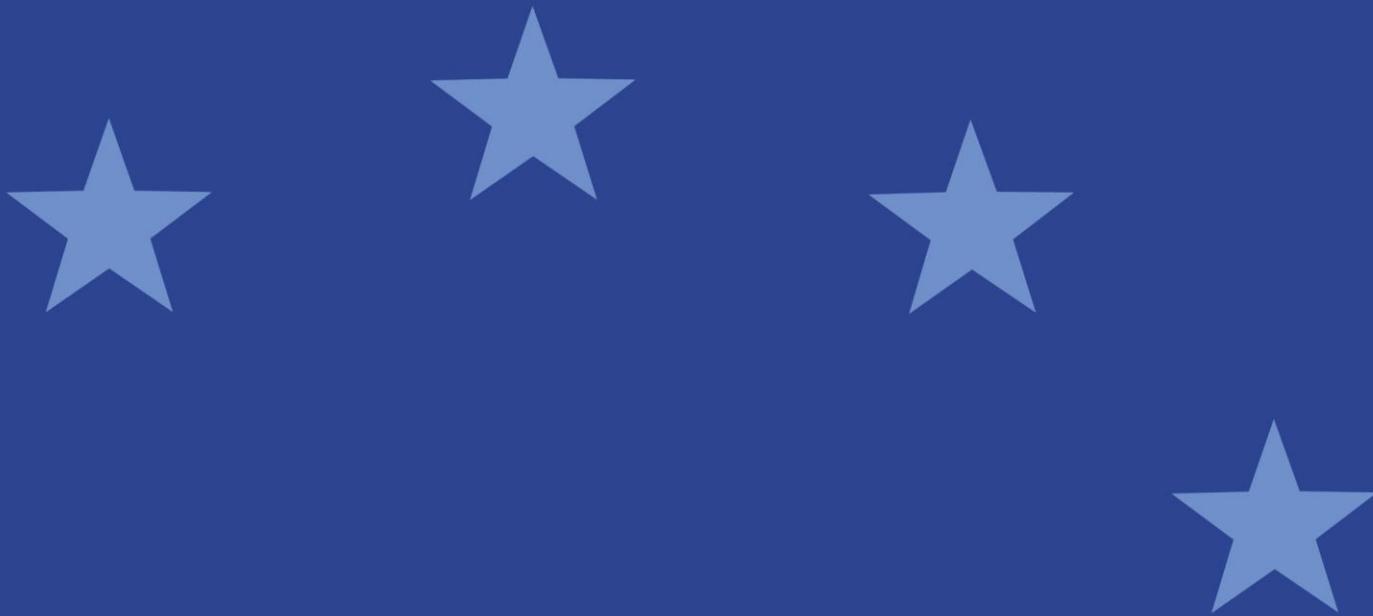




European Securities and
Markets Authority

Orientações

sobre transferência de dados entre Repositórios de Transações



Índice

1	Âmbito de aplicação	3
2	Glossário de conceitos e termos	4
3	Lista de Acrónimos.....	5
4	Objetivo.....	6
5	Conformidade.....	7
6	Orientações.....	7
7	Anexo I – Procedimento para a transferência de dados por solicitação do TR participante 12	
8	Anexo II - Procedimento para migração no caso de revogação do registo	14

1 Âmbito de aplicação

Quem?

1. As presentes orientações aplicam-se a Repositórios de Transações («Trade Repositories», adiante designados por TR) registados ou reconhecidos ao abrigo do regulamento EMIR («European Market Infrastructure Regulation»).

O quê?

2. As presentes orientações são aplicáveis:
 - a. À comunicação sem duplicação de detalhes dos contratos de derivados por parte das contrapartes e das CCPs (contrapartes centrais), ao abrigo do artigo 9.º, n.º 1, do EMIR,
 - b. À transferência de dados sobre contratos de derivados entre repositórios de transações, quando solicitado pelas contrapartes de um contrato de derivados, ou da entidade que comunica a esse respeito, ou na situação abrangida pelo artigo 79.º, n.º 3, do EMIR, e
 - c. À manutenção de registos de detalhes dos contratos de derivados ao abrigo do artigo 80.º, n.º 3, do EMIR.

Quando?

3. As presentes orientações entram em vigor no dia 16 de outubro de 2017.

2 Glossário de conceitos e termos

4. Todas as definições, conceitos e termos utilizados no EMIR, nas atuais RTS (Normas Técnicas de Regulamentação) e ITS (Normas Técnicas de Execução) sobre comunicação¹, nas alterações subsequentes às RTS e ITS de comunicação², nas Q&A e nas presentes orientações são utilizados com o mesmo significado.
5. Além disso, para efeitos destas orientações, a ESMA define os seguintes conceitos, os quais serão utilizados para ilustrar as diferentes situações que poderão ocorrer.
6. «Entidade sujeita a comunicação» («Report submitting entity», adiante designada por RSE), que constitui um dos campos de contraparte das normas técnicas sobre comunicação alteradas³, deverá ser entendida como a entidade que iniciou uma relação contratual com um TR registado ou reconhecido e:
 - a. Comunica apenas a sua parte num contrato de derivados, e nesse caso irá coincidir com a contraparte do contrato que comunica
 - b. Comunica apenas contratos de derivados onde é uma das contrapartes, e nesse caso irá coincidir ou com a contraparte do contrato que comunica ou com a outra contraparte, e
 - c. Comunica contratos de derivados onde possa, ou não possa, ser uma das contrapartes.
7. «TR participante»⁴ é uma entidade que tem um acordo contratual com o objetivo de comunicar contratos de derivados ao abrigo do artigo 9.º do EMIR, com pelo menos um TR registado ou reconhecido. O TR participante pode ser uma RSE, ou uma contraparte de comunicação, ou uma CCP, que tenha apenas um acesso «ver apenas» a um TR.

¹ Regulamento Delegado (UE) n.º 148/2013 da Comissão, de 19 de dezembro de 2012, que completa o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações, no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação que especificam os dados mínimos a comunicar aos repositórios de transações, L52, JO 23.2.2013, p.1

Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012 da Comissão, de 19 de dezembro de 2012, que estabelece as normas técnicas de execução no que se refere ao formato e à periodicidade dos relatórios de transações a transmitir aos repositórios de transações nos termos do Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações, L352, JO 21.12.2012, p. 20

² Regulamento Delegado (UE) n.º 2017/104 da Comissão, de 19 de outubro de 2016, que altera o Regulamento Delegado (UE) n.º 148/2013 que completa o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações, no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação que especificam os dados mínimos a comunicar aos repositórios de transações, L17, JO 21.1.2017, p. 1

Regulamento de Execução (UE) n.º 2017/105 da Comissão, de 19 de outubro de 2016, que altera o Regulamento de Execução (UE) n.º 1247/2012 da Comissão que estabelece as normas técnicas de execução no que se refere ao formato e à periodicidade dos relatórios de transações a transmitir aos repositórios de transações, de acordo com o Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações, L17, JO 21.1.2017, p. 17

³ https://www.esma.europa.eu/system/files/force/library/2015/11/2015-esma-1645_-_final_report_emir_article_9_rts_its.pdf

⁴ Alguns TR poderão especificar em maior pormenor os tipos de TR participante, tais como participantes de comunicação, comunicação geral, não-comunicação, etc. Estas subcategorias são transparentes na perspetiva das presentes orientações.

3 Lista de Acrónimos

CCP	Contraparte Central
EMIR	Regulamento relativo à Infraestrutura do Mercado Europeu («European Market Infrastructures Regulation») – Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações – também designado como «o Regulamento»
ESMA	Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados
UE	União Europeia
ISO	Organização Internacional de Normalização
ITS	Normas Técnicas de Execução
LEI	Identificador de entidade jurídica
MAR	Regulamento (UE) n.º 596/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 16 de abril de 2014, relativo ao abuso de mercado (Regulamento «Abuso de Mercado»).
MiFIR	Regulamento (UE) n.º 600/2014 do Parlamento Europeu e do Conselho, relativo aos mercados de instrumentos financeiros e que altera o Regulamento (UE) n.º 648/2012
MMSR	Regulamento (UE) n.º 1333/2014 do Banco Central Europeu, de 26 de novembro de 2014, relativo às estatísticas de mercados monetários
NCA	Autoridade Nacional Competente
JO	Jornal Oficial da União Europeia
OTC	Over-the-counter («mercado de balcão»)
Q&A	Perguntas e Respostas
RTS	Normas Técnicas de Regulamentação
SFTR	Regulamento (UE) n.º 2015/2365 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 25 de novembro de 2015, relativo à transparência

das operações de financiamento através de valores mobiliários e de reutilização e que altera o Regulamento (UE) n.º 648/2012

TR	Repositório de transações
UTI	Identificador Único de Transação
XML	Extensible Mark-up Language
XSD	XML Schema Definition

4 Objetivo

8. O objetivo destas orientações é, portanto, triplo:
 - a. Eliminar os obstáculos à portabilidade no ambiente concorrencial dos TR que suportam o EMIR, e assegurar que os TR participantes podem beneficiar do ambiente multi-TR;
 - b. Assegurar a qualidade dos dados disponíveis às autoridades, incluindo as agregações realizadas pelos TR, mesmo quando o TR participante altera o TR a que comunica os seus relatórios e independentemente da razão de tal alteração;
 - c. Assegurar que existe uma forma consistente e harmonizada de transferir registos de um TR para outro TR e suportar a continuidade da comunicação e reconciliação em todos os casos, incluindo a revogação do registo de um TR.
9. A necessidade de transferir dados para outro TR poderá surgir por variadas razões. Portanto, as orientações tratam separadamente as situações onde (i) a transferência é devida à revogação do registo do TR, dos casos em que (ii) a transferência é realizada numa base voluntária e sob condições normais de mercado. Os incentivos e motivações para as partes relevantes em cada um dos dois casos seriam diferentes, pelo que há necessidade de uma abordagem específica a cada situação particular.
10. As orientações estabelecem princípios de nível elevado que terão de ser seguidos pelos TR participantes, por exemplo, por um lado, RSE, contrapartes e CCP e, por outro lado, os TR. Esses princípios são complementados por procedimentos específicos, incluídos nas secções 10 e 11 deste relatório final, estipulados para assegurar a transferência atempada e robusta dos detalhes dos contratos de derivados.
11. No entanto, estas orientações não abrangem situações que não exigem transferência de dados, tais como contrapartes que decidiram comunicar a dois ou mais TR ao mesmo tempo.

5 Conformidade

12. O presente documento contém orientações emitidas nos termos do artigo 16.º do Regulamento ESMA. Nos termos do artigo 16.º, n.º 3, do Regulamento ESMA, as autoridades competentes e os intervenientes nos mercados financeiros desenvolvem todos os esforços para dar cumprimento a essas orientações e recomendações.

6 Orientações

1. Apenas os antigos TR e os novos TR deverão realizar a transferência de dados dos contratos de derivados. O novo TR não deverá aceitar comunicações duplicadas por parte dos TR participantes relacionadas com os contratos de derivados sujeitos a transferência. O antigo TR não deverá aceitar comunicações com tipos de ação «Cancelamento» e «Erro» realizadas por TR participantes relacionadas com os contratos de derivados sujeitos a transferência.
2. A transferência de dados deverá ser realizada pelos TR de acordo com um plano de migração acordado por todos. O plano de migração deverá conter o planeamento detalhado (calendarização) e uma descrição dos controlos exigidos em vigor, de modo a assegurar uma transferência de dados atempada, completa e precisa.
3. Todos os TR deverão utilizar um modelo normalizado de plano de migração, acordado por todos os TR e que esteja de acordo com o estipulado na Orientação n.º 4.
4. O plano de migração deverá conter a seguinte informação:
 - i. O âmbito da transferência de dados (por exemplo, os TR participantes, os contratos de derivados envolvidos, etc.)
 - ii. Mandatos e responsabilidades detalhadas das entidades envolvidas
 - iii. Calendarização e momentos relevantes para a transferência
 - iv. Os controlos exigidos para assegurar a confidencialidade dos dados transferidos (por exemplo, o tipo de encriptação utilizado)
 - v. Os controlos exigidos para assegurar a integridade e precisão dos dados transferidos (por exemplo, somas de verificação criptográfica e algoritmos *hash*)
 - vi. Os controlos exigidos para assegurar a continuidade das operações e o estado de reconciliação inter-TR dos contratos de derivados sob transferência
 - vii. Tempo de corte e disponibilidade dos dados
 - viii. Qualquer outra informação que facilite e assegure a transferência suave dos dados.

5. Os TR deverão transferir dados entre si através do formato XML e do modelo definido de acordo com o artigo 4.º da RTS alterada 151/2013. Não obstante isso, no caso de (i) contratos de derivados que não estejam em aberto no momento da transferência, (ii) contratos de derivados em aberto que não tenham sido alterados após a data de aplicação das alterações ao Regulamento Delegado n.º 148/2013 da Comissão, ou (iii) contratos de derivados rejeitados, os TR poderão utilizar ficheiros com valores separados por vírgulas (csv). Nos ficheiros que irão ser transferidos, o antigo TR deverá incluir todos os detalhes relevantes dos contratos de derivados sujeitos a transferência.
6. Os TR deverão utilizar protocolos seguros máquina-a-máquina, incluindo o Protocolo de Transferência de Ficheiros SSH, para transferir os dados entre si.
7. Os TR deverão utilizar protocolos de encriptação avançados e deverão partilhar as chaves públicas de encriptação relevantes com os seus pares. Para assegurar o funcionamento perfeito da encriptação de dados, os TR deverão testar com antecedência se estão capacitados para encriptar e desencriptar os ficheiros de dados de cada um.
8. O antigo TR deverá calcular o número de contratos de derivados e o número de ocorrências associadas ao ciclo de vida que irão ser transferidos para o novo TR. O antigo TR deverá solicitar ao TR participante que ratifique os números relacionados com contratos de derivados em aberto e deverá esclarecer todas as discrepâncias o mais rapidamente possível e nunca demorando mais de cinco dias úteis.
9. Por cada ficheiro criado e transferido, o antigo TR deverá criar e incluir na transferência de dados uma soma de verificação criptográfica de acordo com um algoritmo *hash* acordado previamente.
10. A transferência de dados solicitada por um TR participante deverá ser realizada, como princípio geral, num dia não útil. O novo e o antigo TR podem, contudo, concordar em realizá-la num dia útil, dependendo do volume esperado da transferência.
11. Assim que a transferência de contratos de derivados em aberto estiver confirmada pelo novo TR, o antigo TR não deverá aceitar comunicações sobre ocorrências associadas ao ciclo de vida e dados de posições relacionados com contratos de derivados sujeitos a transferência para o novo TR.
12. Até que a transferência de todos os ficheiros relevantes sujeitos a transferência esteja completa, o novo TR não deverá aceitar ocorrências associadas ao ciclo de vida e dados de posições relacionados com contratos de derivados sujeitos a transferência. Os dados sobre contratos de derivados em aberto deverão ser disponibilizados às autoridades relevantes pelo antigo TR.
13. Uma vez concluída a transferência de dados, o novo TR deverá:
 - i. Tornar os dados disponíveis às autoridades

- ii. Incluir os dados sujeitos a transferência nas agregações públicas e apenas abertas às autoridades
 - iii. Incluir os dados no processo de reconciliação inter-TR, quando aplicável.
14. Após a transferência de registos de um TR participante para outro TR, o antigo TR não deverá cobrar quaisquer comissões específicas pela manutenção dos registos dos contratos de derivados em aberto.
15. No caso de todos os dados no âmbito do plano de migração não poderem ser transferidos numa única vez, os TR deverão transferir os dados de acordo com a seguinte ordem:
- i. O último estado dos contratos de derivados em aberto recebidos, isto é, o «estado da transação»;
 - ii. As comunicações relacionadas com ocorrências associadas ao ciclo de vida aplicáveis aos contratos de derivados em aberto;
 - iii. Todos os contratos de derivados terminados, comprimidos e que tenham atingido a maturidade, que ainda estejam sujeitos à obrigação prevista no n.º 3, do artigo 80.º do EMIR, em conjunto com as ocorrências associadas ao ciclo de vida relevantes;
 - iv. Todos os contratos de derivados com erro que ainda estejam sujeitos à obrigação prevista no n.º 3, do artigo 80.º do EMIR, em conjunto com as ocorrências associadas ao ciclo de vida relevantes;
 - v. Todos os contratos de derivados rejeitados comunicados pelo TR participante e que não passaram nas validações de dados (apenas no caso de revogação do registo); e
 - vi. O diário de comunicações que regista a razão, ou razões, para uma modificação, a data, hora e uma descrição clara das alterações (incluindo os antigos e os novos conteúdos dos dados relevantes) pertencentes aos contratos de derivados que são transferidos.
16. No caso da transferência de dados solicitada por um TR participante, o antigo TR deverá determinar se a totalidade ou parte dos contratos de derivados pertencentes a contrapartes que sejam TR participantes não sujeitos a comunicação, e que tenham sido comunicados pelo TR participante, deverão ser transferidos para o novo TR.
17. Sempre que, no caso da transferência de dados solicitada por um TR participante, um TR participante não sujeito a comunicação decide permanecer com o antigo TR, embora o seu TR participante que comunica tenha solicitado a transferência para outro TR, o antigo TR deverá separar os contratos de derivados submetidos a favor do TR participante não sujeito a comunicação dos contratos de derivados que são transferidos.

18. No caso da transferência de dados solicitada por um TR participante, e quando o registo do antigo TR não é revogado, nem está em vias de o ser, o âmbito dos dados deverá abranger pelo menos:
- i. Todos os contratos de derivados em aberto do TR participante ou, se o TR participante for uma RSE, os contratos de derivados dos clientes do TR participante que confirmaram ao TR participante a sua aceitação da transferência dos contratos de derivados para outro TR;
 - ii. Quaisquer ocorrências associadas ao ciclo de vida, tais como modificações, avaliações, etc., pertencentes aos contratos de derivados em aberto; e
 - iii. O diário de comunicações pertencente aos contratos de derivados que são transferidos.

Os dados ao abrigo dos pontos i e ii deverão ser transferidos, se possível, numa única vez.

19. No caso da transferência de dados solicitada por um TR participante, o processo descrito no Anexo I – Procedimento para a transferência de dados por solicitação do TR participante, deverá ser seguido pelo antigo TR e pelo novo TR. Os TR deverão concordar o mais cedo possível com o plano de migração para a transferência de dados de um determinado TR participante, e nunca após passarem cinco dias úteis da data em que a solicitação foi recebida.
20. No caso da transferência de dados solicitada por um TR participante, assim que os contratos de derivados em aberto de um TR participante forem transferidos para o novo TR, o novo TR deverá enviar uma confirmação de tal ao TR participante, ao antigo TR, aos restantes TR e às autoridades relevantes que tenham acesso aos contratos de derivados comunicados pelo TR participante.
21. No caso da transferência de dados solicitada por um TR participante, o antigo TR deverá isolar e manter seguros os dados transferidos, aplicando aos dados transferidos as mesmas políticas, procedimentos e salvaguardas no que respeita à manutenção de dados do que ao resto dos dados sobre contratos de derivados comunicados a esse TR, durante pelo menos três meses e deverá assegurar a disponibilização dos dados no máximo em sete dias corridos.
22. No caso da transferência de dados solicitada por um TR participante, quaisquer comissões cobradas pelo antigo TR ou pelo novo TR deverão estar relacionadas com os custos, não deverão ser discriminatórias e incluídas na tabela de comissões dos TR relevantes, a qual é tornada pública.
23. No caso da revogação do registo de um TR, a transferência de dados deverá abranger todos os detalhes dos contratos de derivados comunicados ao TR, incluindo os rejeitados, em conjunto com o diário de comunicações relevante. Deverá ser seguida a ordem da transferência de dados definida na Orientação n.º 15.

24. No caso da revogação do registo de um TR, o(s) plano(s) de migração para a transferência de dados deverão ser incluídos como parte do plano de redução apresentado pelo TR.
25. Quando a transferência de dados está relacionada com a revogação do registo de um TR, o procedimento incluído no Anexo II – Procedimento para migração no caso de revogação do registo, deverá ser seguido pelo antigo TR e pelo novo TR. Deverá ser devidamente seguida a ordem da transferência de dados definida na Orientação n.º 15. O antigo TR, isto é, aquele cujo registo será revogado, deverá fornecer à ESMA evidência suficiente de que todas as transferências foram bem sucedidas.
26. No caso da revogação do registo por solicitação de um TR, deverá notificar a ESMA com antecedência, da data pretendida para a cessação das operações, e deverá então notificar imediatamente os TR participantes e as autoridades nacionais competentes relevantes. Para TR com mais de 500 TR participantes, a notificação prévia deverá ser feita com pelo menos nove meses, ao passo que para TR com menos de 500 TR participantes, a notificação prévia deverá ser feita com pelo menos seis meses.
27. No caso da revogação do registo, uma vez concluída(s) a(s) transferência(s), o novo TR deverá confirmá-la aos TR participantes, a todos os restantes TR e às respetivas NCA.
28. No caso da revogação do registo, o antigo TR deverá isolar e manter seguros os dados transferidos, aplicando aos dados transferidos as mesmas políticas, procedimentos e salvaguardas no que respeita à manutenção de dados do que ao resto dos dados, até à data da real cessação de operações e deverá assegurar a disponibilização dos dados no máximo em sete dias corridos. Na data da real cessação de operações, o antigo TR deverá realizar uma destruição/eliminação segura dos dados, de acordo com as melhores práticas e as técnicas mais eficazes, assegurando que os dados não podem ser reconstruídos ou recuperados após essa data.
29. No caso da revogação do registo, nenhum dos TR deverá cobrar comissões pela transferência de dados.

7 Anexo I – Procedimento para a transferência de dados por solicitação do TR participante

<p>A. Planeamento e preparação</p> <p>Após assinar o acordo contratual relevante com o TR participante, o novo TR comunica com o antigo TR e acorda o plano de migração, elaborado de acordo com a Orientação n.º 3.</p> <p>O novo TR notifica por <i>e-mail</i> as autoridades relevantes acerca da transferência.</p> <p>O antigo TR determina e acorda com o TR participante a seguinte informação agregada com respeito aos contratos de derivados do TR participante sujeitos à transferência:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ O número total de contratos de derivados em aberto ○ O número total de comunicações relacionadas com ocorrências associadas ao ciclo de vida desses contratos de derivados ○ O número total de registos relacionados com contratos de derivados terminados, comprimidos e que tenham atingido a maturidade (no caso de terem sido transferidos) ○ O número total de registos relacionados com contratos de derivados com erros (no caso de terem sido transferidos) <p>O antigo TR deverá solicitar a confirmação por parte do TR participante da precisão da informação supra relativamente aos próprios registos do TR participante⁵. Em caso de falta de correspondência, o antigo TR deverá reconciliar os números relevantes com o TR participante e acordar sobre a lista final de comunicações sobre contratos de derivados que será migrada. O antigo TR deverá resolver todas as discrepâncias o mais rapidamente possível e nunca demorando mais de cinco dias úteis.</p>
<p>B. Execução de transferência</p> <p>Uma vez confirmado o número de contratos de derivados e registos, o antigo TR deverá prosseguir, criando o(s) ficheiro(s) relevante(s) de acordo com a Orientação n.º 5 e os princípios genéricos relevantes.</p> <p>O antigo TR e o novo TR executam o plano de migração. O antigo TR deverá transferir os ficheiros criados para o novo TR, que acusa a receção da transferência do ficheiro.</p> <p>No caso do volume de ficheiros ser gerível, o antigo TR deverá transferir ao mesmo tempo o(s) ficheiro(s) dos contratos de derivados em aberto, bem como o(s) ficheiros(s) associado(s) de atividade de ciclo de vida.</p>

⁵ De acordo com o artigo 9.º, n.º 2, do EMIR, «as contrapartes devem conservar os dados respeitantes a todos os contratos de derivados que celebrem e a qualquer alteração dos mesmos durante pelo menos cinco anos após o termo do contrato.» No caso das comunicações por parte de um TR participante que comunique em nome de outros, deverá igualmente utilizar os seus registos.

<p>No caso do volume dos ficheiros não permitir a transferência simultânea, deverá ser seguida a sequência incluída na Orientação n.º 15.</p> <p>A este respeito, os contratos de derivados em aberto deverão ser transferidos num fim de semana predeterminado, ao passo que as ocorrências associadas ao ciclo de vida deverão ser transferidas na primeira oportunidade, durante a semana seguinte.</p>
<p>C. Verificação dos dados transferidos</p> <p>O novo TR deverá determinar os seguintes números e informações relativas aos registos recebidos e verificar a integridade da transferência:</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ O último estado dos contratos de derivados em aberto recebidos, isto é, o «estado da transação» ○ O número total de contratos de derivados em aberto ○ O número total de registos relacionados com ocorrências associadas ao ciclo de vida de contratos de derivados em aberto ○ O número total de registos relacionados com contratos de derivados terminados, comprimidos e que tenham atingido a maturidade (no caso de terem sido transferidos) ○ O número total de registos relacionados com contratos de derivados com erros (no caso de terem sido transferidos)
<p>O novo TR deverá solicitar a confirmação por parte do TR participante da precisão da informação supra relativamente aos próprios registos do TR participante⁶. Em caso de falta de correspondência, os dois TR deverão tentar reconciliar os números relevantes com o TR participante, até que seja alcançado um acordo.</p>
<p>D. Avisos finais</p>
<p>O novo TR deverá informar todos os TR de que a participação na comunicação passou para si. Esta informação deverá ser utilizada para facilitar o processo de reconciliação para os contratos de derivados relevantes que migraram para o novo TR.</p>
<p>O novo TR deverá informar as autoridades nacionais competentes e a ESMA acerca da finalização da transferência de dados do TR participante e identificar os tipos de contratos de derivados envolvidos.</p>
<p>E. Manutenção de registos e eliminação segura de dados</p>
<p>O antigo TR deverá remover os contratos de derivados em aberto que migraram de todas as agregações de dados.</p>
<p>O antigo TR deverá manter os dados transferidos pelo período estipulado nos princípios gerais e de acordo com os requisitos do EMIR, tal como antes da transferência.</p>
<p>O antigo TR deverá manter o diário de comunicações durante pelo menos 10 anos após o termo dos contratos relevantes.</p>
<p>O antigo TR irá destruir/eliminar os dados transferidos quando tal for permitido, de acordo com os princípios gerais relevantes para a destruição/eliminação segura.</p>

⁶ De acordo com o artigo 9.º, n.º 2, do EMIR, «as contrapartes devem conservar os dados respeitantes a todos os contratos de derivados que celebrem e a qualquer alteração dos mesmos durante pelo menos cinco anos após o termo do contrato.» No caso das comunicações por parte de um TR participante que comunique em nome de outros, deverá igualmente utilizar os seus registos.

8 Anexo II - Procedimento para migração no caso de revogação do registo

A. Avisos iniciais

(Revogação voluntária) O TR notifica a ESMA, os TR participantes, outros TR envolvidos e as autoridades nacionais competentes da sua solicitação para revogar o seu registo, pelo menos com antecedência (de acordo com a Orientação n.º 25) da data pretendida de cessação de operações (no caso da revogação ser solicitada pelo TR).

Ou

(Revogação não voluntária) A ESMA notifica o(s) novo(s) TR e as autoridades nacionais competentes que o(s) novo(s) TR deverá(ão) receber dados que eram originalmente comunicados pelo antigo TR (no caso da revogação não ter sido solicitada pelo TR)

B. Planeamento e preparação

O antigo TR informa os TR participantes da sua intenção de cessar operações. O(s) TR prepara(m) o plano de migração, de acordo com o estipulado na Orientação n.º 3, e submete(m)-(n)o à ESMA e ao(s) novo(s) TR. A ESMA e os outros TR envolvidos levantam quaisquer objeções potenciais ou preocupações e, após esclarecerem-nas, todas as partes concordam com os detalhes do plano de migração.

O antigo TR identifica os contratos de derivados sujeitos a transferência e disponibiliza à ESMA e aos outros TR envolvidos (como parte do plano de migração, ou em separado) a seguinte informação com respeito aos contratos de derivados sujeitos a transferência por TR:

- O número total de contratos de derivados em aberto
- O número total de registos relacionados com ocorrências associadas ao ciclo de vida de contratos de derivados em aberto
- O número total de registos relacionados com contratos de derivados terminados, comprimidos e que tenham atingido a maturidade
- O número total de registos relacionados com contratos de derivados com erros
- O número de entradas no diário de comunicações

C. Execução de transferência

Uma vez confirmado o número de contratos de derivados e registos, o antigo TR deverá prosseguir, criando o(s) ficheiro(s) relevante(s) de acordo com a Orientação n.º 5.

O antigo TR e o(s) novo(s) TR executam o plano de migração. Os ficheiros criados são transferidos do antigo TR para o(s) novo(s) TR, que acusa(m) a receção de cada transferência.

É seguida a priorização da sequência de contratos de derivados e registos incluída na Orientação n.º 15.

Se possível, os contratos de derivados em aberto deverão ser transferidos durante um fim de semana, ao passo que as ocorrências associadas ao ciclo de vida e as avaliações/garantias deverão ser transferidas na primeira oportunidade e nunca após a semana seguinte.

Caso não seja possível, então os contratos de derivados em aberto deverão ser segmentados, por TR participante, em dois ou mais lotes, para serem transferidos durante os fins de semana subsequentes. As ocorrências associadas ao ciclo de vida por lote deverão ser transferidas na primeira oportunidade e nunca após o final da semana seguinte à transferência dos contratos de derivados em aberto relevantes.

Os restantes contratos de derivados deverão ser transferidos assim que possível, no prazo de um mês após a conclusão da transferência dos contratos de derivados em aberto.

Quaisquer questões identificadas e progressos realizados são comunicados regularmente, e de forma atempada, à ESMA.

D. Verificação da transferência de dados

O(s) novo(s) TR deverá(ão) determinar os seguintes números e informações relativas aos registos recebidos e verificar a integridade da transferência:

- O último estado dos contratos de derivados em aberto recebidos, isto é, o «estado da transação»
- O número total de contratos de derivados em aberto
- O número total de registos relacionados com ocorrências associadas ao ciclo de vida de contratos de derivados em aberto
- O número total de registos relacionados com contratos de derivados terminados, comprimidos e que tenham atingido a maturidade
- O número total de registos relacionados com contratos de derivados com erros
- O número de entradas no diário de comunicações

O(s) novo(s) TR deverá(ão) notificar a ESMA e o antigo TR do resultado da verificação. Em caso de falha na verificação, a causa principal é investigada por ambas as partes (antigo TR e novo TR) e o processo de transferência é repetido até que a transferência de dados seja bem sucedida.

E. Disposições finais

Os novos TR deverão notificar, da conclusão bem sucedida da transferência, os TR participantes relevantes, todos os restantes TR e as respetivas autoridades nacionais competentes (por *e-mail*).

F. Manutenção de registos e eliminação segura de dados

O antigo TR deverá manter os dados transferidos pelo período estipulado na Orientação n.º 28, e de acordo com os requisitos do EMIR, tal como antes da transferência.

O antigo TR deverá destruir/eliminar os dados transferidos quando tal for permitido e de acordo com os princípios relevantes para a destruição/eliminação segura incluídos na Orientação n.º 28.