

**AtivosFP – Investimentos dos fundos de pensões**

**Observações gerais:**

Não podem ser preenchidas células que não sejam de cor verde.

As células de cor laranja são de preenchimento automático.

<b>ELEMENTO</b>	<b>INSTRUÇÕES</b>
<b>Cabeçalho</b>	
<b>Data</b>	Data a que se reporta a informação (p.e. 31-12-2004)
<b>CE</b>	Código Estatístico da Entidade Reportante
<b>NE</b>	Identificação da Entidade Reportante (Nome abreviado)
<b>ID</b>	Nome do responsável pelo reporte da informação e o departamento onde desempenha funções (p.e. Manuel Simões - Dep. Contabilidade)
<b>LEI</b>	Identificador de Entidade Jurídica. Código alfanumérico de 20 caracteres baseado na norma ISO 17442 desenvolvida pela Organização Internacional de Normalização (ISO), que permite identificar de forma clara e única entidades que participam em transações financeiras e os dados de referência associados
<b>Mapa Fundos</b>	
<b>LEI</b>	Identificador de Entidade Jurídica do fundo de pensões. Código alfanumérico de 20 caracteres baseado na norma ISO 17442 desenvolvida pela Organização Internacional de Normalização (ISO), que permite identificar de forma clara e única entidades que participam em transações financeiras e os dados de referência associados
<b>Fundo Consolidado</b>	Preencher com C quando se refere ao fundo consolidado
<b>Perda Potencial Máxima do Fundo Sem Produtos Derivados</b>	Preencher com a perda potencial máxima do fundo sem os produtos derivados utilizados no âmbito de uma gestão agregada dos riscos
<b>Perda Potencial Máxima do Fundo</b>	Preencher com a perda potencial máxima global do fundo
<b>Posições</b>	
Este mapa deverá ser preenchido com as posições detidas em cada ativo por um fundo ou subfundo.	
<b>LEI</b>	Identificador de Entidade Jurídica do fundo de pensões. Código alfanumérico de 20 caracteres baseado na norma ISO 17442 desenvolvida pela Organização Internacional de Normalização (ISO), que permite identificar de forma clara e única entidades que participam em transações financeiras e os dados de referência associados
<b>Fundo Consolidado</b>	Preencher com C quando se refere ao fundo consolidado
<b>Código Base</b>	Preencher com o código identificativo do ativo, de acordo com a seguinte ordem de prioridades: - Código ISIN ISO 6166; - Outros códigos reconhecidos (ver coluna seguinte); - Código atribuído pela entidade quando as opções acima não estiverem disponíveis. Este código deve ser único e coerente ao longo do tempo.  Quando o mesmo ativo tiver de ser reportado em separado em virtude de ser emitido em duas ou mais moedas, o código base reportado deve ser acrescido do código ISO 4217 correspondente à moeda (exemplo correspondente ao reporte de um código ISIN: "ISIN+EUR").

<b>Tipo de Código</b>	<p>Preencher com os seguintes números, consoante a origem do código introduzido na coluna anterior:</p> <p>1 - ISIN  2 - CUSIP  3 - SEDOL  4 - WKN  5 - Bloomberg Ticker  6 - BBGID  7 - Reuters RIC  8 - FIGI  9 - Outro código de membros da ANNA  99 - Código atribuído pela entidade</p> <p>Nos casos em que o Código Base utilizado for acrescido do código ISO 4217 correspondente à moeda, o tipo de código reportado deve ser compostos pelos dígitos 99 adicionado do número correspondente à lista anterior (exemplo correspondente ao reporte de um código ISIN: "99/1").</p>
<b>País de Custódia</b>	<p>Preencher com o código ISO 3166-1 alpha-2 do país onde o ativo se encontra sob custódia.</p> <p>Se o ativo for um imóvel, preencher com o código do país onde o mesmo está localizado.</p>
<b>Código do Custodiante</b>	Preencher com o código LEI do custodiante, não devendo a célula ser preenchida no caso de o mesmo não estar disponível.
<b>Designação do Custodiante</b>	Preencher com a designação associada ao código LEI do custodiante ou, no caso de o mesmo não estar disponível, a sua designação legal.
<b>Quantidade</b>	<p>Preencher, quando aplicável, com a quantidade detida.</p> <p>Coluna não deve ser preenchida quando for reportada a variável Valor Nominal.</p>
<b>Valor Nominal</b>	<p>Preencher, quando aplicável, com o valor nominal detido.</p> <p>Coluna não deve ser preenchida quando for reportada a variável Quantidade.</p>
<b>Base de Cotação</b>	<p>Preencher com a base de cotação utilizada para cálculo do justo valor (Norma Regulamentar n.º 9/2007-R, 28 de junho):</p> <p>CF - Cotação de fecho (art.º 18 n.º 1)  SN - Sistema de negociação especializado (art.º 14 n.º 5)  VO - Valor das ofertas (art.º 19 n.º 1 alínea a)  FF - Fluxos financeiros similares (art.º 19 n.º 1 alínea b))  MA - Modelo de avaliação (art.º 19 n.º 1 alínea c))  VP - Valor patrimonial (art.º 20)  CA - Custo amortizado (art.º 24 n.º 1)  VN - Valor nominal (art.º 25, n.º1)  MC - Método comparativo - Terrenos e Edifícios (art.º 22 n.º 1 alínea a))  MR - Método de atualização das rendas futuras - Terrenos e Edifícios (art.º 22 n.º 1 alínea b))  MS - Método de substituição - Terrenos e Edifícios (art.º 22 n.º 1 alínea c))  MM - Métodos dos múltiplos do rendimento - Terrenos e Edifícios (art.º 22 n.º 1 alínea d))  O - Outro</p>
<b>Valor de Aquisição</b>	Preencher com o valor total de aquisição, sem juros decorridos.
<b>Valor Unitário</b>	Coluna não deve ser preenchida quando for reportada a variável % do Valor Nominal.
<b>% do Valor Nominal</b>	Coluna não deve ser preenchida quando for reportada a variável Valor Unitário.
<b>Juros Decorridos</b>	Introduzir os juros decorridos correspondentes a cada título quando aplicável.
<b>Grupo Económico do Associado ou da Entidade Gestora</b>	<p>Preencher consoante o grupo económico a que o emitente pertença:</p> <p>A - Associado  EG - Entidade Gestora  A/EG - Associado e Entidade Gestora  O - Outro</p>
<b>Arrendamento ao Associado</b>	Preencher com a letra A no caso de se tratar de um imóvel arrendado a uma empresa do grupo do associado.

<b>Write-offs/downs</b>	<p>Preencher com a redução do valor nominal ocorrida desde o último reporte devido a imparidade.</p> <p>A redução deve ser expressa como um valor positivo, devendo as eventuais reversões adotar um valor negativo.</p> <p>O ativo que tenha sofrido um write-off num determinado trimestre deve ser reportado nesse trimestre mesmo que tenha sido desreconhecido.</p> <p>A coluna é aplicável à categoria CIC 8 – Hipotecas e empréstimos e todos os instrumentos classificados na coluna Classificação do Instrumento SEC 2010 como “1” ou “2”.</p>
<b>Ativos</b>	
<b>Código Base</b>	<p>Preencher com o código identificativo do ativo, de acordo com a seguinte ordem de prioridades:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Código ISIN ISO 6166;</li> <li>- Outros códigos reconhecidos (ver coluna seguinte);</li> <li>- Código atribuído pela empresa, quando as opções acima não estiverem disponíveis. Este código deve ser único e coerente ao longo do tempo.</li> </ul> <p>Quando o mesmo ativo tiver de ser reportado em separado em virtude de ser emitido em duas ou mais moedas, o código base reportado deve ser acrescido do código ISO 4217 correspondente à moeda (exemplo correspondente ao reporte de um código ISIN: "ISIN+EUR").</p> <p>O código base reportado deverá estar alinhado com o utilizado na folha Informação sobre posições.</p>
<b>Tipo de Código</b>	<p>Preencher com os seguintes números, consoante a origem do código introduzido na coluna anterior:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>1 - ISIN</li> <li>2 - CUSIP</li> <li>3 - SEDOL</li> <li>4 - WKN</li> <li>5 - Bloomberg Ticker</li> <li>6 - BBGID</li> <li>7 - Reuters RIC</li> <li>8 - FIGI</li> <li>9 - Outro código de membros da ANNA</li> <li>99 - Código atribuído pela entidade</li> </ul> <p>Nos casos em que o Código Base utilizado for acrescido do código ISO 4217 correspondente à moeda, o tipo de código reportado deve ser composto pelo dígito 9 adicionado do número correspondente à lista anterior (exemplo correspondente ao reporte de um código ISIN: "99/1").</p> <p>O código base reportado deverá estar alinhado com o utilizado na folha Informação sobre posições.</p>
<b>Designação do Ativo</b>	No caso de imóveis indicar a localização dos mesmos.
<b>Designação do Emitente</b>	<p>Preencher com a designação associada ao código LEI do emitente ou, no caso de o mesmo não estar disponível, a sua designação legal.</p> <p>No caso de fundos de investimento, considera-se que o emitente é a entidade gestora do fundo.</p>
<b>Código do Emitente</b>	<p>Preencher com o código LEI do emitente, não devendo a célula ser preenchida no caso de o mesmo não estar disponível.</p> <p>No caso de fundos de investimento, considera-se que o emitente é a entidade gestora do fundo.</p>
<b>Tipo de Código do Emitente</b>	<p>Preencher com os seguintes números, consoante a informação introduzida na coluna anterior:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>1 - LEI</li> <li>9 - Nenhum</li> </ul> <p>A célula não deve ser preenchida no caso de o ativo ser um imóvel ou um empréstimo concedido a pessoa singular.</p>

<b>Setor do Emitente</b>	Preencher com o código NACE do setor económico do emitente. Com exceção das atividades correspondentes à secção K (Atividade financeiras e de seguros), para as quais é obrigatório reportar a letra identificadora da Secção seguida do código de quatro dígitos, poderá apenas ser utilizada a letra identificadora da Secção (por exemplo, para um emitente pertencente ao setor "A0111", pode ser reportado "A" ou "A0111").
<b>Grupo do Emitente</b>	Preencher com a designação associada ao código LEI da empresa-mãe de topo ou, no caso de o mesmo não estar disponível, a sua designação legal. No caso de fundos de investimento, a relação de grupo a considerar é a da entidade gestora do fundo.
<b>Código do Grupo do Emitente</b>	Preencher com o código LEI da empresa-mãe de topo, não devendo a célula ser preenchida no caso de o mesmo não estar disponível. No caso de fundos de investimento, a relação de grupo a considerar é a da entidade gestora do fundo.
<b>Tipo de Código do Grupo do Emitente</b>	Preencher com os seguintes números, consoante a informação introduzida na coluna anterior: 1 - LEI 9 - Nenhum
<b>País do Emitente</b>	Preencher com o código ISO 3166-1 alpha 2 do país de localização do emitente. Para entidades supranacionais ou instituições pertencentes à União Europeia devem ser utilizados, respetivamente, os códigos "XA" e "UE". No caso de fundos de investimento, a relação de grupo a considerar é a da entidade gestora do fundo.
<b>Moeda</b>	Preencher com o código ISO 4217 da moeda da emissão.
<b>CIC</b>	Preencher com o código de identificação complementar previsto no Regulamento de Execução (UE) 2015/2450 da Comissão, de 2 de dezembro de 2015.
<b>Organismo de Investimento Alternativo</b>	Preencher com os seguintes números, consoante se trate de um organismo de investimento alternativo: 1 - OIA 2 - Não OIA  A célula não deve ser preenchida se o ativo não for um organismo de investimento coletivo.
<b>Não Cotado</b>	Preencher consoante se trate de um valor mobiliário admitido à negociação para efeitos do disposto na alínea a) do n.º 1 do artigo 12.º da Norma Regulamentar n.º 9/2007-R, de 28 de junho: C - Cotado NC - Não cotado
<b>Notação Externa do Risco de Crédito</b>	Preencher com a notação do risco de crédito atribuída ao ativo à data a que se reporta a informação, emitida pela instituição de avaliação de crédito ("ECAI").

<b>ECAI</b>	<p>Preencher com a instituição de avaliação de crédito ("ECAI") que emite a notação externa, utilizando uma das opções da lista seguinte:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1 - Euler Hermes Rating GmbH (LEI code: 391200QXGLWHK9VK6V27)</li> <li>2 - Japan Credit Rating Agency Ltd (LEI code: 35380002378CEGMRVW86)</li> <li>3 - BCRA-Credit Rating Agency AD (LEI code: 747800Z0IC3P66HTQ142)</li> <li>4 - Creditreform Rating AG (LEI code: 391200PHL11KDUTTST66)</li> <li>5 - Scope Ratings GmbH (previously Scope Ratings AG and PSR Rating GmbH)(LEI code: 391200WU1EZUQFHDWE91)</li> <li>6 - ICAP Group SA (LEI code: 2138008U6LKT8VVG2UK85)</li> <li>7 - GBB-Rating Gesellschaft für Bonitätsbeurteilung GmbH (LEI code: 391200OLWXCTKPADVV72)</li> <li>8 - ASSEKURATA Assekuranz Rating-Agentur GmbH (LEI code: 529900977LETWLJF3295)</li> <li>9 - ARC Ratings, S.A. (previously Companhia Portuguesa de Rating, S.A) (LEI code: 213800OZJQMV6UA7D79)</li> <li>10 - AM Best Europe-Rating Services Ltd. (AMBERS) (LEI code: 549300VO8J8E5IQV1T26)</li> <li>11 - DBRS Ratings Limited (LEI code: 5493008CGCDQLGT3EH93)</li> <li>12 - Fitch (to be used when the split below is not available)</li> <li>13 - Fitch France S.A.S. (LEI code: 2138009Y4TCZT6QOJO69)</li> <li>14 - Fitch Deutschland GmbH (LEI code: 213800JEMOT1H45VN340)</li> <li>15 - Fitch Italia S.p.A. (LEI code: 213800POJ9QSCHL3KR31)</li> <li>16 - Fitch Polska S.A. (LEI code: 213800RYJTJPW2WD5704)</li> <li>17 - Fitch Ratings España S.A.U. (LEI code: 213800RENFIIODKETE60)</li> <li>18 - Fitch Ratings Limited (LEI code: 2138009F8YAHVC8W3Q52)</li> <li>19 - Fitch Ratings CIS Limited (LEI code: 213800B7528Q4DIF2G76)</li> <li>20 - Moody's (to be used when the split below is not available)</li> <li>21 - Moody's Investors Service Cyprus Ltd (LEI code: 549300V4LCOYCMNUVR81)</li> <li>22 - Moody's France S.A.S. (LEI code: 549300EB2XQYRSE54F02)</li> <li>23 - Moody's Deutschland GmbH (LEI code: 549300M5JMGHVTWYZH47)</li> <li>24 - Moody's Italia S.r.l. (LEI code: 549300GMXJ4QK70UOU68)</li> <li>25 - Moody's Investors Service España S.A. (LEI code: 5493005X59ILY4BGJK90)</li> <li>26 - Moody's Investors Service Ltd (LEI code: 549300SM89WABHDNJ349)</li> <li>27 - Standard &amp; Poor's (to be used when the split below is not available)</li> <li>28 - S&amp;P Global Ratings France SAS (LEI code: 54930035REY2YCD5BH09)</li> <li>29 - S&amp;P Global Ratings Europe Limited (previously S&amp;P Global Ratings Italy S.r.l, LEI 54930000NMOJ7ZBUQ063 – merger of 1 May 2018)(LEI code:5493008B2TU3S6QE1E12)</li> <li>30 - S&amp;P Global Ratings Italy S.R.L. (LEI code: 54930000NMOJ7ZBUQ063)</li> <li>31 - Standard &amp; Poor's Credit Market Services Europe Limited (LEI code: 549300363WVTTH0TW460)</li> <li>32 - CRIF Ratings S.r.l. (previously CRIF S.p.a.) (LEI code: 8156001AB6A1D740F237)</li> <li>33 - Capital Intelligence Ratings Ltd (LEI code: 549300RE88OJP9J24Z18)</li> <li>34 - European Rating Agency, a.s. (LEI code: 097900BFME0000038276)</li> <li>35 - Axesor Risk Management SL (LEI code: 959800EC2RH76JYS3844)</li> <li>36 - Axesor conocer para decidir SA (LEI code: 95980020140005900000)</li> <li>37 - Cerved Rating Agency S.p.A. (previously CERVED Group S.p.A. ) (LEI code: 8156004AB6C992A99368)</li> <li>38 - Kroll Bond Rating Agency (LEI code: 549300QYZ5CZYXTNZ676)</li> <li>39 - The Economist Intelligence Unit Ltd (LEI code: 213800Q7GRZWF95EWN10)</li> <li>40 - Dagong Europe Credit Rating Srl (Dagong Europe) (LEI code: 815600BF4FF53B7C6311)</li> <li>41 - Spread Research (LEI code: 969500HB6BVM2UJDOC52)</li> <li>42 - EuroRating Sp. z o.o. (LEI code: 25940027QWS5GMO74O03)</li> <li>43 - HR Ratings de México, S.A. de C.V. (HR Ratings) (LEI code: 549300IFL3XJKTRHZ480)</li> </ol>
-------------	---

	<p>44 - Moody's Investors Service EMEA Ltd (LEI code: 54930009NU3JYS1HTT72) 45 - Egan-Jones Ratings Co. (EJR) (LEI code: 54930016113PD33V1H31) 46 - modeFinance S.r.l. (LEI code: 815600B85A94A0122614) 47 - INC Rating Sp. z o.o. (LEI code: 259400SUBF5EPOGK0983) 48 - Rating-Agentur Expert RA GmbH (LEI code: 213800P3OOBSGWN2UE81) 49 - Kroll Bond Rating Agency Europe Limited (LEI code: 5493001NGHOLC41ZSK05) 50 - SPMW Rating Sp. z o.o. (LEI code: 259400PIF3W6YC660564) 51 - Other nominated ECAI 52 - Multiple ECAI</p>
--	---

<b>Tipo de Cupão</b>	Preencher com o tipo de taxa do cupão: CZ - Cupão Zero TF - Taxa Fixa TV - Taxa Variável
<b>Duração</b>	Preencher com a duração modificada residual do ativo à data a que se reporta a informação. No caso de ativos sem maturidade fixa, deve ser utilizada a data da primeira call.
<b>Maturidade</b>	Preencher com o código ISO 8601 (aaaa-mm-dd) da data da maturidade. No caso de obrigações perpétuas, utilizar "9999-12-31".
<b>Setor do Emitente SEC 2010</b>	<p>Preencher com o setor económico da contraparte com base na classificação definida pelo sistema europeu de contas (SEC 2010) estabelecido pelo Regulamento (UE) n.º 549/2013, do Parlamento Europeu e do Conselho, de 21 de maio de 2013.</p> <p>Esta coluna é aplicável à categoria CIC 8 – Hipotecas e empréstimos e às seguintes categorias CIC nos casos em que o ativo não é identificado com código ISIN: 1, 2, 3, 5, 6 e 7.</p> <p>Deve ser utilizada uma das opções constantes da seguinte lista, exceto para a Categoria CIC 7:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1 - Banco Central (SEC S.121)</li> <li>2 - Entidades depositárias exceto banco central (SEC S.122)</li> <li>3 - Fundos do mercado monetário (SEC S.123)</li> <li>4 - Fundos de investimento exceto fundos do mercado monetário (SEC S.124)</li> <li>5 - Outros intermediários financeiros exceto empresas de seguros e fundos de pensões, excluindo veículos financeiros envolvidos em operações de titularização (FVC), auxiliares financeiros, instituições financeiras cativas e prestamistas (SEC S.125 excluindo FVC, SEC S.126 e SEC S.127)</li> <li>6 - Veículos financeiros envolvidos em operações de titularização (FVC) (subdivisão do SEC S.125)</li> <li>7 - Empresas de seguros (SEC S.128)</li> <li>8 - Fundos de pensões (SEC S.129)</li> <li>9 - Sociedades não financeiras (SEC S.11)</li> <li>10 - Administrações públicas (SEC S.13)</li> <li>11 - Famílias e instituições sem fim lucrativo ao serviço das famílias (SEC S.14 + SEC S.15)</li> </ol> <p>Deve ser utilizada uma das opções constantes da seguinte lista para a Categoria CIC 7:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>12 - Banco Central (SEC S.121), Entidades depositárias exceto banco central (SEC S.122) e Fundos do mercado monetário (SEC S.123)</li> <li>13 - Sociedades não financeiras, não incluídas na opção 12</li> </ol>
<b>País de Residência do OIC</b>	Preencher com o código ISO 3166-1 alpha 2 do país onde o organismo de investimento coletivo se encontra autorizado ou licenciado. A coluna apenas é aplicável à categoria CIC 4 - Organismos de investimento coletivo e nos casos em que o ativo não é identificado com código ISIN.

<p><b>Classificação do Instrumento SEC 2010</b></p>	<p>Preencher com identificação dos instrumentos que são classificados com instrumentos de dívida ou de capital para efeitos de comunicação de informação prudencial, mas que podem ser classificados de forma diferente para efeitos de comunicação de informação estatística.</p> <p>Deve ser utilizada uma das opções constantes da seguinte lista:</p> <p>1 - Notas de dívida (i), títulos de dívida não negociáveis (ii) ou títulos do mercado monetário não negociáveis (iii)</p> <p>2 - Obrigações registadas (no sentido das “Namensschuldverschreibungen”, “N-bonds” ou instrumentos equivalentes)</p> <p>3 - Títulos de participação registados (v) ou direitos de subscrição (vi)</p> <p>9 - Qualquer outro instrumento</p> <p>Esta coluna é aplicável às categorias CIC 1, 2, 3, 5 e 6.</p> <p>Os itens (i), (ii) e (iii) são classificados como empréstimos/depósitos para efeitos estatísticos, de acordo com o Regulamento BCE.</p> <p>A classificação para efeitos estatísticos do item (iv) depende das características específicas do instrumento em causa.</p> <p>Os itens (v) e (vi) são classificados como instrumentos de capital de acordo com o Regulamento BCE. A sua identificação, tal como reportado nesta coluna, pode ser utilizada para efeitos do Regulamento (UE) n.º 1011/2012, do Banco Central Europeu, de 17 de outubro de 2012, relativo a estatísticas sobre detenções de títulos.</p>
<p><b>Data de Emissão</b></p>	<p>Preencher com a data em que o instrumento foi emitido.</p> <p>Esta coluna é aplicável à categoria CIC 8 – Hipotecas e empréstimos e às seguintes categorias CIC nos casos em que o ativo não é identificado com código ISIN: 1, 2, 5 e 6.</p> <p>Para as hipotecas e empréstimos a pessoas singulares incluídos na categoria CIC 8, deve ser comunicada a data de emissão média ponderada, calculada com base nos montantes das hipotecas e empréstimos.</p>
<p><b>Data do Split</b></p>	<p>Preencher com a data em que a operação de divisão do instrumento de capital ocorreu.</p> <p>As operações de divisão de instrumentos de capital consistem em aumentar o número de instrumentos existentes, reduzindo o seu valor de forma proporcional.</p> <p>Esta coluna é aplicável às Categorias CIC 3 e 4.</p>
<p><b>Fator do Split</b></p>	<p>Preencher com o quociente entre o número de instrumentos de capital após a divisão e o número de instrumentos de capital antes da divisão, quando o instrumento de capital tenha sofrido uma operação de divisão.</p> <p>Esta coluna é aplicável às Categorias CIC 3 e 4.</p>
<p><b>Descrição Derivados</b></p>	
<p>Este mapa deverá ser preenchido com os contratos que estejam em aberto no final do trimestre e com os contratos que vigoraram durante o trimestre.</p>	
<p><b>LEI</b></p>	<p>Identificador de Entidade Jurídica do fundo de pensões. Código alfanumérico de 20 caracteres baseado na norma ISO 17442 desenvolvida pela Organização Internacional de Normalização (ISO), que permite identificar de forma clara e única entidades que participam em transações financeiras e os dados de referência associados</p>
<p><b>Nº de contrato</b></p>	<p>Deverá ser um número sequencial, único para cada contrato de produto derivado e caso o contrato chegue à sua maturidade este não deve ser reutilizado.</p>

<b>Código base do derivado</b>	Preencher com o código base utilizado para o derivado nas folhas Informação sobre posições e Informação sobre ativos.
<b>Designação do código</b>	Preencher com os seguintes números, consoante a origem do código introduzido na coluna anterior: 1 - ISIN 2 - CUSIP 3 - SEDOL 4 - WKN 5 - Bloomberg Ticker 6 - BBGID 7 - Reuters RIC 8 - FIGI 9 - Outro código de membros da ANNA 99 - Código atribuído pela entidade
<b>CIC</b>	Preencher com o código de identificação complementar previsto no Regulamento de Execução (UE) 2015/2450 da Comissão, de 2 de dezembro de 2015
<b>LEI da Contraparte</b>	Identificador de Entidade Jurídica da contraparte. Código alfanumérico de 20 caracteres baseado na norma ISO 17442 desenvolvida pela Organização Internacional de Normalização (ISO), que permite identificar de forma clara e única entidades que participam em transações financeiras e os dados de referência associados
<b>Designação da Contraparte</b>	Preencher com a designação associada ao código LEI do emitente ou, no caso de o mesmo não estar disponível, a sua designação legal.
<b>Data da operação</b>	Preencher com a data de aquisição do contrato no formato DD-MM-AAAA.
<b>Vencimento</b>	Data de vencimento do contrato no formato DD-MM-AAAA
<b>Derivado incorporado</b>	Preencher com DI quando se trate de um derivado incorporado.
<b>Designação do contrato</b>	Denominação do contrato de uma série, indicando a bolsa onde foi negociado e o ativo subjacente
<b>Classificação do contrato</b>	Preencher com a classificação do contrato (Norma Regulamentar n.º 9/2007-R, 28 de junho): CVP - Cobertura de variação preço (art.º 8.º n.º 1 alínea a)) CAF - Cobertura de aquisições futuras (art.º 8.º n.º 1 alínea b)) CVR - Cobertura de variabilidade dos rendimentos (art.º 8.º n.º 1 alínea c)) CAM - Cobertura de risco cambial (art.º 8.º n.º 1 alínea d)) CRC - Cobertura de risco de crédito (art.º 8.º n.º 1 alínea e)) CNF - Cobertura da variabilidade do nível de financiamento do fundo (art.º 8.º n.º 1 alínea f)) CAP - Cobertura de não adequação entre ativo e o passivo (art.º 7.º n.º 3) RSA - Réplica sem alavancagem (art.º 7.º n.º 2) GAR - Gestão agregada dos riscos (art.º 7.º n.º 2 e art.º 9.º) GEC - Gestão eficaz da carteira, excluindo RSA e GAR
<b>Valor nocional</b>	Preencher com o valor nocional do contrato. No caso de futuros e opções, deverá corresponder à multiplicação do número de contratos pela sua dimensão e preço de referência. O valor deve ser sempre positivo.
<b>Posição líquida (C / V)</b>	Preencher com a posição assumida: C - compradora V - vendedora  No caso de contratos forward cambiais indicar posição face à divisa do valor nocional.
<b>Exposição ao risco do (D/A)</b>	Preencher com o objetivo da exposição ao principal tipo de risco do derivado: D - Decréscimo de exposição ao risco A - Acréscimo de exposição ao risco
<b>Dimensão do contrato</b>	Preencher com o número de unidades envolvido em cada contrato (por exemplo, em futuros sobre ações) ou, quando aplicável, com o valor nominal (por exemplo, em futuros sobre taxas de juro, divisas ou índices 'monetizados').

<b>Preço referência / Preço de exercício / Taxa de câmbio / Taxa de juro</b>	Preencher de acordo com o tipo de derivado: - O Preço de referência; ou - O preço do exercício; ou - A taxa de câmbio contratada (definida por unidade de divisa do valor nocional) - A taxa de juro contratada
<b>Medida de sensibilidade</b>	Preencher com a medida de sensibilidade do ativo coberto face ao derivado, à data de referência de prestação da informação. Exemplos: - Delta da opção para puts e calls; - Beta da ação para futuros de índices; - Rácio entre duração modificada do ativo coberto e duração modificada do ativo subjacente para futuros sobre taxa de juro.
<b>Prémio / Desconto</b>	Preencher com o prémio (valor positivo) ou Desconto (valor negativo) no início do contrato.
<b>Taxa cedida</b>	No caso de uma taxa variável, este campo deve ser preenchido com designação do indexante + valor do spread (exemplo: EUR3M+1%).  Deverá tanto quanto possível ser respeitado o exemplo acima, ou seja, o campo deverá ser preenchido com: NOMEINDEXANTE+SPREAD (sem espaços)
<b>Divisa do preço</b>	Preencher, quando estão em causa contratos cambiais, com o código ISO 4217 da divisa em que o preço do contrato está expresso.
<b>Taxa tomada</b>	No caso de uma taxa variável, este campo deve ser preenchido com designação do indexante + valor do spread (exemplo: EUR3M+1%).  Deverá tanto quanto possível ser respeitado o exemplo acima, ou seja, o campo deverá ser preenchido com: NOMEINDEXANTE+SPREAD (sem espaços)
<b>Divisa do valor nocional</b>	Preencher, quando estão em causa contratos cambiais, com o ISO 4217 da divisa do valor nocional em que o contrato está expresso.
<b>Data vencimento dos juros da taxa cedida</b>	Data da próxima liquidação de juros
<b>Data vencimento dos juros da taxa tomada</b>	Data da próxima liquidação de juros
<b>Prazo de diferimento</b>	Preencher com o prazo em meses.
<b>Prazo da taxa de juro</b>	Preencher com o prazo da taxa de juro contratada em dias
<b>Operações Reporte</b>	
<b>LEI</b>	Identificador de Entidade Jurídica do fundo de pensões. Código alfanumérico de 20 caracteres baseado na norma ISO 17442 desenvolvida pela Organização Internacional de Normalização (ISO), que permite identificar de forma clara e única entidades que participam em transações financeiras e os dados de referência associados
<b>LEI da Contraparte</b>	Identificador de Entidade Jurídica da contraparte. Código alfanumérico de 20 caracteres baseado na norma ISO 17442 desenvolvida pela Organização Internacional de Normalização (ISO), que permite identificar de forma clara e única entidades que participam em transações financeiras e os dados de referência associados
<b>Designação da Contraparte</b>	Preencher com a designação associada ao código LEI do emitente ou, no caso de o mesmo não estar disponível, a sua designação legal.
<b>Data da operação</b>	Preencher com a data de aquisição do contrato no formato DD-MM-AAAA.
<b>Vencimento</b>	Preencher com a data de vencimento do contrato no formato DD-MM-AAAA.
<b>Código base</b>	Preencher com o código identificativo do ativo tomado/cedido, de acordo com a seguinte ordem de prioridades: - Código ISIN ISO 6166; - Outros códigos reconhecidos (ver coluna seguinte); - Código atribuído pela empresa, quando as opções acima não estiverem disponíveis. Este código deve ser único e coerente ao longo do tempo.

<b>Tipo de código</b>	Preencher com os seguintes números, consoante a origem do código introduzido na coluna anterior: 1 - ISIN 2 - CUSIP 3 - SEDOL 4 - WKN 5 - Bloomberg Ticker 6 - BBGID 7 - Reuters RIC 8 - FIGI 9 - Outro código de membros da ANNA 99 - Código atribuído pela entidade
<b>Designação do Ativo</b>	Preencher com a quantidade ou o montante do valor nominal negociado no contrato de reporte.
<b>Quantidade / Montante Valor Nominal</b>	Preencher com a quantidade ou o montante do valor nominal negociado no contrato de reporte.
<b>Direitos Económicos</b>	Preencher com o valor dos direitos económicos, se estes ocorrerem no período de reporte, dos títulos objeto do contrato
<b>Montante</b>	Preencher com o montante recebido/entregue com a celebração do contrato
<b>Posição (C / V)</b>	Preencher com a posição assumida pelo fundo de pensões: compradora (C) ou vendedora (V). Se o fundo de pensões assumir a posição compradora, isso significa que assume a posição de tomadora de títulos na abertura da operação
<b>Repos Empréstimos de Valores FP - Empréstimo de valores</b>	
<b>LEI</b>	Identificador de Entidade Jurídica do fundo de pensões. Código alfanumérico de 20 caracteres baseado na norma ISO 17442 desenvolvida pela Organização Internacional de Normalização (ISO), que permite identificar de forma clara e única entidades que participam em transações financeiras e os dados de referência associados
<b>LEI da Contraparte</b>	Identificador de Entidade Jurídica da contraparte. Código alfanumérico de 20 caracteres baseado na norma ISO 17442 desenvolvida pela Organização Internacional de Normalização (ISO), que permite identificar de forma clara e única entidades que participam em transações financeiras e os dados de referência associados
<b>Designação da Contraparte</b>	Preencher com a designação associada ao código LEI do emitente ou, no caso de o mesmo não estar disponível, a sua designação legal.
<b>Data da Operação</b>	Preencher com a data de aquisição do contrato no formato DD-MM-AAAA.
<b>Vencimento</b>	Preencher com a data de vencimento do contrato no formato DD-MM-AAAA.
<b>Código Base</b>	Preencher com o código identificativo do ativo tomado/cedido, de acordo com a seguinte ordem de prioridades: - Código ISIN ISO 6166; - Outros códigos reconhecidos (ver coluna seguinte); - Código atribuído pela empresa, quando as opções acima não estiverem disponíveis. Este código deve ser único e coerente ao longo do tempo.
<b>Tipo de Código</b>	Preencher com os seguintes números, consoante a origem do código introduzido na coluna anterior: 1 - ISIN 2 - CUSIP 3 - SEDOL 4 - WKN 5 - Bloomberg Ticker 6 - BBGID 7 - Reuters RIC 8 - FIGI 9 - Outro código de membros da ANNA 99 - Código atribuído pela entidade
<b>Natureza do Ativo</b>	Preencher com a natureza dos valores emprestados: obrigacionista ou acionista.

<b>Designação do Ativo</b>	Preencher com a denominação do valor mobiliário ou conjunto de valores mobiliários subjacentes ao contrato.
<b>Quantidade / Montante Valor Nominal</b>	Preencher com a quantidade ou o montante do valor nominal dos valores emprestados
<b>Direitos Económicos</b>	Preencher com o valor dos direitos económicos se estes ocorrerem no período do empréstimo.
<b>Código Base</b>	Preencher com o código identificativo do ativo tomado/cedido, de acordo com a seguinte ordem de prioridades: - Código ISIN ISO 6166; - Outros códigos reconhecidos (ver coluna seguinte); - Código atribuído pela empresa, quando as opções acima não estiverem disponíveis. Este código deve ser único e coerente ao longo do tempo.
<b>Tipo de Código</b>	Preencher com os seguintes números, consoante a origem do código introduzido na coluna anterior: 1 - ISIN 2 - CUSIP 3 - SEDOL 4 - WKN 5 - Bloomberg Ticker 6 - BBGID 7 - Reuters RIC 8 - FIGI 9 - Outro código de membros da ANNA 99 - Código atribuído pela entidade
<b>Designação do Ativo</b>	Preencher com a denominação do valor mobiliário ou conjunto de valores mobiliários subjacentes ao contrato.
<b>Quantidade / Montante Valor Nominal</b>	Preencher com a quantidade ou o montante do valor nominal da garantia
<b>Direitos Económicos</b>	Preencher com o valor dos direitos económicos se estes ocorrerem no período do empréstimo.