

## PARECER/2022/5

### I. Pedido

1. A Comissão do Mercado de Valores Mobiliários (doravante designada CMVM) submeteu à Comissão Nacional de Proteção de Dados (doravante, CNPD), para parecer, o projeto de Regulamento sobre o reporte de informação pelas Centrais de Valores Mobiliários relativa às falhas de liquidação.

2. A CNPD emite parecer no âmbito das suas atribuições e competências enquanto autoridade administrativa independente com poderes de autoridade para o controlo dos tratamentos de dados pessoais, conferidos pela alínea c) do n.º 1 do artigo 57.º, conjugado com a alínea b) do n.º 3 do artigo 58.º, e com o n.º 4 do artigo 36.º, todos do Regulamento (UE) 2016/679, de 27 de abril de 2016 – Regulamento Geral sobre a Proteção de Dados (doravante RGPD), em conjugação com o disposto no artigo 3.º, no n.º 2 do artigo 4.º, e na alínea a) do n.º 1 do artigo 6.º, todos da Lei n.º 58/2019, de 8 de agosto, que executa na ordem jurídica interna o RGPD.

### II. Análise

3. Nos termos do disposto no n.º 1 do artigo 7.º do Regulamento (UE) n.º 909/2014, do Parlamento Europeu e do Conselho, de 23 de julho de 2014, relativo à melhoria de liquidação de valores mobiliários na União Europeia e às Centrais de Valores Mobiliários (doravante, CSDR) as Centrais de Valores Mobiliários devem estabelecer, para cada sistema de liquidação de valores mobiliários que gerem, um sistema que controle as falhas de liquidação dos instrumentos financeiros a que se refere o n.º 1 do artigo 5.º do CSDR.

4. Por sua vez, o artigo 14.º do Regulamento Delegado (UE) 2018/1229 da Comissão, de 25 de maio de 2018, que complementa o Regulamento (UE) n.º 909/2014, do Parlamento Europeu e do Conselho, define que as Centrais de Valores Mobiliários (doravante CSD) deverão apresentar à CMVM relatórios periódicos, mensais e anuais, com o número de falhas de liquidação e informação sobre as mesmas, bem como outras informações pertinentes incluindo as medidas previstas para melhorar a eficiência da liquidação. Posteriormente, a CMVM procederá à comunicação da referida informação à Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados (ESMA) nos termos do n.º 1 do artigo 7.º do CSDR.

5. Com a aplicação em Portugal, a partir de 1 de fevereiro de 2022, do Regulamento Delegado (UE) n.º 2018/1229 da Comissão, torna-se necessário *complementar a regulamentação europeia, de forma a operacionalizar as comunicações entre a CMVM e as CSD*, em particular quanto ao formato do ficheiro a ser enviado com os dados sobre as falhas de liquidação, nos termos do n.º 1 do artigo 7.º do Regulamento (UE) n.º 909/2014, e Anexos I e II do Regulamento Delegado (UE) 2018/1229, de modo a que estas possam, a partir dessa data, efetuar o reporte do número de falhas de liquidação, bem como outras informações

pertinentes incluindo as medidas previstas pelas CSD e pelos seus participantes para melhorar a eficiência da liquidação.

6. Note-se que os Anexos I e II do Regulamento Delegado (UE) 2018/1229, nos n.ºs 7 a 10 preveem, respetivamente, o tratamento dos seguintes dados pessoais: nome, função, número de telefone e endereço de correio eletrónico da pessoa responsável pela comunicação enviada pela CSD. Tais dados são necessários à finalidade do tratamento em cumprimento do princípio da minimização de dados previsto nas alíneas b) e c) do n.º 1 do artigo 5.º do RGPD. O fundamento de licitude reside, assim, no cumprimento de uma obrigação legal nos termos da alínea c) do n.º 1 do artigo 6.º do RGPD.

7. O presente projeto de regulamento visa definir a forma e o conteúdo da comunicação mensal e anual à CMVM, pelas Centrais de Valores Mobiliários, de informações relativas a falhas de liquidação.

8. Assim, o artigo 2.º do projeto dispõe que *as comunicações são prestadas através de acesso ao domínio da extranet da CMVM, mediante o envio de um ficheiro informático elaborado em conformidade com as regras de conteúdo e forma constantes do Anexo 1*, devendo as Centrais de Valores Mobiliário validar que a informação foi devidamente submetida e aceite sem erros. *Estas entidades devem obter a informação necessária para cumprimento dos deveres de comunicação à CMVM, incluindo o código de reporte atribuído pela CMVM e as permissões de acesso ao sistema de transferência de ficheiro da CMVM conforme consta do Regulamento da CMVM n.º 3/2016.*

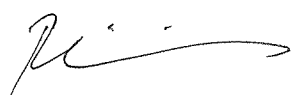
9. Quanto às especificações técnicas relativas ao formato do ficheiro a ser enviado com os dados sobre as falhas de liquidação, constantes do Anexo 1 do projeto de regulamento, a CNPD nada tem a observar.

10. Todavia, a CNPD não pode deixar de assinalar a ausência de previsão no projeto de elementos essenciais dos tratamentos dos dados pessoais resultantes da sua aplicação, em especial o prazo de conservação dos dados e as medidas de segurança a adotar.

### III. Conclusão

11. Nos termos e com os fundamentos expostos a CNPD recomenda a definição de prazo de conservação dos dados pessoais e das medidas de segurança a adotar.

Aprovado na sessão de 19 de janeiro de 2022



Filipa Calvão (Presidente)