOBRE REQUISITOS PRUDENCIAIS DAS SOCIEDADES GESTORAS DE FUNDOS DE CAPITAL DE RISCO (SGFCR), SOCIEDADES DE INVESTIMENTO EM CAPITAL DE RISCO (SICR) AUTOGERIDAS, E SOCIEDADES DE INVESTIMENTO ALTERNATIVO ESPECIALIZADO (SIAE) AUTOGERIDAS

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informação relativa aos requisitos prudenciais	Ficheiro de dados	GCRNNNNNN0AAAAMDD.XML
	GCR identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "GCR" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_GCR_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o valor líquido sob gestão das sociedades gestoras de fundos de capital de risco (SGFCR), sociedades de investimento em capital de risco (SICR) autogeridas, e sociedades de investimento alternativo especializado (SIAE) autogeridas, com os seguintes campos.

Valor líquido global dos organismos de investimento em capital de risco (Campo 1):

Campo que identifica o valor líquido global dos organismos de investimento em capital de risco (OICR), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º-M do Regime Geral dos Organismos de Investimento Coletivo (RGOIC), *ex vi* n.º 4 do artigo 46.º do Regime Jurídico do Capital de Risco, do Empreendedorismo Social e do Investimento Especializado (RJGRESIE).

Valor líquido global dos fundos de empreendedorismo social (Campo 2): Campo que identifica o valor líquido global dos fundos de empreendedorismo social (FES), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC, *ex vi* n.º 4 do artigo 46.º do RJGRESIE.

Valor líquido global dos organismos de investimento alternativo especializado (Campo 3): Campo que identifica o valor líquido global dos organismos de investimento alternativo especializado (OIAE), conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC, *ex vi* n.º 4 do artigo 46.º do RJGRESIE.

Valor líquido global de outros organismos de investimento coletivo (Campo 4): Campo que identifica o valor líquido global de outros organismos de investimento coletivo, conforme alínea d) do n.º 2 do artigo 71.º - M do RGOIC, *ex vi* n.º 4 do artigo 46.º do RJGRESIE.

Campo	1	2	3	4
Identificação	VLG OICR	VLG FES	VLG OIAE	VLG outros OIC
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 2: Informação sobre os valores de referência para o cálculo dos fundos próprios das SGFCR, das SIAE autogeridas ou das SICR autogeridas, com os seguintes campos:

Despesas gerais fixas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o montante total das despesas gerais fixas do ano anterior a que a informação respeita, conforme alínea a) do n.º 1 do artigo 71.º- M do RGOIC, *ex vi* n.º 4 do artigo 46.º do RJGRESIE. Por despesas gerais fixas entendem-se as previstas no n.º 2 do artigo 34.º-B do Regulamento da (EU) n.º 241/2014.

Capital inicial (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o montante do capital inicial detido pela SGFCR, SIAE autogerida ou SICR autogerida, calculado de acordo com o previsto na alínea b) do n.º 1 do artigo 2.º do RGOIC, *ex vi* n.º 5 do artigo 2.º do RJGRESIE.

Garantia (Campo 3): Campo que identifica o valor da garantia prestada por instituição de crédito ou empresa de seguros com sede na União Europeia, conforme alínea c) do n.º 2 do artigo 71.º-M do RGOIC, *ex vi* n.º 4 do artigo 46.º do RJGRESIE.

Campo	1	2	3
Identificação	Despesas gerais fixas	Capital inicial	Garantia
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 3: Informação sobre medidas suplementares para cobertura de risco decorrente da atividade de gestão de organismos de investimento alternativo (OIA), com os seguintes campos:

Valor do ativo dos OIA geridos (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a soma do valor absoluto de todos os ativos de todos os OIA geridos pela SGFCR, SIAE autogerida ou SICR autogerida, incluindo os ativos adquiridos através do recurso ao efeito de alavanca, sendo os instrumentos derivados avaliados pelo seu valor de mercado, de acordo com o previsto na alínea a) do n.º 3 do artigo 71.º-M do RGOIC, *ex vi* n.º 4 do artigo 46.º do RJCRESIE.

Seguro de responsabilidade civil profissional (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica a existência de seguro de responsabilidade civil profissional, de acordo com o previsto na subalínea ii) da alínea a) do n.º 3 do artigo 71.º-M do RGOIC, *ex vi* n.º 4 do artigo 46.º do RJCRESIE, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “S”, caso tenha sido celebrado um seguro de responsabilidade civil profissional;
- “N”, caso não tenha sido celebrado um seguro de responsabilidade civil profissional.

Campo	1	2
Identificação	Valor das carteiras dos OIA geridos	Seguro de responsabilidade civil profissional
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	S, N

Bloco de informação número 4: Informação sobre os fundos próprios e ativos líquidos das SGFCR, das SIAE autogeridas e das SICR autogeridas, com os seguintes campos:

Fundos próprios (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica os fundos próprios totais detidos pela SGFCR, SIAE autogerida ou SICR autogerida, calculados de acordo com a alínea v) do n.º 1 do artigo 2.º RGOIC, *ex vi* n.º 5 do artigo 2.º do RJCRESIE.

Ativos líquidos (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor total de ativos líquidos detidos pela SGFCR, SIAE autogerida ou SICR autogerida e que preencham as condições previstas no n.º 4 do artigo 71.º-M do RGOIC, *ex vi* n.º 4 do artigo 46.º do RJCRESIE; por ativos líquidos entendem-se os previstos no n.º 1 do artigo 416.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, excluindo a condição prevista na alínea d) do n.º 3 do referido artigo, e as

disponibilidades e aplicações em outras instituições de crédito com prazo residual inferior a 30 dias ou mobilizáveis sem penalização num prazo máximo de 30 dias.

Campo	1	2
Identificação	Fundos próprios	Ativos líquidos
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

ANEXO IX

INFORMAÇÃO SOBRE REQUISITOS PRUDENCIAIS DAS SOCIEDADES DE CAPITAL DE RISCO (SCR) E DAS SOCIEDADES DE EMPREENDEDORISMO SOCIAL (SES)

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informação relativa aos requisitos prudenciais	Ficheiro de dados	SCRNNNNNN0AAAAMDD.XML
	SCR identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carater fixo e 'AAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "SCR" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_SCR_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o elemento **identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o valor líquido sob gestão das sociedades de capital de risco (SCR) e sociedades de empreendedorismo social (SES), com os seguintes campos:

Valor líquido global dos fundos de capital de risco (Campo 1): Campo que identifica o valor líquido global dos fundos de capital de risco (FCR), conforme alínea nn) do n.º 1 do artigo 2 do Regime Geral dos Organismos de Investimento Coletivo (RGOIC), ex vi n.º 5 do artigo 2.º do

Regime Jurídico do Capital de Risco, do Empreendedorismo Social e do Investimento Especializado (RJCRESIE).

Valor líquido global dos fundos de empreendedorismo social (Campo 2): Campo que identifica o valor líquido global dos fundos de empreendedorismo social (FES), conforme alínea nn) do n.º 1 do artigo 2.º do RGOIC, *ex vi* n.º 5 do artigo 2.º do RJCRESIE.

Valor líquido global dos fundos de investimento alternativo especializado (Campo 2): Campo que identifica o valor líquido global dos fundos de investimento alternativo especializado (FIAE), conforme alínea nn) do n.º 1 do artigo 2.º do RGOIC, *ex vi* n.º 5 do artigo 2.º do RJCRESIE.

Valor líquido global de outros organismos de investimento coletivo (Campo 3): Campo que identifica o valor líquido global de outros organismos de investimento coletivo, conforme alínea nn) do n.º 1 do artigo 2.º do RGOIC, *ex vi* n.º 5 do artigo 2.º do RJCRESIE.

Campo	1	2	3	4
Identificação	VLG FCR	VLG FES	VLG FIAE	VLG outros OIC
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 2: Informação sobre os valores de referência para o cálculo dos fundos próprios das SCR e SES, com os seguintes campos:

Capital social (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o montante do capital social realizado.

Garantia (Campo 2): Campo que identifica o valor da garantia prestada por instituição de crédito ou empresa de seguros com sede na União Europeia, conforme alínea n.º 2 do artigo 12.º do RJCRESIE.

Campo	1	2
Identificação	Capital social	Garantia
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Bloco de informação número 3: Informação sobre os fundos próprios e ativos líquidos das SCR e SES, com os seguintes campos:

Fundos próprios (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório que identifica os fundos próprios totais detidos pela SCR e SES, calculados de acordo com a alínea v) do n.º 1 do artigo 2.º RGOIC, *ex vi* n.º 5 do artigo 2.º do RJCRESIE.

Ativos líquidos (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório que identifica o valor total de ativos líquidos detidos pela SCR e SES.

Por ativos líquidos entendem-se os previstos no n.º 1 do artigo 416.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, excluindo a condição prevista na alínea d) do n.º 3 do referido artigo, e as disponibilidades e aplicações em outras instituições de crédito com prazo residual inferior a 30 dias ou mobilizáveis sem penalização num prazo máximo de 30 dias.

Campo	1	2
Identificação	Fundos próprios	Ativos líquidos
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

ANEXO F
(A que se refere o artigo 13.º)

Anexo
Reporte de atividade de perito avaliador de imóveis registado na CMVM

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do Ficheiro	
Prestação de informação por perito avaliador de imóveis	Ficheiro de dados	PAINNNNNN0AAAAMDD.XML
	PAI identifica a informação prestada, 'NNNNNN' corresponde ao número de entidade atribuído pela CMVM, '0' algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD', correspondem, respetivamente ao ano, mês e dia do exercício económico a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "PAI" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_PAI_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM.

Opção de reporte com conteúdo

No conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre os elementos da atividade, com os seguintes campos:

Número de avaliações de imóveis efetuadas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, com o número de avaliações efetuadas, ou seja, avaliações faturadas até 31 de dezembro de cada ano. No caso de unidades de milhar, o formato não inclui separação das unidades.

Montante global dos imóveis avaliados (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, com o montante global dos imóveis avaliados (em €). O formato não inclui referência à moeda nem separação das unidades de milhar.

Montante total de faturação dos serviços de avaliação de imóveis (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, com as importâncias faturadas a clientes respeitantes a serviços de avaliação de imóveis (em €, sem IVA), ou seja, avaliações concluídas, entregues e faturadas até 31 de dezembro de cada ano. O formato não inclui referência à moeda nem separação das unidades de milhar.

Percentagem do montante faturado referente a serviços de avaliação de imóveis em relação ao total de faturação dos serviços prestados (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, com o valor percentual de 0 a 100 correspondente à percentagem do montante faturado em serviços de avaliação de imóveis em relação ao total de faturação dos serviços prestados (sem IVA).

Percentagem do montante faturado referente a serviços de avaliação de imóveis à principal entidade contratante em relação ao montante total de faturação dos serviços de avaliação de imóveis (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, com o valor percentual de 0 a 100 correspondente à percentagem do montante faturado em serviços de avaliação de imóveis em relação ao total de faturação dos serviços prestados (sem IVA).

Número de reclamações recebidas (Campo 6): Campo de preenchimento obrigatório, com o número de reclamações recebidas.

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Número de avaliações de imóveis efetuadas	Montante global dos imóveis avaliados	Montante total de faturação dos serviços de avaliação de imóveis	Percentagem do montante faturado referente a serviços de avaliação de imóveis em relação ao total de faturação dos serviços prestados	Percentagem do montante faturado referente a serviços de avaliação de imóveis à principal entidade contratante em relação ao montante total de faturação dos serviços de avaliação de imóveis	Número de reclamações recebidas
Domínio e dimensão	Dimensão máxima: 10 caracteres numéricos	Dimensão máxima: 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima: 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima: 3 caracteres numéricos	Dimensão máxima: 3 caracteres numéricos	Dimensão máxima: 10 caracteres numéricos

Bloco de informação número 2: Informação sobre os tipos de ativos avaliados, com os seguintes campos:

Tipo de ativos avaliados (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, com os códigos que são atribuídos de acordo com a seguinte tabela de correspondências, segundo o uso dominante dos imóveis:

Código	Tipo de ativos avaliados	Definição
1	Ativos habitacionais	Parte ou totalidade de um edifício constituída por um ou mais compartimentos destinados à habitação (inclui edifícios multifamiliares, frações habitacionais em edifícios, edifícios unifamiliares).
2	Ativos de escritório/serviços	Parte ou totalidade de um edifício constituída por um ou mais compartimentos destinados ao uso de escritórios/serviços.
3	Ativos de retalho	Estabelecimentos afetos ao uso de comércio (inclui lojas de rua, centros comerciais, galerias comerciais, <i>retail parks</i> , <i>outlets</i> e <i>stand-alones</i>).
4	Ativos industriais e/ou logísticos	Imóveis afetos ao uso industrial e/ou logístico (inclui unidades fabris, armazéns, centros e plataformas logísticas).
5	Ativos mistos	Todos os imóveis sem uso predominante.
6	Empreendimentos turísticos	Consideram-se empreendimentos turísticos os estabelecimentos que se destinam a prestar serviços de alojamento, mediante remuneração, dispondo, para o seu funcionamento, de um adequado conjunto de estruturas, equipamentos e serviços complementares (cf. artigo 2.º/1 do Decreto-Lei 39/2008 de 7 de março que aprova o Regime Jurídico da Instalação, Exploração e Funcionamento dos Empreendimentos Turísticos). Inclui estabelecimentos hoteleiros (hotéis, hotéis-apartamentos, pousadas), aldeamentos turísticos, apartamentos turísticos, conjuntos turísticos (resorts), empreendimentos de turismo de habitação, empreendimentos de turismo no espaço rural (casas de campo, agroturismo, hotéis rurais), parques de campismo e caravanismo (cf. artigo 4.º do mesmo diploma legal).
7	Equipamentos coletivos	Edificações e espaços não edificados afetos à provisão de bens e serviços destinados à satisfação das necessidades coletivas dos cidadãos (cf. Ficha n.º 25 do Quadro 2 do Decreto Regulamentar n.º 9/2009, de 29 de maio). Inclui educação, saúde, sociais, administrativos, justiça, segurança social, segurança pública, proteção civil, desportivos, culturais, culto, etc.

8	Terrenos urbanos	Solo que está total ou parcialmente urbanizado ou edificado e como tal, afeto em plano territorial à urbanização ou edificação (cf. artigo 10.º, n.º 2, alínea b) da Lei n.º 31/2014, de 30 de maio).
9	Terrenos rústicos	Solo que pela sua reconhecida aptidão, se destine, nomeadamente, ao aproveitamento agrícola, pecuário, florestal, à conservação, valorização e exploração de recursos naturais, de recursos geológicos ou de recursos energéticos, assim como o que se destina a espaços naturais, culturais, de turismo, recreio e lazer ou à proteção de riscos, ainda que seja ocupado por infraestruturas e aquele que não seja classificado como urbano (cf. artigo 10.º, n.º 2, alínea a) da Lei n.º 31/2014, de 30 de maio)
10	Terrenos mistos	Terrenos com componente urbana e rústica nos termos supra definidos.
11	Outros	Todos os ativos que não se integrem nas categorias de ativos acima.

Montante global dos imóveis avaliados por tipo de ativo (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, com o montante global dos imóveis avaliados em correspondência com o tipo de ativos (em €). O formato não inclui referência à moeda nem separação das unidades de milhar.

Número de avaliações (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, com o número de avaliações em correspondência com o tipo de ativos.

Campo	1	2	3
Identificação	Tipo de ativos avaliados	Montante global dos imóveis avaliados por tipo de ativo	Número de avaliações
Domínio e dimensão	1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 11	Dimensão máxima: 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima: 10 caracteres numéricos

Bloco de informação número 3: Informação sobre o tipo de entidade contratante dos serviços de avaliação de imóveis, com os seguintes campos:

Entidade responsável (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, com os códigos do tipo de entidade contratante dos serviços de avaliação de imóveis.

Código	Tipo de entidade
1	Empresas de investimento
2	Instituição de crédito
3	Organismos de investimento imobiliário «OII»
4	Organismos de investimento alternativo em capital de risco, em empreendedorismo social ou especializado «OIA»
5	Sociedades gestoras de organismos de investimento coletivo «SGOIC» ou Sociedades de investimento coletivo autogeridas «SIC»
6	Sociedades gestoras de capital de risco «SCR», Sociedade Gestoras de Fundos de Capital de Risco «SGFCR» ou Sociedades de Investimento em Capital de Risco «SICR»
7	Sociedades de Titularização de Créditos «STC» ou Sociedade Gestora de Fundos de Titularização de Créditos «SGFTC»
8	Outras sociedades financeiras
9	Sociedade gestora de fundos de pensões
10	Empresa de seguros ou de resseguros
11	Gestoras de plataformas de financiamento colaborativo «Crowdfunding»

Montante global dos imóveis avaliados por tipo de entidade contratante dos serviços de avaliação (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, com o montante global dos imóveis avaliados por tipo de entidade contratante dos serviços (em €). O formato não inclui referência à moeda nem separação das unidades de milhar.

Número de avaliações (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, com o número de avaliações por tipo de entidade.

Campo	1	2	3
Identificação	Entidade responsável	Montante global dos imóveis avaliados por tipo de entidade contratante dos serviços de avaliação	Número de avaliações
Domínio e dimensão	1 2 3 4	Dimensão máxima: 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima:

	5 6 7 8 9 10 11		10 caracteres numéricos
--	-----------------------------------	--	----------------------------

Bloco de informação número 4: Informação sobre os distritos e regiões autónomas onde foram prestados os serviços de avaliação imobiliária, com os seguintes campos:

Distritos e regiões autónomas (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, com os códigos relativos aos distritos e regiões autónomas.

Código	Distritos e regiões autónomas
1	Aveiro
2	Beja
3	Braga
4	Bragança
5	Castelo Branco
6	Coimbra
7	Évora
8	Faro
9	Guarda
10	Leiria
11	Lisboa
12	Portalegre
13	Porto
14	Santarém
15	Setúbal
16	Viana do Castelo
17	Vila Real
18	Viseu
19	Madeira
20	Açores

Montante global dos imóveis avaliados por distrito e região autónoma (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, com o montante global dos imóveis avaliados por distrito e região autónoma (em €). O formato não inclui referência à moeda nem separação das unidades de milhar.

Número de avaliações (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, com o número de avaliações por distrito e região autónoma.

Campo	1	2	3
Identificação	Distritos e regiões autónomas	Montante global dos imóveis avaliados por tipo de entidade contratante dos serviços de avaliação	Número de avaliações
Domínio e dimensão	1 2 3 4 5 6 7 8 9 10 11 12 13 14 15 16 17 18 19 20	Dimensão máxima: 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima: 10 caracteres numéricos

Bloco de informação número 5: Informação dos peritos avaliadores de imóveis pessoas coletivas sobre a atividade dos peritos avaliadores de imóveis pessoas singulares que lhe prestaram serviços de avaliação imobiliária, com os seguintes campos. A informação a reportar corresponde ao valor atribuído aos imóveis pelo perito avaliador de imóveis pessoa singular que realizou a avaliação antes de uma eventual revisão por outro(s) perito(s).

Número de registo (Campo 1): Campo de preenchimento obrigatório, com o número de registo junto da CMVM do perito avaliador de imóveis pessoa singular que prestou serviços de avaliação imobiliária ao perito avaliador de imóveis pessoa coletiva.

Número de avaliações (Campo 2): Campo de preenchimento obrigatório, com o número de avaliações, faturadas até 31 de dezembro, pelo perito avaliador de imóveis pessoa singular. No caso de unidades de milhar, o formato não inclui separação das unidades.

Montante global dos imóveis avaliados (Campo 3): Campo de preenchimento obrigatório, com o montante global dos imóveis avaliados (em €) por perito avaliador de imóveis pessoa singular. O formato não inclui referência à moeda nem separação das unidades de milhar.

Início da prestação de serviços (Campo 4): Campo de preenchimento obrigatório, com o mês e ano, com o formato 'MMAAAA', referentes ao início da prestação dos serviços pelo perito avaliador de imóveis pessoa singular ao perito avaliador de imóveis pessoa coletiva.

Fim da prestação de serviços (Campo 5): Campo de preenchimento obrigatório, com o mês e ano, com o formato 'MMAAAA', referentes ao fim da prestação dos serviços pelo perito avaliador de imóveis pessoa singular ao perito avaliador de imóveis pessoa coletiva. Se, até 31 de dezembro do ano a que refere a informação, não tenha ocorrido o fim da prestação de serviços, o campo é preenchido com 'NA'.

Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Número de registo	Número de avaliações	Montante global dos imóveis	Início da prestação de serviços	Fim da prestação de serviços
Domínio e dimensão	Campo alfanumérico de dimensão fixa: 13 caracteres	Dimensão máxima: 10 caracteres numéricos	Dimensão máxima: 20 caracteres, com 2 casas decimais	Campo numérico de dimensão fixa: 6 caracteres	Campo numérico de dimensão fixa: 6 caracteres, NA

Inexistência de informação a reportar:

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, os peritos avaliadores de imóveis que não tenham faturado serviços de avaliação, enviam à CMVM uma comunicação eletrónica com as seguintes especificidades:

- O assunto da comunicação é composto pelo número de registo junto da CMVM, a palavra "NULO" e o ano a que a informação faz referência, sem separadores entre si; e
- O corpo da comunicação não é preenchido.

ANEXO G

(A que se refere o artigo 17.º)

Anexo IV – Receção, transmissão e execução de ordens por conta de outrem

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de receção, transmissão e execução de ordens por conta de outrem	Ficheiro de dados	RTENNNNNN0AAAAMMDD.XML
	RTE identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "RTE" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_RTE_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação ("reporte nulo")

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de "NULO" nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre as atividades de receção e transmissão de ordens por conta de outrem e de execução de ordens por conta de outrem sobre instrumentos financeiros, com os seguintes campos:

Tipo de investidor (Campo 1): Campo que identifica o tipo de investidor que transmitiu a ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- "NP", se for investidor não profissional;
- "PR", se for investidor profissional;
- "CE", se for contraparte elegível.

Residência do investidor (Campo 2): Campo que identifica a residência do investidor que transmitiu a ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “R”, para investidores residentes em Portugal e emigrantes portugueses;
- “N”, para outros investidores.

Canal de receção da ordem (Campo 3): Campo que identifica o tipo de canal de receção da ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “I”, para ordens recebidas através de sítio da Internet disponibilizado para o efeito;
- “E”, para ordens recebidas por outros meios eletrónicos de comunicação à distância, nomeadamente terminais que permitam a receção de ordens;
- “R”, para ordens provenientes de meios de reencaminhamento automático que façam interface com sistemas de outros intermediários financeiros (*order routing*);
- “T”, para ordens recebidas através de telefone, presencialmente nas instalações do intermediário financeiro ou por fax;
- “O”, para ordens recebidas através de outros canais.

Tipo de instrumento financeiro (Campo 4): Campo que identifica a tipologia do instrumento financeiro a que se refere a ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo;
- “EF”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (*ETF*);
- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT” para contratos de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;
- “OV”, para contratos de opções de venda;
- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (*CFD*);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);
- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados.

Tipo de subjacente (Campo 5): Campo que identifica a tipologia do subjacente do instrumento financeiro derivado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NA”, quando o instrumento financeiro do campo anterior for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”;
- “AC”, para ações;
- “IN”, para índices;
- “TJ”, para taxas de juro;
- “TC”, para taxas de câmbio;
- “CR”, para crédito;
- “MC”, para mercadorias e licenças de emissão;
- “OT”, para outros subjacentes não especificados anteriormente.

Tipo de ordem (Campo 6): Campo que identifica o tipo de ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “C”, para ordens de compra;
- “V”, para ordens de venda.

Montante (Campo 7): Campo que identifica o montante de instrumentos financeiros das ordens executadas, sendo preenchido com:

- Montante efetivamente pago ou recebido pela realização da transação, excluindo-se os juros corridos no caso de instrumentos de dívida emitidos pelo Estado, entes públicos ou entidades privadas, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 4 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”;
- Montante correspondente ao produto entre o número de contratos negociados, a unidade de negociação dos mesmos e o respetivo preço da transação, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 4 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “CT”, “OC”, “OV”, “CD”, “SW” ou “OD”.

Local de Execução (Campo 8): Campo que identifica o local onde ocorreu a execução da ordem, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code (MIC)*, nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as ordens executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada;
- “OECP”, para as ordens executadas fora de plataformas de negociação e contra a carteira própria do intermediário financeiro (internalização);

- “OEFM”, para as ordens executadas fora de plataformas de negociação e em que o intermediário financeiro, isento de risco, intermedia o encontro entre a ordem do comprador e a do vendedor.

Caracterização da ordem (Campo 9): Campo que caracteriza a ordem recebida, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “T”, para as ordens transmitidas pelo intermediário financeiro que recebeu a ordem;
- “E”, para as ordens executadas pelo intermediário financeiro que recebeu a ordem.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Identificação	Tipo de investidor	Residência do investidor	Canal de receção da ordem	Tipo de instrumento financeiro	Tipo de subjacente	Tipo de ordem	Montante	Local de execução	Caracterização da ordem
Domínio e Dimensão	NP, PR, CE	R, N	I, E, R, T, O	AC, UP, EF, DU, PC, DI, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, OD	NA, AC, IN, TJ, TC, CR, MC, OT	C, V	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	MIC Code, OECP, OEFM	T, E

Bloco de informação número 2: Informação sobre o detalhe dos instrumentos financeiros objeto das atividades de receção e transmissão de ordens por conta de outrem e execução de ordens por conta de outrem, com os seguintes campos:

Código do instrumento financeiro (Campo 1): Campo que identifica o código do instrumento financeiro transacionado, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number* (ISIN), nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável;
- Não existindo ISIN, o *Classification of Financial Instruments* (CFI), nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Tipo de código do instrumento financeiro (Campo 2): Campo que identifica o tipo de código do instrumento financeiro transacionado, sendo preenchido com:

- “I”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código ISIN;
- “C”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código CFI.

Designação do instrumento financeiro (Campo 3): Campo que identifica a designação do instrumento financeiro.

Mercado de admissão (Campo 4): Campo que identifica o mercado onde o instrumento financeiro está admitido à negociação, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code* (MIC), nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as ordens executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.
Deve ser preenchido com o MIC Code do primeiro mercado onde o instrumento financeiro foi admitido à negociação. Caso exista mais do que um mercado nestas circunstâncias, deve ser considerado o mercado mais líquido.
- “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos em plataformas de negociação.

Tipo de instrumento financeiro (Campo 5): Campo que identifica a tipologia do instrumento financeiro a que se refere a ordem, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo não admitidos à negociação;
- “EF”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (*ETF*);
- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT” para contratos de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;
- “OV”, para contratos de opções de venda;
- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (*CFD*);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);
- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados.

Tipo de subjacente (Campo 6): Campo que identifica a tipologia do subjacente do instrumento financeiro derivado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NA”, quando o instrumento financeiro do campo 5 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”;
- “AC”, para ações;

- “IN”, para índices;
- “TJ”, para taxas de juro;
- “TC”, para taxas de câmbio;
- “CR”, para crédito;
- “MC”, para mercadorias e licenças de emissão;
- “OT”, para outros subjacentes não especificados anteriormente.

Tipo de ordem (Campo 7): Campo que identifica o tipo de ordem recebida pelo intermediário financeiro, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “C”, para ordens de compra;
- “V”, para ordens de venda.

Quantidade (Campo 8): Campo identifica a quantidade transacionada de ordens executadas, sendo preenchido com:

- Número de unidades, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 5 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF” ou “ON”;
- Valor nominal, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 5 for preenchido com um dos seguintes códigos: “DU”, “PC”, “DI”, “SW” ou “ON”;
- Número de contratos, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 5 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “CT”, “OC”, “OV”, “CD”, “SW” ou “OD”.

Montante (Campo 9): Campo que identifica o montante de instrumentos financeiros das ordens executadas, sendo preenchido com o:

- Montante efetivamente pago ou recebido pela realização da transação, excluindo-se os juros corridos no caso de instrumentos de dívida emitidos pelo Estado, entes públicos ou entidades privadas, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 5 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”;
- Montante correspondente ao produto entre o número de contratos negociados, a unidade de negociação dos mesmos e o respetivo preço da transação, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 5 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “CT”, “OC”, “OV”, “CD”, “SW” ou “OD”.

Local de execução (Campo 10): Campo que identifica o local onde ocorreu a execução da ordem e deve ser preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code (MIC)*, nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as ordens executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada
- “OECP”, para as ordens executadas fora de plataformas de negociação e contra a carteira própria do intermediário financeiro (internalização)
- “OEFM”, para as ordens executadas fora de plataformas de negociação e em que o intermediário financeiro, isento de risco, intermedia o encontro entre a ordem do comprador e a do vendedor

Caracterização da ordem (Campo 11): Campo que caracteriza a ordem recebida, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “T”, para as ordens transmitidas pelo intermediário financeiro que recebeu a ordem;
- “E”, para as ordens executadas pelo intermediário financeiro que recebeu a ordem.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
Identificação	Código do instrumento financeiro	Tipo de código do instrumento financeiro	Designação do instrumento financeiro	Mercado de Admissão	Tipo de instrumento financeiro	Tipo de subjacente	Tipo de Ordem	Quantidade	Montante	Local de Execução	Caraterização da ordem
Domínio e Dimensão	ISIN, CFI code	I, C	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*	MIC code, XXXX	AC, UP, EF, DU, PC, DI, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, OD	NA, AC, IN, TJ, TC, CR, MC, OT	C, V	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	MIC code, OECP, OEFM	T, E

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Anexo V – Gestão de carteiras por conta de outrem

Especificidades relativas aos reportes previstos nos ficheiros CCG, GCO e OPR

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
	Ficheiro de dados	CCGNNNNNN0AAAAMMDD.XML

Reporte de informação sobre o perfil das carteiras sob gestão	CCG identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.
--	---

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "CCG" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_CCG_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação ("reporte nulo")

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de "NULO" nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre o perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes, com os seguintes campos:

Código de identificação de perfil de carteira (Campo 1): Campo que identifica, de forma unívoca, o código do perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes. É preenchido com um código interno definido pela entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem e é repetido nos reportes subsequentes enquanto este perfil estiver em vigor. Caso se trate de um perfil de carteira que não se enquadre em qualquer dos perfis padronizados é preenchido com o código "PNP".

Designação de perfil de carteira (Campo 2): Denominação do perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes. Caso o campo 1 tenha sido preenchido com o código "PNP", este campo deve ser preenchido com a seguinte designação "Perfil não padronizado".

Número de carteiras individuais sob gestão (Campo 3): Campo que informa sobre o número de

carteiras individuais sob gestão por conta de outrem para cada perfil de carteira à data de referência do reporte.

Montante global sob gestão (Campo 4): Campo que informa sobre o montante global sob gestão para cada perfil de carteira à data de referência do reporte. O montante é preenchido em euro.

Objetivo de referência ou de rentabilidade (Campo 5): Campo que informa sobre o objetivo definido para cada perfil de carteira.

Este campo é preenchido com um dos seguintes códigos:

- “B”, se o perfil de carteira identificar um objetivo de referência;
- “R”, se o perfil de carteira identificar um objetivo de rentabilidade;
- “NA” caso não esteja definido objetivo ou caso o campo 1 tenha sido preenchido com o código “PNP”.

Descrição do objetivo do perfil de carteira (Campo 6): Campo que descreve o objetivo do perfil de carteira.

Este campo é preenchido com:

- Descrição do objetivo de referência do perfil de carteira se o campo 5 tiver sido preenchido com “B”. Caso o objetivo de referência do perfil da carteira corresponda a um composto de vários índices, cada um com uma determinada ponderação, deverá ser identificada a ponderação associada a cada um dos índices.
- Quantificação do objetivo de rentabilidade do perfil de carteira se o campo 5 tiver sido preenchido com “R”.
- “NA” caso não esteja definido objetivo ou caso o campo 1 tenha sido preenchido com o código “PNP”.

Instrumentos financeiros derivados (Campo 7): Campo que informa se o perfil de carteira pode incluir posições em instrumentos financeiros derivados ou transações com passivos contingentes.

Este campo é preenchido com um dos seguintes códigos:

- “PC” se o perfil da carteira admitir a inclusão de passivos contingentes;
- “DR” se o perfil da carteira admitir a inclusão de instrumentos financeiros derivados;

- “PD” se o perfil de carteira admitir a inclusão de passivos contingentes e instrumentos financeiros derivados;
- “NA” se o perfil de carteira não admitir passivos contingentes nem instrumentos financeiros derivados ou caso o campo 1 tenha sido preenchido com o código “PNP”.

Caraterização de moeda (Campo 8): Campo que informa se o perfil de carteira inclui exposição a moedas diferentes do euro.

Este campo é preenchido com um dos seguintes códigos:

- “S”, se o perfil de carteira admitir a exposição a moedas diferentes do euro;
- “N”, se o perfil de carteira não admitir a exposição a moedas diferentes do euro;
- “NA” se não houver critério em relação à admissão de moedas diferentes do euro ou caso o campo 1 tenha sido preenchido com o código “PNP”.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8
Identificação	Código de identificação de perfil de carteira	Designação de perfil de carteira	Número de carteiras individuais sob gestão	Montante global sob gestão	Objetivo de referência ou de rentabilidade	Descrição do objetivo do perfil de carteira	Instrumentos financeiros derivados	Caraterização de moeda
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 200 caracteres alfanuméricos* ou PNP	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos*	Dimensão máxima de 10 caracteres numéricos	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	B, R, NA	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos, NA	PC, DR, PD, NA	S, N, NA

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Bloco de informação número 2: Informação sobre os limites referentes ao perfil de carteira indicado no campo 1 do bloco de informação número 1, de acordo com o definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes, com os seguintes campos. Caso o campo 1 do bloco de informação número 1 tenha sido preenchido com o código “PNP” este bloco de informação não é incluído.

Código de identificação de perfil de carteira (Campo 1): Campo que identifica, de forma unívoca, o código do perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes. É preenchido com um código interno definido pela entidade

que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem e é repetido nos reportes subsequentes enquanto este perfil estiver em vigor. Devem ser utilizados os mesmos códigos utilizados para o preenchimento do campo 1 do bloco de informação número 1.

Limite mínimo de exposição a ações/similares (Campo 2): Campo que informa sobre o limite inferior, para cada perfil de carteira, referente a ações, fundos de ações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a ações. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite máximo de exposição a ações/similares (Campo 3): Campo que informa sobre o limite superior, para cada perfil de carteira, referente a ações, fundos de ações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a ações. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite mínimo de exposição a obrigações/similares (Campo 4): Campo que informa sobre o limite inferior, para cada perfil de carteira, referente a obrigações, fundos de obrigações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a risco de crédito e de taxa de juro. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite máximo de exposição a obrigações/similares (Campo 5): Campo que informa sobre o limite superior, para cada perfil de carteira, referente a obrigações, fundos de obrigações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a risco de crédito e de taxa de juro. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite mínimo de exposição a ativos líquidos (Campo 6): Campo que informa sobre o limite inferior, para cada perfil de carteira, referente a depósitos à ordem e a prazo e outros instrumentos financeiros de dívida de curto prazo. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite máximo de exposição a ativos líquidos (Campo 7): Campo que informa sobre o limite superior, para cada perfil de carteira, referente a depósitos à ordem e a prazo e outros instrumentos financeiros de dívida de curto prazo. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite mínimo de exposição a outros ativos (Campo 8): Campo que informa sobre o limite inferior, para cada perfil de carteira, referente a ativos com exposição ao mercado imobiliário ou outros ativos reais. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Limite máximo de exposição a outros ativos (Campo 9): Campo que informa sobre o limite superior, para cada perfil de carteira, referente a ativos com exposição ao mercado imobiliário ou outros ativos reais. Deve ser preenchido com o valor percentual correspondente à exposição da carteira a esta categoria de ativo. Caso não esteja definido limite, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Identificação	Código de identificação de perfil de carteira	Limite mínimo ações/similares	Limite máximo ações/similares	Limite mínimo obrigações/similares	Limite máximo obrigações/similares	Limite mínimo ativos líquidos	Limite máximo ativos líquidos	Limite mínimo outros ativos	Limite máximo outros ativos
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 200 caracteres alfanuméricos* ou PNP	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!” e “?”.

Bloco de informação número 3: Informação sobre critérios de elegibilidade/restrições aplicáveis ao perfil de carteira indicado no campo 1 do bloco de informação número 1, de acordo com o definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes, com os seguintes campos. Caso o campo 1 do bloco de informação número 1 tenha sido preenchido com o código “PNP” este bloco de informação não é incluído.

Código de identificação de perfil de carteira (Campo 1): Campo que identifica, de forma unívoca, o código do perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes. É preenchido com um código interno definido pela entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem e é repetido nos reportes subsequentes enquanto este perfil estiver em vigor. Devem ser utilizados os mesmos códigos utilizados para o preenchimento do campo 1 do bloco de informação número 1.

Caraterização de notação de risco (Campo 2): Campo que informa sobre critérios de elegibilidade para cada perfil de carteira, relativas à notação de risco dos emitentes dos respetivos

ativos elegíveis. Caso não sejam aplicados critérios de elegibilidade/ restrições, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Caraterização de área geográfica (Campo 3): Campo que informa sobre critérios de elegibilidade para cada perfil de carteira, relativas a áreas geográficas de localização dos emitentes dos respetivos ativos elegíveis. Caso não sejam aplicados critérios de elegibilidade/ restrições, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Caraterização de sector (Campo 4): Campo que informa sobre critérios de elegibilidade para cada perfil de carteira, relativas aos sectores dos emitentes dos respetivos ativos elegíveis. Caso não sejam aplicados critérios de elegibilidade/ restrições, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Campo	1	2	3	4
Identificação	Código de identificação de perfil de carteira	Caraterização de notação de risco	Caraterização de área geográfica	Caraterização de sector
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 200 caracteres alfanuméricos* ou PNP	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos, NA	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos, NA	Dimensão máxima de 2000 caracteres alfanuméricos, NA

* Não são permitidos os caracteres “ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de informação sobre as carteiras sob gestão	Ficheiro de dados	GCONNNNNN0AAAAMMDD.XML
	GCO identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "GCO" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_GCO_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação (“reporte nulo”)

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de “NULO” nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Código de identificação de perfil de carteira (Campo 1): Campo que identifica, de forma unívoca, o código do perfil de carteira definido nos contratos de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrados com os clientes. É preenchido com um código interno definido pela entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem e é repetido nos reportes subsequentes enquanto este perfil estiver em vigor. Devem ser utilizados os mesmos códigos utilizados para o preenchimento do campo 1 do bloco de informação número 1 do ficheiro CCG.

Tipo de ativo (Campo 2): Campo que identifica a tipologia dos ativos, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo não admitidas à negociação;
- “EF”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (*ETF*);
- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT”, para contratos de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;

- “OV”, para contratos de opções de venda;
- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (*CFD*);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);
- “WR”, para *warrants*;
- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados;
- “UL”, para *unit linked*;
- “DO”, para depósitos à ordem correntes;
- “CM” para depósitos associados a contas margem;
- “DP”, para depósitos a prazo;
- “OT”, para outros ativos.

Tipo de subjacente (Campo 3): Campo que identifica a tipologia do subjacente do instrumento financeiro derivado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NA”, quando o ativo do campo anterior for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI”, “ON”, “UL”, “DO”, “DP” ou “OT”;
- “AC”, para ações;
- “IN”, para índices;
- “TJ”, para taxas de juro;
- “TC”, para taxas de câmbio;
- “CR”, para crédito;
- “MC”, para mercadorias e licenças de emissão;
- “OT”, para outros subjacentes não especificados anteriormente.

Código do ativo que integra a carteira sob gestão (Campo 4): Campo que identifica o código do ativo, sendo preenchido com:

Para instrumentos financeiros:

- O *International Standard Identification Number* (ISIN), nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável.
- Não existindo ISIN, o *Classification of Financial Instruments* (CFI), nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Para outros ativos que não sejam instrumentos financeiros, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Tipo de código do ativo que integra a carteira sob gestão (Campo 5): Campo que identifica o tipo de código do ativo, sendo preenchido com:

Para instrumentos financeiros:

- “I”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código ISIN;
- “C”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código CFI.

Para outros ativos que não sejam instrumentos financeiros, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Mercado de admissão (Campo 6): Campo que identifica o mercado onde o instrumento financeiro está admitido à negociação, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code* (MIC), nos termos definidos na Norma ISO 10383, para instrumentos financeiros admitidos à negociação em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.

Deve ser preenchido com o MIC Code do primeiro mercado onde o instrumento financeiro foi admitido à negociação. Caso exista mais do que um mercado nestas circunstâncias, deve ser considerado o mercado mais líquido.

- “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos à negociação em plataforma de negociação.

Para outros ativos não sejam instrumentos financeiros, este campo deve ser preenchido com “NA”.

Designação do ativo que integra a carteira sob gestão (Campo 7): Campo relativo à designação do ativo.

Moeda (Campo 8): Campo que identifica a moeda em que o preço dos ativos originariamente se encontram expressos, sendo preenchido nos termos da norma ISO 4217.

Quantidade/Valor nominal (Campo 9): Campo que identifica a quantidade ou valor nominal de cada ativo.

Preço unitário (Campo 10): Campo que é preenchido com valor unitário do ativo em carteira na moeda em que se encontra expresso ou em percentagem quando se trate de um instrumento representativo de dívida.

Indicação de preço unitário (Campo 11): Campo preenchido com “V”, caso o campo anterior tenha sido preenchido com valor, “P”, caso tenha sido preenchido em percentagem.

Montante sob gestão (Campo 12): Campo que identifica o valor sob gestão, expresso em euros.

Exposição (Campo 13): Campo que identifica a exposição inerente aos instrumentos financeiros derivados, expresso em euros. As posições vendedoras deverão ser precedidas de sinal negativo.

Caraterização dos ativos em função da exposição da carteira (Campo 14): Campo que caracteriza o ativo em função da exposição, de acordo com o referido no bloco de informação número 2 do ficheiro CCG, sendo preenchido com:

- “AC”, para ações, fundos de ações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a ações;
- “OB”, para obrigações, fundos de obrigações, *unit linked* ou outros ativos com exposição a risco de crédito e de taxa de juro;
- “LQ”, depósitos à ordem e a prazo e outros instrumentos financeiros de dívida de curto prazo;
- “AR”, ativos com exposição ao mercado imobiliário ou outros ativos reais;
- “OU” ativos com outras exposições.

Tipo de investidor (Campo 15): Campo que identifica o tipo de investidor que corresponde ao primeiro titular da carteira individual sob gestão, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NP”, se for investidor não profissional;
- “PR”, se for investidor profissional;
- “CE”, se for contraparte elegível.

Notação de risco da emissão ou do emitente (Campo 16): Campo que é preenchido com:

- A notação de risco da emissão do título de dívida, ou na sua inexistência, notação do risco do emitente à data da carteira, atribuído por agências internacionalmente reconhecidas. No caso da existência de duas ou mais notações, corresponde à notação mais baixa.
- “NA”, no caso de inexistência de notação de risco da emissão ou do emitente.

Tipo de notação de risco (Campo 17): Campo que é preenchido com:

- “O”, se o campo anterior tiver sido preenchido com notação de risco da emissão;
- “E”, se o campo anterior tiver sido preenchido com notação de risco do emitente;
- “NA”, se o campo anterior tiver sido preenchido com “NA”.

País do emitente (Campo 18): Campo que identifica o país do emitente do instrumento financeiro. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Código do emitente (Campo 19): Campo que identifica o código LEI do emitente, sendo preenchido com nos termos da norma ISO 17442, apenas quando aplicável. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Descrição do emitente (Campo 20): Campo que identifica o nome ou denominação do emitente do instrumento financeiro. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8
Identificação	Identificação de perfil de carteira	Tipo de ativo	Tipo de subjacente	Código do ativo que integra a carteira sob gestão	Tipo de código do ativo que integra a carteira sob gestão	Mercado de admissão	Designação do ativo que integra a carteira sob gestão	Moeda
Domínio e Dimensão	Dimensão máxima de 200 caracteres alfanuméricos* ou PNP	AC, DU, PC, DI, UP, EF, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, WR, OD, UL, DO, DP, OT	NA, AC, IN, TJ, TC, CR, MC, OT	ISIN, CFI, NA	I, C, NA	MIC Code, XXXX, NA	Dimensão máxima de 200 caracteres alfanuméricos	ISO Code

* Não são permitidos os caracteres “ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

Campo	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
-------	---	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----	----

Identificação	Quantidade / valor nominal	Preço unitário	Indicação do preço unitário	Montante sob gestão	Exposição	Caraterização dos ativos em função da exposição da carteira	Tipo de investidor	Notação de risco da emissão ou do emitente	Tipo de notação de risco	País do emitente	Código do emitente	Descrição do emitente
Domínio e Dimensão	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	V, P	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	AC, OB, LQ, AR, OU	NP, PR, CE	Dimensão máxima de 4 caracteres alfanuméricos*, NA	O, E, NA	Dimensão máxima de 2 caracteres alfanuméricos*, NA	Código LEI, NA	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*, NA

* Não são permitidos os caracteres “'”, “*”, “!” e “?”.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de operações das carteiras sob gestão	Ficheiro de dados	OPRNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	OPR identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "OPR" a enviar à CMVM constam do documento "2020_reporte_OPR_schemas.zip" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação (“reporte nulo”)

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de “NULO” nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Data da operação (Campo 1): Campo que identifica a data da operação, nos termos da norma ISO 8601, verificada nas carteiras sob gestão. Deve ser preenchido para todos os dias do período de referência em que se verificaram operações com impacto nas carteiras sob gestão, agregando todas as operações de determinado dia.

Tipo de operação (Campo 2): Campo que identifica o tipo de operação verificada, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “C”, para aquisições e outras operações similares, incluindo subscrições de OIC;
- “V”, para alienações e outras operações similares, incluindo resgates de OIC;
- “L” para levantamento de ativos e/ou numerário;
- “D”, para reforços de ativos e/ou numerário.

Código da origem da operação (Campo 3): Campo que identifica a origem da operação verificada na carteira sob gestão, sendo preenchido com:

- “GC”, para operações com origem no contrato de gestão de carteiras e/ou condições particulares celebrado com o cliente decididos pelo gestor;
- “OV”, para operações com origem em ordens vinculativas transmitidas pelo cliente.

Código do instrumento financeiro objeto da operação (Campo 4): Campo que identifica o código do instrumento financeiro objeto da operação, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number* (ISIN), nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável.
- Não existindo ISIN, o *Classification of Financial Instruments* (CFI), nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Para operações sobre outros ativos que não sejam instrumentos financeiros, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Tipo de código do instrumento financeiro objeto da operação (Campo 5): Campo que identifica o tipo de código do instrumento financeiro objeto da operação identificado no campo 4, sendo preenchido com:

- “I”, quando o código de instrumento financeiro no campo 4 for preenchido com um código ISIN;

- “C”, quando o código de instrumento financeiro no campo 4 for preenchido com um código CFI.

Se o campo 4 tiver sido preenchido com “NA”, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Tipo de ativo (Campo 6): Campo que identifica a tipologia dos ativos, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo não admitidas à negociação;
- “EF”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (*ETF*);
- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT”, para contratos de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;
- “OV”, para contratos de opções de venda;
- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (*CFD*);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);
- “WR”, para *warrants*;
- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados;
- “UL”, para *unit linked*;
- “DO”, para depósitos à ordem correntes;
- “CM”, para depósitos associados a contas margem;

- “DP”, para depósitos a prazo;
- “OT”, para outros ativos.

Mercado de admissão (Campo 7): Campo que identifica o mercado onde o instrumento financeiro identificado no campo 4 está admitido à negociação, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code* (MIC), nos termos definidos na Norma ISO 10383, para instrumentos financeiros admitidos à negociação em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.

Deve ser preenchido com o MIC Code do primeiro mercado onde o instrumento financeiro foi admitido à negociação. Caso exista mais do que um mercado nestas circunstâncias, deve ser considerado o mercado mais líquido.

- “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos à negociação em plataforma de negociação.

Se o campo 4 tiver sido preenchido com “NA”, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Local de Execução (Campo 8): Campo que identifica o local onde ocorreu a operação sobre o instrumento financeiro identificado no campo 4, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code* (MIC), nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as transações executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.
- “OECF”, para as operações executadas fora de plataformas de negociação e contra a carteira própria da entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem (internalização).
- “OEFM”, para as operações executadas fora de plataformas de negociação e em que a entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem, isenta de risco, intermedia o encontro entre a ordem do comprador e a do vendedor, não sendo ambos clientes da atividade de gestão de carteiras por conta de outrem.
- “OEGC”, para as operações executadas fora de plataformas de negociação e em que a entidade que presta a atividade de gestão de carteiras por conta de outrem, isenta de risco, intermedia o encontro entre a ordem do comprador e a do vendedor, sendo ambos clientes da atividade de gestão de carteiras por conta de outrem.

Este campo apenas deve ser preenchido se o campo 2 tiver sido preenchido com o código “C” ou “V”.

Para outros ativos/operações, este campo deve ser preenchido com “NA”.

Código LEI da entidade que executou a transação (Campo 9): Campo que identifica o código LEI da entidade que executou a operação ou efetuou a subscrição ou resgate sobre o instrumento financeiro identificado no campo 4.

Este campo apenas deve ser preenchido se o campo 2 foi preenchido com o código “C” ou “V”.

Para outros ativos/ operações, este campo deve ser preenchido com “NA”.

Quantidade (Campo 10): Campo que identifica a quantidade do ativo transacionado na operação, se aplicável. Este campo deve ser preenchido com “NA” se o campo 2 tiver sido preenchido com os códigos “L” e “D”.

Não havendo ativos envolvidos na operação, este campo deve ser preenchido com “NA”.

Preço unitário médio (Campo 11): Campo que é preenchido com o preço unitário médio do ativo objeto da operação, sendo preenchido em valor, na moeda da operação, ou em percentagem, Este campo deve ser preenchido com “NA” se o campo 2 tiver sido preenchido com os códigos “L” e “D”.

Indicação de preço unitário médio (Campo 12): Campo preenchido com “V”, caso o campo anterior tenha sido preenchido com valor, “P”, caso tenha sido preenchido em percentagem. Este campo deve ser preenchido com “NA” se o campo 2 tiver sido preenchido com os códigos “L” e “D”.

Moeda (Campo 13): Campo que identifica a moeda da operação.

Montante (Campo 14): Campo que identifica o montante de cada operação, incluindo juros corridos se aplicável, expresso na moeda da operação.

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Data de operação	Tipo de operação	Código de origem de operação	Código do instrumento financeiro	Tipo de código do instrumento financeiro	Tipo de ativo
Domínio e Dimensão	ISO 8601	C, V, L, D	GC, OV	ISIN, CFI, NA	I, C, NA	AC, DU, PC, DI, UP, EF, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, WR, OD, UL, DO, DP, OT

Campo	7	8	9	10	11	12	13	14
-------	---	---	---	----	----	----	----	----

Identificação	Mercado de admissão	Local de Execução	Código LEI da entidade que executou a transação	Quantidade	Preço unitário médio	Indicação do preço unitário	Moeda	Montante
Domínio e Dimensão	MIC Code, XXXX, NA	MIC Code, OECP, OEFM, NA	Código LEI, NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais NA	20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais, NA	V, P, NA	ISO 4217	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

Anexo VI – Negociação por conta própria

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte da negociação por conta própria	Ficheiro de dados	NPRNNNNNN0AAAAMDD.XML
	NPR identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um caracter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro devem estar preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "NPR" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_NPR_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação ("reporte nulo")

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de "NULO" nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Bloco de informação número 1: Informação sobre a atividade de negociação por conta própria de instrumentos financeiros, com os seguintes campos:

Tipo de carteira (Campo 1): Campo que identifica o tipo da carteira do intermediário financeiro em função da finalidade subjacente à transação do instrumento financeiro, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “CN”, para transações contabilizadas na carteira de negociação e quando os instrumentos financeiros transacionados sejam para beneficiar a curto-prazo de diferenças entre o preço de compra e venda.
- “CR”, para transações contabilizadas na carteira de negociação e quando os instrumentos financeiros transacionados sejam para cobertura de risco.
- “MM”, para as transações realizadas no âmbito de contrato de fomento de mercado ou estabilização de preços, *i.e.*, transações de *market making*.
- “CI”, para transações contabilizadas na carteira de investimento.

Código do instrumento financeiro (Campo 2): Campo que identifica o código do instrumento financeiro transacionado, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number* (ISIN), nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável;
- Não existindo ISIN, o *Classification of Financial Instruments* (CFI), nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Tipo de código do instrumento financeiro (Campo 3): Campo que identifica o tipo de código do instrumento financeiro transacionado, sendo preenchido com:

- “I”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código ISIN
- “C”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código CFI

Designação do instrumento financeiro (Campo 4): Campo que identifica a designação do instrumento financeiro.

Mercado de admissão (Campo 5): Campo que identifica o mercado onde o instrumento financeiro está admitido à negociação, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code* (MIC), nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as ordens executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.
Deve ser preenchido com o MIC Code do primeiro mercado onde o instrumento financeiro foi admitido à negociação. Caso exista mais do que um mercado nestas circunstâncias, deve ser considerado o mercado mais líquido.
- “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos em plataformas de negociação.

Tipo de instrumento financeiro (Campo 6): Campo que identifica a tipologia do instrumento financeiro e deve ser preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo não admitidas à negociação;
- “EF” para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (*ETF*);
- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT” para contrato de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;
- “OV”, para contratos de opções de venda;
- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (*CFD*);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);
- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados.

Tipo de subjacente (Campo 7): Campo que identifica a tipologia do subjacente do instrumento financeiro derivado e deve ser preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NA”, quando o instrumento financeiro do campo 6 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”;
- “AC”, para ações;
- “IN”, para índices;
- “TJ”, para taxas de juro;

- “TC”, para taxas de câmbio;
- “CR”, para crédito;
- “MC”, para mercadorias e licenças de emissão;
- “OT”, para outros subjacentes não especificados anteriormente.

Tipo de Transação (Campo 8): Campo que identifica o tipo de transação, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “C”, para transações de compra;
- “V”, para transações de venda.

Quantidade (Campo 9): Campo que identifica a quantidade transacionada, sendo preenchido com:

- Número de unidades, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 6 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF” ou “ON”;
- Valor nominal, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 6 for preenchido com um dos seguintes códigos: “DU”, “PC”, “DI”, “SW” ou “ON”;
- Número de contratos, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 6 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “CT”, “OC”, “OV”, “CD”, “SW” ou “OD”.

Montante (Campo 10): Campo que identifica o montante das transações, sendo preenchido com:

- Montante efetivamente pago ou recebido pela realização da transação, excluindo-se os juros corridos no caso de instrumentos de dívida emitidos pelo Estado, entes públicos ou entidades privadas, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 6 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”.
- Montante correspondente ao produto entre o número de contratos negociados, a unidade de negociação dos mesmos e a respetiva cotação, quando a tipologia do instrumento financeiro no campo 6 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “CT”, “OC”, “OV”, “CD”, “SW” ou “OD”.

Local de Transação (Campo 11): Campo que identifica o local onde ocorreu a transação, sendo preenchido com:

- O respetivo *Market Identifier Code (MIC)*, nos termos definidos na Norma ISO 10383, para as transações executadas em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.

- “OECP”, para as transações não executadas em plataformas de negociação e executadas contra a carteira de clientes (internalização).
- “OEFM”, para as transações não executadas em plataformas de negociação e executadas contra a carteira de contrapartes não clientes do intermediário financeiro

Campo	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
Identificação	Tipo de carteira	Código do instrumento financeiro	Tipo código do instrumento financeiro	Designação do instrumento financeiro	Mercado de admissão	Tipo de instrumento financeiro	Tipo de subjacente	Tipo de Transação	Quantidade	Montante	Local de Transação
Domínio e Dimensão	CN, CR, MM, CI	ISIN, CFI code	I, C	Dimensão máxima de 40 caracteres alfanuméricos*	MIC code, XXXX	AC, UP, EF, DU, PC, DI, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, OD	NA, AC, IN, TJ, TC, CR, MC, OT	C, V	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	MIC code, OECP, OEFM

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

ANEXO VII

INFORMAÇÃO RELATIVA AO REGISTO E DEPÓSITO DE INSTRUMENTOS FINANCEIROS POR CONTA DE OUTREM

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de Informação relativa ao registo e depósito por conta de outrem	Ficheiro de dados	RCONNNNNN0AAAAMDD.XML
	RCO identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "RCO" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_RCO_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação (“reporte nulo”)

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de “NULO” nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação “REPO” e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Código do instrumento financeiro (Campo 1): Campo que identifica o código do instrumento financeiro, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number (ISIN)*, nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável;
- Não existindo ISIN, o *Classification of Financial Instruments (CFI)*, nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Tipo de código do instrumento financeiro (Campo 2): Campo que identifica o tipo de código do instrumento financeiro, sendo preenchido com:

- “I”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código ISIN;
- “C”, quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código CFI.

Designação do instrumento financeiro (Campo 3): Campo que identifica a designação do instrumento financeiro.

Mercado de admissão (Campo 4): Campo que identifica o mercado onde o instrumento financeiro está admitido à negociação, sendo preenchido com:

- O *Market Identifier Code (MIC)*, nos termos definidos na Norma ISO 10383, para instrumentos financeiros admitidos em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada. Deve ser preenchido com o MIC Code do primeiro mercado onde o instrumento financeiro foi admitido à negociação. Caso exista mais do que um mercado nestas circunstâncias, deve ser considerado o mercado mais líquido.
- “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos à negociação em plataformas de

negociação.

Central de valores mobiliários (Campo 5): Campo que identifica o código LEI da central de valores mobiliários onde estão integrados os instrumentos financeiros, sendo preenchido apenas quando aplicável. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Código do emitente (Campo 6): Campo que identifica o código LEI do emitente, sendo preenchido apenas quando aplicável. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Descrição do emitente (Campo 7): Campo que identifica a denominação do emitente. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

País do emitente (Campo 8): Campo que identifica o país do emitente. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Tipo de instrumento financeiro (Campo 9): Campo que identifica a tipologia do instrumento financeiro, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo não admitidas à negociação;
- “EF”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (ETF);
- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT”, para contrato de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;
- “OV”, para contratos de opções de venda;
- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (CFD);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);
- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados;

Tipo de subjacente (Campo 10): Campo que identifica a tipologia do subjacente do instrumento financeiro derivado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NA”, quando o tipo de instrumento financeiro do campo 9 for preenchido com um dos

seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”;

- “AC”, para ações;
- “IN”, para índices;
- “TJ”, para taxas de juro;
- “TC”, para taxas de câmbio;
- “CR”, para crédito;
- “MC”, para mercadorias e licenças de emissão;
- “OT”, para outros subjacentes não especificados anteriormente.

Residência do titular (Campo 11): Campo que identifica a residência do primeiro titular da conta dos instrumentos financeiros e deve ser preenchido com um dos seguintes códigos:

- “R”, para titulares residentes;
- “N”, para titulares não residentes.

Tipo de titular (Campo 12): Campo que identifica o tipo do primeiro titular da conta dos instrumentos financeiros, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NP”, se for investidor não profissional;
- “PR”, se for investidor profissional;
- “CE”, se for contraparte elegível.

Quantidade (Campo 13): Campo que identifica a quantidade de instrumentos financeiros, sendo preenchido com:

- Número de unidades, quando o tipo de instrumento financeiro do campo 9 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF” ou “ON”;
- Valor nominal, quando o tipo de instrumento financeiro do campo 9 for preenchido com um dos seguintes códigos: “DU”, “PC”, “DI”, “ON” ou “SW”;
- Número de contratos, quando o tipo de instrumento financeiro do campo 9 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “CT”, “OC”, “OV”, “CD”, “SW” ou “OD”.

Posições abertas (Campo 14): Campo que identifica a posição bruta do contrato, sendo preenchido com:

- “C” para posições compradoras e “V” para posições vendedoras, quando o tipo de instrumento financeiro do campo 9 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “OC”, “OV”, “CD” ou “OD”.
- “NA” nos restantes casos.

Montante (Campo 15): Campo que identifica o montante dos instrumentos financeiros, em euros,

sendo calculado de acordo com o previsto no n.º 4 do artigo 2.º do Regulamento da CMVM n.º 2/2000.

Campo	1	2	3	4	5
Identificação	Código	Tipo código	Designação	Mercado admissão	Central VM
Domínio e Dimensão	ISO 6166, ISO 10962	I, C	Dimensão máxima de 200 caracteres*	ISO 10383, XXXX	ISO 17442, NA

6	7	8	9	10
Código emitente	Descrição emitente	País emitente	Tipo instrumento financeiro	Tipo subjacente
ISO 17442, NA	Dimensão máxima de 200 caracteres*, NA	ISO 3166, NA	AC, UP, EF, DU, PC, DI, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, OD	NA, AC, IN, TJ, TC, CR, MC, OT

11	12	13	14	15
Residência titular	Tipo Titular	Quantidade	Posições abertas	Montante
R, N	NP, PR, CE	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	C, V, NA	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres " ", " * ",

ANEXO VIII – INFORMAÇÃO RELATIVA AO REGISTO E DEPÓSITO DE INSTRUMENTOS FINANCEIROS DA CARTEIRA PRÓPRIA

O presente Anexo é preenchido nos termos do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.

Quanto ao nome do ficheiro:

Conteúdo	Nomenclatura do ficheiro	
Reporte de Informação relativa ao registo e depósito da carteira própria	Ficheiro de dados	RCPNNNNNN0AAAAMMDD.XML
	RCP identifica a informação reportada, 'NNNNNN' corresponde ao código de entidade atribuído pela CMVM, '0' o algarismo que corresponde a um carácter fixo e 'AAAA', 'MM', 'DD' correspondem, respetivamente, ao ano, mês e último dia de calendário do mês a que respeita a informação. Todos os caracteres do nome do ficheiro são preenchidos.	

Quanto à estrutura e conteúdo do ficheiro de dados:

As especificações técnicas relativas ao ficheiro "RCP" a enviar à CMVM constam do documento "**2020_reporte_RCP_schemas.zip**" ou em versões atualizadas do mesmo, disponível no sítio da internet da CMVM."

I. Opção de reporte perante inexistência de informação ("reporte nulo")

Na inexistência de informação a enviar para determinado período de referência, o presente ficheiro é enviado à CMVM com a indicação de "NULO" nos elementos **ConteudoReporte** do cabeçalho e no **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro.

Nesta circunstância todos os restantes elementos do corpo do ficheiro não devem ter conteúdo.

II. Opção de reporte com conteúdo

Existindo conteúdo a reportar o elemento **ConteudoReporte** do cabeçalho deve conter a indicação "REPO" e o **elemento identificador de reporte nulo** do corpo do ficheiro não deve ser preenchido, sendo preenchidos os restantes elementos do corpo do ficheiro de acordo com as instruções infra.

Código do instrumento financeiro (Campo 1): Campo que identifica o código do instrumento financeiro, sendo preenchido com:

- O *International Standard Identification Number (ISIN)*, nos termos definidos na Norma ISO 6166, sempre que aplicável.
- Não existindo ISIN, a *Classification of Financial Instruments (CFI)*, nos termos definidos na Norma ISO 10962.

Tipo de código do instrumento financeiro (Campo 2): Campo que identifica o tipo de código do instrumento financeiro, sendo preenchido com:

- "I", quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código ISIN;
- "C", quando o código de instrumento financeiro no campo anterior for preenchido com um código CFI.

Designação do instrumento financeiro (Campo 3): Campo que identifica a designação do instrumento financeiro.

Mercado de admissão (Campo 4): Campo que identifica o mercado onde o instrumento financeiro está admitido à negociação, sendo preenchido com:

- O *Market Identifier Code (MIC)*, nos termos definidos na Norma ISO 10383, para instrumentos financeiros admitidos em mercado regulamentado, em sistema de negociação multilateral ou em sistema de negociação organizada.

Deve ser preenchido com o MIC Code do primeiro mercado onde o instrumento financeiro foi admitido à negociação. Caso exista mais do que um mercado nestas circunstâncias, deve ser considerado o mercado mais líquido.

- “XXXX”, para instrumentos financeiros não admitidos à negociação em plataformas de negociação.

Central de valores mobiliários (Campo 5): Campo que identifica o código LEI da central de valores mobiliários onde estão integrados os instrumentos financeiros, sendo preenchido apenas quando aplicável. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Código do emitente (Campo 6): Campo que identifica o código LEI do emitente, sendo preenchido apenas quando aplicável. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Descrição do emitente (Campo 7): Campo que identifica a denominação do emitente. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

País do emitente (Campo 8): Campo que identifica o país do emitente. Caso não seja aplicável, este campo deverá ser preenchido com “NA”.

Tipo de instrumento financeiro (Campo 9): Campo que identifica a tipologia do instrumento financeiro, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “AC”, para ações;
- “UP”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo não admitidas à negociação;
- “EF”, para unidades de participação em organismos de investimento coletivo admitidas à negociação (ETF);
- “DU”, para instrumentos de dívida emitidos pelo Estado ou outros entes públicos e equiparados;
- “PC”, para papel comercial;
- “DI”, para outros instrumentos de dívida emitidos por entidades privadas;
- “ON”, para outros instrumentos financeiros não derivados;
- “FT”, para contratos de futuros;
- “CT”, para contrato de *forward*;
- “OC”, para contratos de opções de compra;
- “OV”, para contratos de opções de venda;
- “CD”, para contratos financeiros por diferenças (CFD);
- “SW”, para contratos de troca (*Swap*);

- “OD”, para outros instrumentos financeiros derivados.

Tipo de subjacente (Campo 10): Campo que identifica a tipologia do subjacente do instrumento financeiro derivado, sendo preenchido com um dos seguintes códigos:

- “NA”, quando o tipo de instrumento financeiro do campo 9 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF”, “DU”, “PC”, “DI” ou “ON”;
- “AC”, para ações;
- “IN”, para índices;
- “TJ”, para taxas de juro;
- “TC”, para taxas de câmbio;
- “CR”, para crédito;
- “MC”, para mercadorias e licenças de emissão;
- “OT”, para outros subjacentes não especificados anteriormente.

Quantidade (Campo 11): Campo que identifica a quantidade de instrumentos financeiros, sendo preenchido com:

- Número de unidades, quando o tipo de instrumento financeiro do campo 9 for preenchido com um dos seguintes códigos: “AC”, “UP”, “EF” ou “ON”;
- Valor nominal, quando o tipo de instrumento financeiro do campo 9 for preenchido com um dos seguintes códigos: “DU”, “PC”, “DI”, “ON” ou “SW”;
- Número de contratos, quando o tipo de instrumento financeiro do campo 9 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “OC”, “CT”, “OV”, “CD”, “SW” ou “OD”.

Posições abertas (Campo 12): Campo que identifica a posição bruta do contrato, sendo preenchido com:

- “C” para posições compradoras e “V” para posições vendedoras, quando o tipo de instrumento financeiro do campo 9 for preenchido com um dos seguintes códigos: “FT”, “OC”, “OV”, “CD” ou “OD”.
- “NA” nos restantes casos.

Montante (Campo 13): Campo que identifica o montante dos instrumentos financeiros, em euros, sendo preenchido com o montante apurado com base no plano contabilístico adotado.

Campo	1	2	3	4	5	6
Identificação	Código	Tipo código	Designação	Mercado admissão	Central VM	Código emitente
Domínio e Dimensão	ISO 6166,	I, C	Dimensão máxima de 200 caracteres*	ISO 10383, XXXX	ISO 17442, NA	ISO 17442, NA

	ISO 10962				
--	--------------	--	--	--	--

7	8	9	10	11	12	13
Descrição emitente	País emitente	Tipo instrumento financeiro	Tipo subjacente	Quantidade	Posições abertas	Montante
Dimensão máxima de 200 caracteres*, NA	ISO 3166, NA	AC, UP, EF, DU, PC, DI, ON, FT, CT, OC, OV, CD, SW, OD	NA, AC, IN, TJ, TC, CR, MC, OT	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais	C, V, NA	Dimensão máxima de 20 caracteres numéricos, com 2 casas decimais

* Não são permitidos os caracteres “ ’ ”, “ * ”, “ ! ” e “ ? ”.

ANEXO H

(A que se refere o artigo 15.º)

Anexo I

Elementos de informação a constar do cabeçalho para efeitos de controlo de reporte:

ElementoXML	Min-Max	Formato	Descrição	Regras preenchimento
CodigoEntidade	[1-1]	Alfanumérico com X posições	Código de entidade de acordo com registo na CMVM	
DataReferencia	[1-1]	Data	Data de reporte	Deve ser posterior a data de fim de período
DataInicioPeriodo	[1-1]	Data	Data de início de período de reporte	Deve ser inferior a data de fim de período
DataFimPeriodo	[1-1]	Data	Data de fim de período de reporte	Deve ser posterior a data de início de período
Conteudoreporte	[1-1]	Alfabético com 4 posições	Identifica reporte com conteúdo ou nulo	“NULO” quando não exista matéria a reportar ou “REPO” quando exista conteúdo a reportar

