

INSTRUÇÃO N.º 01/CMC/03-23

PRESTAÇÃO DE INFORMAÇÕES SOBRE AS NEGOCIAÇÕES EM MERCADO REGULAMENTADO

Considerando que as Sociedades Gestoras de Mercados Regulamentados (SGMR) são obrigadas a prestar à Comissão do Mercado de Capitais (CMC) um conjunto de informações periódicas relativas às operações realizadas através dos mercados por si geridos, necessárias para assegurar um melhor acompanhamento das mesmas, nos termos definidos no artigo 19.º do Regulamento n.º 2/17, de 7 de Dezembro, sobre os Mercados Regulamentados;

Tendo em conta que a Instrução n.º 003/CMC/12-18, de 12 de Dezembro, relativa à Prestação de Informação sobre as Negociações em Mercado Regulamentado, veio estabelecer que as SGMR passariam a enviar as informações sobre as negociações somente através de correio electrónico (*e-mail*), devido à exclusão do acesso das mesmas ao Sistema Informático de Supervisão e Fiscalização da CMC (SISF);

Havendo a necessidade de alterar a referida Instrução, no sentido de estabelecer a plataforma *CUMULUS* como o único canal de comunicação para envio de informações à CMC, por possuir maior capacidade de armazenamento e de segregação de informações;

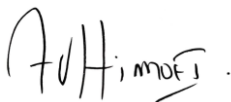
Ao abrigo do disposto na alínea b) do artigo 17.º, no n.º 5 do artigo 33.º e na alínea c) do n.º 1 do artigo 235.º, todos do Código dos Valores Mobiliários, conjugados com o n.º 1 do artigo 4.º e com a alínea c) do artigo 19.º, ambos do Estatuto Orgânico da CMC, aprovado pelo Decreto Presidencial n.º 54/13, de 6 de Junho, o Conselho de Administração da CMC, aprova o seguinte:

1. As Sociedades Gestoras de Mercados Regulamentados (SGMR) devem enviar à Comissão do Mercado de Capitais (CMC) as informações relativas às operações realizadas através dos mercados sob sua gestão, conforme disposto no n.º 1 do artigo 19.º do Regulamento n.º 2/17, de 7 de Dezembro, sobre os Mercados Regulamentados.
2. As informações referidas no número anterior devem ser enviadas em formato *Comma-Separated Values* (CSV), conforme modelo constante do Anexo I à presente Instrução, da qual é parte integrante, até às 17 (dezassete) horas do dia útil subsequente ao da realização das operações, através da plataforma de partilha de documentos denominada "*CUMULUS*", pela hiperligação <https://cumulus.cmc.ao/login>.
3. As regras relativas ao preenchimento dos mapas do Anexo I constam do Anexo II à presente Instrução, fazendo, igualmente, parte integrante dela.
4. Em caso de alteração às informações previamente enviadas, a SGMR deve efectuar o reenvio integral das mesmas, nos termos definidos no n.º 2, podendo a CMC rejeitar as alterações se não forem prestadas todas as informações exigidas pelo n.º 1 do artigo 19.º do Regulamento n.º 2/17, de 7 de Dezembro, sobre os Mercados Regulamentados.
5. A denominação do ficheiro deve ter como prefixo "Relatório Sessão", devendo ainda ser simples, concisa e corresponder ao conteúdo do mesmo.

6. É revogada a Instrução n.º 003/CMC/12-18, de 12 de Dezembro, relativa à Prestação de Informação sobre as Negociações em Mercado Regulamentado.
7. As dúvidas e omissões suscitadas na interpretação e aplicação da presente Instrução são resolvidas pelo Conselho de Administração da CMC.
8. A presente Instrução entra em vigor no dia 3 de Abril de 2023.

A COMISSÃO DO MERCADO DE CAPITAIS, em Luanda, aos 17 de Março de 2023.

A Presidente

A handwritten signature in black ink, appearing to read 'V. Simões'.

Vanessa Simões

ANEXO I – MODELO

RELATÓRIO DE SESSÃO_MÊS_ANO:

Data de registo	Número do negócio	Código ISIN	Código do instrumento	Comprador	NIF ¹ Cliente comprador	ID Cliente comprador	NIF Membro comprador	Membro comprador	Vendedor	NIF Cliente vendedor

ID Cliente vendedor	NIF Membro vendedor	Membro vendedor	Preço	Quantidade	Montante Kz	Juros corridos	Ano de vencimento	ID Tipo de instrumento

¹ Número de Identificação Fiscal.

Tipo de instrumento	Taxa de cupão	NIF Membro liquidador	Membro liquidador	ID <i>Status</i>	<i>Status</i>	Método de negociação	Segmento de mercado	N.º de Ordem de compra	N.º de Ordem de venda

ANEXO II – Regras de Preenchimento dos Mapas do Anexo I

RELATÓRIO DE SESSÃO_MÊS_ANO:

Campo 1 (Data de registo): Data de registo da negociação;

Campo 2 (Número do negócio): Número atribuído ao negócio;

Campo 3 (Código ISIN): Número de identificação do valor mobiliário;

Campo 4 (Código do instrumento): Número de identificação do instrumento financeiro local (diferente do ISIN internacionalmente aceite);

Campo 5 (Comprador): Identificação do operador do agente de intermediação que inseriu a ordem de compra;

Campo 6 (NIF Cliente comprador): Número de Identificação Fiscal do cliente comprador;

Campo 7 (ID Cliente comprador): Número da conta de custódia do cliente comprador;

Campo 8 (NIF Membro comprador): Número de Identificação Fiscal do agente de intermediação;

Campo 9 (Membro comprador): Identificação do agente de intermediação comprador;

Campo 10 (Vendedor): Identificação do operador do agente de intermediação que inseriu a ordem de venda;

Campo 11 (NIF Cliente vendedor): Número de Identificação Fiscal do cliente vendedor;

Campo 12 (ID Cliente vendedor): Número da conta de custódia do cliente vendedor;

Campo 13 (NIF Membro vendedor): Número de Identificação Fiscal do agente de intermediação vendedor;

Campo 14 (Membro vendedor): Identificação do agente de intermediação vendedor;

Campo 15 (Preço): Valor monetário em Kwanzas pago pela transacção;

Campo 16 (Quantidade): Valor numérico;

Campo 17 (Montante Kz): Valor monetário em Kwanzas;

Campo 18 (Juros corridos): Valor monetário em Kwanzas;

Campo 19 (Ano de vencimento): Valor numérico;

Campo 20 (ID Tipo de instrumento): Valor numérico;

Campo 21 (Tipo de instrumento): Indicação do tipo de instrumento financeiro transaccionado. Deve ser preenchido com os seguintes códigos:

- A – Acções;
- ODV – Obrigações de Dívida Pública;
- OT – Obrigações do Tesouro;
- BT – Bilhetes do Tesouro;
- ODP – Obrigações de Dívida Privada;
- OVM – Outros Valores Mobiliários;
- UP de OICM – Unidades de Participação de Organismos de Investimento Colectivo Mobiliários;
- UP de OICI – Unidades de Participação de Organismos de Investimento Colectivo Imobiliários;
- OA – Outros Activos.

Campo 22 (Taxa do cupão): Valor numérico;

Campo 23 (NIF Membro liquidador): Número de Identificação Fiscal do agente de intermediação liquidador;

Campo 24 (Membro liquidador): Identificação do agente de intermediação liquidador;

Campo 25 (ID *Status*): Número de identificação, informando se a transacção está ou não liquidada;

Campo 26 (*Status*): Fase de identificação, informando se a transacção está liquidada ou por liquidar;

Campo 27 (Método de negociação): Informação sobre a forma como foi realizado a transacção. Deve ser preenchido com os seguintes códigos:

- REGISTO – Negociação bilateral;
- VISTA – Negociação multilateral.

Campo 28 (Segmento de mercado): Informação sobre o tipo de segmento de mercado onde ocorre a operação. Deve ser preenchido com os seguintes códigos:

- MBA – Mercado de Bolsa por Acções;
- MBOP – Mercado de Bolsa de Obrigações Privadas;
- MBTT – Mercado de Bolsa de Títulos do Tesouro;
- MBUP – Mercado de Bolsa de Unidades de Participação de Fundos de Investimento;
- MROV – Mercado de Registo de Operações sobre Valores Mobiliários;
- MOR – Mercado de Operações de Reporte.

Campo 29 (N.º de Ordem de compra): Número da ordem de compra;

Campo 30 (N.º de Ordem de venda): Número da ordem de venda.