

SISTEMA DE TRANSFERÊNCIA DE DADOS - STD

Reportes de Penalidades - Layouts

Versão 1.0

Sistema de Transferência de Dados

Introdução	2
Layout dos Ficheiros	3
Ficheiros de receção.....	3
PENSEC - Valores Mobiliários sujeitos a Penalidades	3
PENDAGGR - Informação Diária Agregada das Penalidades	4
PENDDETL - Informação Diária do Detalhe das Penalidades.....	6
PENDCALC - Informação Diária do Cálculo das Penalidades.....	10
PENMAGGR - Informação Mensal Agregada das Penalidades.....	13
PENMDETL - Informação Mensal do Detalhe das Penalidades	14
PENMPAYM - Informação Mensal - Previsão do Pagamento das Penalidades	16
PENMOAGR - Informação agregada das Penalidades Modificadas	17
PENMODTL - Informação do Detalhe das Penalidades Modificadas	18
PENMOCAL - Informação do Cálculo das Penalidades Modificadas	21
PENAPfil/PENAPmsg – Pedido das Penalidades a Modificar (Ficheiro/Mensagem)	23
PENAP – Mensagem com o Pedido das Penalidades a Modificar	25

Introdução

Com a entrada em vigor a 01 de fevereiro 2022, do Regime da Disciplina da Liquidação, serão disponibilizados novos ficheiros com a informação diária e mensal relativa às penalidades e respetivo cálculo, aplicada às instruções sujeitas a penalidades definidas no Regime da Disciplina da Liquidação (*SDR - Settlement Discipline Regime*).

Layout dos Ficheiros

Ficheiros de receção

PENSEC - Valores Mobiliários sujeitos a Penalidades

Mnemónica = PENSEC

Denominação = VALORES MOBILIÁRIOS SUJEITOS A PENALIDADES

Menu = Penalidades

Descrição = Este ficheiro contém a lista dos valores mobiliários sujeitos a penalidades no dia de liquidação anterior

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
13	09	A	Cod-CVM	Identificação do Valor Mobiliário - Código CVM
22	08	D	Data Inf.	Data a que se reporta a informação - formato AAAAMMDD

PENDAGGR - Informação Diária Agregada das Penalidades

Mnemónica = **PENDAGGR**

Denominação = Penalidades Diárias - Agregada

Menu = Penalidades

Descrição = Este ficheiro contém informação diária agregada relativa às penalidades aplicadas às instruções pendentes de liquidação após a data de liquidação contratada - ISD.

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	A	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número sequencial do ficheiro
10	03	A	Moeda Penalidades	Moeda das penalidades reportadas Código da moeda de acordo com ISO 4217
13	08	D	Data Penalidades	Data das penalidades reportadas - formato AAAAMMDD Data de deteção das novas penalidades reportadas, idêntica para todas as penalidades
21	11	A	Part.(BIC)	Identificação do Participante: BIC (11 dígitos) Reportado de acordo com a parte faltosa (parte com falha) ou parte creditada (parte sem falha) relativa às penalidades reportadas
32	11	A	CSD-CP(BIC)	CSD Contraparte - BIC BIC primário da CSD da contraparte da(s) nova(s) penalidade(s) reportado(s): BIC (11 dígitos)
43	03	A	Part-CP	Identificação do Participante-Contraparte: Código da Interbolsa (3 dígitos)
46	11	A	Part-CP(BIC)	BIC da contraparte da(s) nova(s) penalidade(s) reportada(s): BIC (11 dígitos)
57	04	A	Tipo-CP	Tipo - Contraparte Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'NCSD' - Central de Valores Mobiliários 'CCPA' - CCP (Contraparte Central) 'CSDP' - Participante da CSD 'EXTE' - Depositário externo
61	12+02	N	Montante-Líquido Agreg.Diário	Montante líquido agregado diário bilateral entre um participante e a Contraparte correspondente, com duas casas decimais
75	03	A	Moeda-Mont-Líquido	Moeda relativa ao montante líquido agregado diário Código da moeda de acordo com a ISO 4217
78	04	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> "DBIT" - Débito do montante líquido agregado diário aplicado ao faltoso "CRDT" - Crédito do montante líquido agregado

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				<p>diário a receber pelo lesado</p> <ul style="list-style-type: none">• " " (em branco) - não informado se montante líquido agregado diário for zero

PENDETL - Informação Diária do Detalhe das Penalidades

Mnemónica = PENDETL

Denominação = Penalidades Diárias - Detalhe

Menu = Penalidades

Descrição = Este ficheiro contém informação diária relativa ao detalhe das penalidades aplicadas às instruções pendentes de liquidação após a data de liquidação contratada - ISD.

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	A	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número sequencial do ficheiro
10	03	A	Moeda Penalidades	Moeda das penalidades reportadas Código da moeda de acordo com ISO 4217
13	08	D	Data Penalidades	Data das penalidades reportadas - formato AAAAMMDD Data de deteção das novas penalidades reportadas, idêntica para todas as penalidades
21	11	A	Part.(BIC)	Identificação do Participante: BIC (11 dígitos) Reportado de acordo com parte faltosa (parte com falha) ou parte creditada (parte sem falha) relativa às penalidades reportadas
32	11	A	CSD-CP(BIC)	CSD Contraparte - BIC BIC primário da CSD da contraparte da(s) nova(s) penalidade(s) reportado(s): BIC (11 dígitos)
43	03	A	Part-CP	Identificação do Participante-Contraparte: Código da Interbolsa (3 dígitos)
46	11	A	Part-CP(BIC)	BIC da contraparte da(s) nova(s) penalidade(s) reportada(s): BIC (11 dígitos)
57	16	A	T2S-Match-Ref Penalidade	O ID comum fornecido terá um comprimento de 15 dígitos, construído da seguinte forma: YYMMDDGGGGGGGGGS <ul style="list-style-type: none"> • Y - ano • M - mês • D - dia • G - número sequencial, sendo o limite superior 999.999.999 • S - espaço
73	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
85	16	A	T2S-Ref-Penalidade	Referência atribuída pelo T2S que é a identificação individual da penalidade para o proprietário relevante da conta
101	04	A	Tipo-Penalidade	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • 'SEFP' - <i>Settlement Fail Penalty</i>

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				<ul style="list-style-type: none"> 'LMFP' - <i>Late Matching Fail Penalty</i>
105	04	A	Estado-Penalidade	Estado da Penalidade: <ul style="list-style-type: none"> 'ACTV' - Activa 'REMO' - Removida 'NCOM' - Não processada
109	12+02	N	Montante-Penalidade	Montante da penalidade processado, com duas casas decimais
123	03	A	Moeda-Penalidade	Moeda da penalidade reportada Código da moeda de acordo com ISO 4217
126	04	A	D/C(Penalidade)	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> "DBIT" - Débito do montante líquido agregado diário aplicado ao faltoso "CRDT" - Crédito do montante líquido agregado diário a receber pelo lesado " " (em branco) - não informado se montante líquido agregado diário for zero
130	04	A	Método-cálculo	Regra de cálculo usada para calcular a penalidade: <ul style="list-style-type: none"> 'SECU' - a penalidade é baseada na quantidade de títulos que não foi entregue e na taxa de penalidade do tipo de ativo de valor mobiliário relevante 'MIXE' - A penalidade é baseada na quantidade de títulos que não foi entregue e a taxa de penalidade é a taxa de desconto da moeda relevante 'CASH' - A penalidade é baseada no montante que não foi entregue e a taxa de penalidade é a taxa de desconto da moeda relevante 'BOTH' - A penalidade é a soma do SECU e do CASH, ou seja, a soma: <ul style="list-style-type: none"> - da penalidade com base na quantidade de títulos que não foi entregue e a taxa de penalidade do tipo de ativo de valor mobiliário relevante; e - da penalidade com base na quantidade de dinheiro que não foi entregue e na taxa de desconto da moeda
134	04	N	Num-Dias	O número de dias que a penalidade é aplicável: <ul style="list-style-type: none"> 'SEFPs' - é sempre 1 dia 'LMFPs' - é o número de dias úteis em que a penalidade se aplica
138	16	A	Referência-Part.	Referência atribuída pelo participante à Instrução de Liquidação se nenhum: 'NONREF'
154	16	A	Referência-IB	Referência da Interbolsa Referência atribuída pela CSD à Instrução de Liquidação se nenhum: 'NONREF'
170	16	A	Referência-Proc.	Referência atribuída por Terceiro à Instrução de

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				Liquidação (Referência do Processador de Transações) se nenhum: NONREF
186	16	A	Referência-T2S	Referência do T2S
202	16	A	Ref-Comum	Referência atribuída pelo <i>T2S Actor</i> quando a Instrução LCMM já está <i>matched</i> ou para facilitar o <i>matching</i> no T2S
218	16	A	COAF	Referência do evento corporativo: referência atribuída pelo <i>Account Servicer</i> para identificar inequivocamente um evento de ação corporativa
234	16	A	Ref-T2S-Match	Referência de <i>matching</i> do T2S
250	11	A	Instr-Part.(BIC)	BIC do <i>T2S Instructing Party</i> da Instrução de Liquidação
261	04	A	ISO-Tx-Cod	Código de Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>)
265	08	D	ISD	ISD=Data de Liquidação Contratada - formato AAAAMMDD
273	35	A	Conta-T2S (SAC)	Conta de valores mobiliários do participante (formato T2S)
308	11	A	Part-Conta(BIC)	BIC do participante que detém a conta de títulos no T2S
319	04	A	Mov-Tipo	Tipo de movimento de títulos Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'DELI' - <i>Delivery</i> 'RECE' - <i>Receipt</i>
323	04	A	Pag-Tipo	Código do tipo de pagamento Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'APMT' - <i>Against payment</i> 'FREE' - <i>Free of payment</i>
327	14+05	N	Quantidade (UNIT)	Quantidade de Valores Mobiliários em UNIT: <ul style="list-style-type: none"> para ações: não são permitidas casas decimais (formato: 14; casas decimais: zeros) para fundos (unidades de participação): máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
346	12+02	N	Quantidade (FAMT)	Quantidade de Valores Mobiliários em FAMT: máximo 2 casas decimais (formato: 12+2)
360	34	A	DCA	<i>T2S Dedicated Cash Account number (DCA)</i>
394	11	A	DCA-Part.BIC	BIC do Participante detentor do <i>T2S Dedicated Cash Account</i>
405	12+02	N	Montante-a-Liq	Montante em falha a ser entregue
419	03	A	Moeda-Montante-a-Liq	Código da moeda do montante em falha de acordo com ISO 4217
422	04	A	D/C (a Liq.)	Indicador de Debito/Credito: <ul style="list-style-type: none"> 'CRDT' - <i>Credito</i> 'DBIT' - <i>Debito</i>
426	14	DT	<i>TimeStamp SF1</i>	Data de calendário e Hora de aceitação da instrução pelo T2S (<i>SF1 - Settlement Finality 1 - Validation</i>)

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				Formato AAAAMMDDhhmmss
440	14	DT	<i>TimeStamp</i> SF2	Data de calendário e Hora de <i>matching/irrevocability</i> no T2S (SF2 - <i>Settlement Finality 2 - Matching</i>) Formato AAAAMMDDhhmmss
454	04	A	Motivo Falha-Liq(1)	Código do motivo do processamento das SEFPs: <ul style="list-style-type: none"> Falha de valores Falha de dinheiro <i>Hold</i>
458	07	A	Motivo Falha-Liq info.adic(1)	Descrição do motivo da falha da instrução de liquidação com o tipo/motivo da penalidade SEFP
465	04	A	Motivo Falha-Liq(2)	Código do motivo do processamento das SEFPs: <ul style="list-style-type: none"> Falha de valores Falha de dinheiro <i>Hold</i>
469	07	A	Motivo Falha-Liq info.adic(2)	Descrição do motivo da falha da instrução de liquidação com o tipo/motivo da penalidade SEFP

PENDCALC - Informação Diária do Cálculo das Penalidades

Mnemónica = **PENDCALC**

Denominação = Penalidades Diárias - Cálculo

Menu = Penalidades

Descrição = Este ficheiro contém informação diária relativa ao cálculo das penalidades aplicadas às instruções pendentes de liquidação após a data de liquidação contratada - ISD.

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	16	A	T2S-Ref-Penalidade	Referência atribuída pelo T2S que é a identificação individual da penalidade para o proprietário relevante da conta
26	08	D	Data	Data de cada sub-montante que forma uma nova penalidade reportada: - formato AAAAMMDD
34	11	A	Part.(BIC)	Identificação do Participante: BIC (11 dígitos)
45	03	A	Part-CP	Identificação do Participante-Contraparte: Código da Interbolsa (3 dígitos)
48	11	A	Part-CP(BIC)	BIC da contraparte da(s) nova(s) penalidade(s) reportada(s): BIC (11 dígitos)
59	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
71	05	A	Val.Mob suj. penalidade	Indica se o valor mobiliário está sujeito a penalidade em cada dia de negócio ou não Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • 'FALSE' • 'Blank'
76	04	A	Tipo-Instrum.	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • SHRS • SOVR • DEBT • SECU • ETFS • UCIT • MMKT • EMAL • OTHR
80	05	A	Liquidez	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • 'TRUE' – Instrumento financeiro (ações) líquido • 'FALSE' – Instrumento financeiro (ações) ilíquido
85	13+05	N	Euro-taxa-câmbio	O valor da primeira taxa de câmbio do euro aplicável em cada dia útil da penalidade com 5 casas decimais
103	03	A	Moeda-taxa-	Moeda em que a primeira taxa de câmbio é

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
			câmbio	expressa
106	03	A	Moeda-cot.-taxa-câmbio	Moeda na qual a moeda base é convertida
109	04	A	MIC	MIC - <i>Market Identifier Code</i> Mercado de negociação da transação subjacente (ISO 10383)
113	05	A	SME-Growth	SME - indicador <i>Growth Market</i> Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'TRUE' - As instruções foram negociadas no SME - indicador <i>Growth Market</i> 'FALSE' - As instruções não foram negociadas no SME - indicador <i>Growth Market</i>
118	03+05	N	Taxa-penalidade-Valor-Mob.	A taxa aplicável ao tipo de ativo, expressa em percentagem, com 5 casas decimais. Por exemplo, 0,00500 é 0,005%.
126	03+14	N	Taxa-penalidade-desconto	A taxa de desconto da moeda relevante para o dia útil, com 14 casas decimais
143	12+02	N	Montante Sub-Montante-1	Montante do Sub-montante, com duas casas decimais. Disponibilizado nos casos seguintes: Caso 1): O número de dias sujeito a aplicação de penalidade é maior que um (LMFP para instruções que fizeram <i>match</i> mais que um dia após ISD); Caso 2): O método de cálculo é 'BOTH'.
157	03	A	Moeda Sub-montante-1	Moeda do Sub-montante
160	04	A	Tipo Sub-Montante-1	Indica o tipo de cada sub-montante que constitui uma penalidade Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'SECU': o sub-valor refere-se a valores mobiliários (valor baseado na quantidade de valores mobiliários que não foi entregue e na taxa de penalidade do tipo de ativo de valor mobiliário). 'CASH': o sub-valor refere-se a dinheiro (valor baseado na quantidade de dinheiro que não foi entregue e na taxa de desconto da moeda)
164	12+02	N	Montante Sub-montante-2	Montante do sub-montante-2, com duas casas decimais Somente disponibilizado se o método de cálculo é 'BOTH'.
178	03	A	Moeda Sub-montante-2	Moeda do Sub-montante-2
181	04	A	Tipo Sub-Montante-2	Indica o tipo do sub-montante-2 que constitui uma penalidade Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'CASH': o sub-valor refere-se a dinheiro (valor baseado na quantidade de dinheiro que não foi entregue e na taxa

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				de desconto da moeda)

PENMAGGR - Informação Mensal Agregada das Penalidades

Mnemónica = PENMAGGR

Denominação = Penalidades Mensais - Agregada

Menu = Penalidades

Descrição = Este ficheiro contém informação mensal agregada relativa às penalidades aplicadas às instruções pendentes de liquidação após a data de liquidação contratada – ISD, do mês.

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	03	A	Moeda Penalidades	Moeda das penalidades reportadas Código da moeda de acordo com ISO 4217
13	11	A	Part.(BIC)	Identificação do Participante: BIC (11 dígitos) Reportado de acordo com parte faltosa (parte com falha) ou parte creditada (parte sem falha) relativa às penalidades reportadas
24	11	A	CSD-CP(BIC)	CSD Contraparte - BIC BIC primário da CSD da contraparte da(s) nova(s) penalidade(s) reportado(s): BIC (11 dígitos)
35	03	A	Part-CP	Identificação do Participante-Contraparte: Código da Interbolsa (3 dígitos)
38	11	A	Part-CP(BIC)	BIC da contraparte da(s) nova(s) penalidade(s) reportada(s): BIC (11 dígitos)
49	04	A	Tipo-CP	Tipo - Contraparte Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'NCSD' - Central de Valores Mobiliários 'CCPA' - CCP (Contraparte Central) 'CSDP' - Participante da CSD 'EXTE' - Depositário externo
53	7	D	Período-Reporte	Período em que as penalidades são reportadas - formato AAAA-MM
60	12+02	N	Montante-Líquido Agreg.Mensal	Montante líquido agregado mensal bilateral entre uma parte e a contraparte correspondente, com duas casas decimais
74	03	A	Moeda-Mont-Líquido	Moeda do montante líquido agregado mensal Código da moeda de acordo com a ISO 4217
77	04	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> "DBIT" - Débito do montante líquido agregado mensal aplicado ao faltoso "CRDT" - Crédito do montante líquido agregado mensal a receber pelo lesado " " (em branco) - não informado se montante líquido agregado mensal for zero

PENMDETL - Informação Mensal do Detalhe das Penalidades

Mnemónica = PENMDETL

Denominação = Penalidades Mensais - Detalhe

Menu = Penalidades

Descrição = Este ficheiro contém informação mensal relativa ao detalhe das penalidades aplicadas às instruções pendentes de liquidação após a data de liquidação contratada – ISD, do mês.

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	03	A	Moeda Penalidades	Moeda das penalidades reportadas Código da moeda de acordo com ISO 4217
13	11	A	Part.(BIC)	Identificação do Participante: BIC (11 dígitos) Reportado de acordo com parte faltosa (parte com falha) ou parte creditada (parte sem falha) relativa às penalidades reportadas
24	11	A	CSD-CP(BIC)	CSD Contraparte - BIC BIC primário da CSD da contraparte da(s) nova(s) penalidade(s) reportado(s): BIC (11 dígitos)
35	03	A	Part-CP	Identificação do Participante-Contraparte: Código da Interbolsa (3 dígitos)
38	11	A	Part-CP(BIC)	BIC da contraparte da(s) nova(s) penalidade(s) reportada(s): BIC (11 dígitos)
49	16	A	T2S-Match-Ref Penalidade	O ID comum fornecido terá um comprimento de 15 dígitos, construído da seguinte forma: YYMMDDGGGGGGGGGS <ul style="list-style-type: none"> • Y - ano • M - mês • D - dia • G - número sequencial, sendo o limite superior 999.999.999 • S - espaço
65	16	A	T2S-Ref-Penalidade	Referência atribuída pelo T2S que é a identificação individual da penalidade para o proprietário relevante da conta
81	16	A	Ref-MI-realocação	Referência atribuída pelo T2S à penalidade em caso de realocação que é comum para o participante que falhou e para o participante que não falhou
97	04	A	Tipo-Penalidade	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • 'SEFP' - <i>Settlement Fail Penalty</i> • 'LMFP' - <i>Late Matching Fail Penalty</i>
101	12+02	N	Mont-Penalidade	Montante da penalidade, com duas casas decimais
115	03	A	Moeda-Penalidade	Moeda da penalidade Código da moeda de acordo com ISO 4217
118	04	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> • "DBIT" - Débito do montante líquido agregado

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				mensal aplicado ao faltoso <ul style="list-style-type: none"> • "CRDT" - Crédito do montante líquido agregado mensal a receber pelo lesado • " " - em branco - não informado se montante da penalidade for zero
122	04	A	Método-cálculo	Regra de cálculo usada para calcular a penalidade: <ul style="list-style-type: none"> • 'SECU'- a penalidade é baseada na quantidade de títulos que não foi entregue e na taxa de penalidade do tipo de ativo de valor mobiliário relevante • 'MIXE' - A penalidade é baseada na quantidade de títulos que não foi entregue e a taxa de penalidade é a taxa de desconto da moeda relevante • 'CASH' - A penalidade é baseada no montante que não foi entregue e a taxa de penalidade é a taxa de desconto da moeda relevante • 'BOTH' - A penalidade é a soma do SECU e do CASH, ou seja, a soma: <ul style="list-style-type: none"> - da penalidade com base na quantidade de títulos que não foi entregue e a taxa de penalidade do tipo de ativo de valor mobiliário relevante; e - da penalidade com base na quantidade de dinheiro que não foi entregue e na taxa de desconto da moeda
126	04	N	Num-dias	O número de dias em que a penalidade é aplicável: <ul style="list-style-type: none"> • 'SEFPs' - é sempre 1 dia • 'LMFPs' - é o número de dias úteis em que à penalidade se aplica

PENMPAYM - Informação Mensal - Previsão do Pagamento das Penalidades

Mnemónica = PENMPAYM

Denominação = Penalidades Mensais – Previsão do Pagamento

Menu = Penalidades

Descrição = Este ficheiro contém informação mensal relativa ao montante líquido (*net amount*) das penalidades, a pagar ou a receber por cada Participante.

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	11	A	Part.(BIC)	BIC do Participante
21	07	D	Periodo-Reporte	Período de reporte das penalidades - formato AAAA-MM
28	11	A	CSD-CP(BIC)	CSD contraparte - BIC BIC da CSD contraparte das instruções que deram origem às penalidades
39	12+02	N	Montante-Agregado Líquido	Montante agregado líquido mensal por participante e CSD contraparte, a ser debitado ou creditado (com duas casas decimais)
53	03	A	Moeda	Moeda do montante líquido agregado mensal Código da moeda de acordo com a ISO 4217
56	04	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> • "DBIT" - Débito do montante líquido agregado mensal • "CRDT" - Crédito do montante líquido agregado mensal • " " - em branco - não informado se o montante líquido agregado mensal for zero
60	08	D	Data-Pag.	Data do pagamento das penalidades no T2S - Formato AAAAMMDD

PENMOAGR - Informação agregada das Penalidades Modificadas

Mnemónica = PENMOAGR

Denominação = Penalidades Modificadas - Informação agregada

Menu = Penalidades

Descrição = Este ficheiro contém informação relativa a modificação das penalidades que ocorreram desde a última informação disponibilizada (*reporting*). Esta informação pode ser relativa a diferentes dias de liquidação.

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	11	A	Part.(BIC)	BIC do Participante
21	08	D	Data Penalidades	Data de deteção das penalidades modificadas e comunicadas - Formato AAAAMMDD
29	03	A	Moeda Penalidades	Moeda das penalidades modificadas reportadas Código da moeda de acordo com a ISO 4217
32	04	A	Tipo Part.	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'NCSD' - Central de Valores Mobiliários 'CCPA' - CCP (Contraparte Central) 'CSDP' - Participante da CSD 'EXTE' - Depositário Externo
36	11	A	CSD-CP (BIC)	CSD Contraparte - BIC BIC da CSD da contraparte da(s) penalidade(s) modificada(s), reportada (s): BIC (11 dígitos)
47	03	A	Part-CP	Identificação do Participante-Contraparte: Código da Interbolsa (3 dígitos)
50	11	A	Part-CP (BIC)	BIC da contraparte da(s) penalidade(s) modificada (s), reportada(s): BIC (11 dígitos)
61	04	A	Tipo Part-CP	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'NCSD' - Central de Valores Mobiliários 'CCPA' - CCP (Contraparte Central) 'CSDP' - Participante da CSD 'EXTE' - Depositário Externo
65	12+02	N	Montante-Líquido Agreg.Diário	Montante agregado líquido bilateral entre um participante e a contraparte correspondente, a ser debitado ou creditado (com duas casas decimais)
79	03	A	Moeda-Mont-Líquido	Moeda do montante líquido agregado mensal Código da moeda de acordo com a ISO 4217
82	04	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> "DBIT" - Débito do montante líquido agregado mensal aplicado ao faltoso "CRDT" - Crédito do montante líquido agregado mensal a receber pelo lesado " " - em branco - não informado se montante da penalidade for zero

PENMODTL - Informação do Detalhe das Penalidades Modificadas

Mnemónica =	PENMODTL
Denominação =	Penalidades Modificadas - Detalhes
Menu =	Penalidades
Descrição =	Este ficheiro contém informação relativa aos detalhes sobre a modificação das penalidades que ocorreram desde a última informação disponibilizada (<i>reporting</i>)

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	11	A	Part.(BIC)	BIC do Participante
21	08	D	Data Penalidades	Data de deteção (original) das penalidades modificadas e comunicadas - Formato AAAAMMDD
29	11	A	CSD-CP (BIC)	CSD Contraparte - BIC BIC da CSD da contraparte da(s) penalidade(s) modificada(s), reportada (s): BIC (11 dígitos)
40	11	A	Part-CP (BIC)	BIC da contraparte da(s) penalidade(s) modificada (s), reportada(s): BIC (11 dígitos)
51	16	A	T2S-Match-Ref Penalidade	O ID comum fornecido terá um comprimento de 15 dígitos, construído da seguinte forma: YYMMDDGGGGGGGGGS <ul style="list-style-type: none"> • Y - ano • M - mês • D - dia • G - número sequencial, sendo o limite superior 999.999.999 • S - espaço
67	16	A	T2S-Ref-Penalidade	Referência atribuída pelo T2S que é a identificação individual da penalidade para o proprietário relevante da conta
83	16	A	Ref-MI-realocação	Referência atribuída pelo T2S à penalidade em caso de realocação que é comum para o participante que falhou e para o participante que não falhou
99	04	A	Tipo-Penalidade	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • 'SEFP' - <i>Settlement Fail Penalty</i> • 'LMFP' - <i>Late Matching Fail Penalty</i>
103	04	A	Estado-Penalidade	Estado da Penalidade: <ul style="list-style-type: none"> • 'ACTV' - Activa • 'REMO' - Removida
107	04	A	Motivo	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • 'UPTD' - penalidade ativa que foi atualizada • 'NEWP' - Nova Penalidade • 'RALO' - penalidade ativa ou removida que foi realocada • 'SWIC' - penalidade ativa que foi alterada (o

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				<p>participante faltoso e o não faltoso foram trocados pela CSD)</p> <ul style="list-style-type: none"> 'INSO' - penalidade que foi removida porque um processo de insolvência foi aberto contra o participante que falhou 'SESU' - penalidade que foi removida devido à suspensão do ISIN da liquidação devido a um problema de reconciliação nos termos do artigo 65 (2) e (6) do RTS sobre Requisitos de CSD 'SUSP' - penalidade que foi removida devido à suspensão da negociação do ISIN 'SEMP' - penalidade que foi removida porque as instruções de liquidação envolviam liquidação em dinheiro fora do sistema de liquidação de valores mobiliários operado pela CSD se, no respetivo dia, o sistema de pagamento relevante estiver fechado para liquidação 'TECH' - penalidade que foi removida porque havia impossibilidades técnicas ao nível da CSD que impedem a liquidação, como: falha dos suportes técnicos, ataque cibernético, problemas de rede, etc. 'OTHR' - penalidade que foi removida devido a um motivo não padrão da CSD
111	210	A	Mot-Descr	<p>Descrição (texto) adicional do motivo pelo qual a penalidade foi removida ou trocada em caso de:</p> <ul style="list-style-type: none"> 'SWIC' - penalidade ativa que foi alterada (o participante faltoso e o não faltoso foram trocados pela CSD) 'OTHR' - penalidade que foi removida devido a um motivo não padrão da CSD
321	12+02	N	Montante-penalidade	<p>Valor da penalidade: Cada montante calculado de uma penalidade é formado pelos Sub-montantes correspondentes abaixo:</p> <ul style="list-style-type: none"> 'SEFPs' - igual ao Sub-valor calculado na data de deteção da penalidade, desde que não haja dados de referência ausentes naquele dia útil. 'LMFPs' - a soma de cada sub-quantia calculada em todos os dias aplicável da penalidade, desde que não haja dados de referência ausentes
335	03	A	Moeda	<p>Moeda do montante líquido Código da moeda de acordo com a ISO 4217</p>
338	04	A	D/C	<p>Indicador de Débito/Crédito:</p> <ul style="list-style-type: none"> "DBIT" - Débito do montante líquido agregado a pagar pelo faltoso "CRDT" - Crédito do montante líquido agregado a receber pelo lesado
342	04	A	Método-cálculo	<p>Regra de cálculo usada para calcular a penalidade:</p> <ul style="list-style-type: none"> 'SECU'- a penalidade é baseada na quantidade de títulos que não foi entregue e na taxa de penalidade do tipo de ativo de valor mobiliário relevante 'MIXE' - A penalidade é baseada na quantidade de títulos que não foi entregue e a taxa de penalidade é a taxa de desconto da moeda relevante

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				<ul style="list-style-type: none"> 'CASH' - A penalidade é baseada no montante que não foi entregue e a taxa de penalidade é a taxa de desconto da moeda relevante 'BOTH' - A penalidade é a soma do SECU e do CASH, ou seja, a soma: <ul style="list-style-type: none"> - da penalidade com base na quantidade de títulos que não foi entregue e a taxa de penalidade do tipo de ativo de valor mobiliário relevante; e - da penalidade com base na quantidade de dinheiro que não foi entregue e na taxa de desconto da moeda
346	04	N	Num-Dias	<p>O número de dias que a penalidade é aplicável:</p> <ul style="list-style-type: none"> 'SEFPs' - é sempre 1 dia 'LMFPs' - é o número de dias úteis em que a penalidade se aplica
350	16	A	Referência-Part.	Referência atribuída pelo participante da conta à Instrução de Liquidação se nenhum: 'NONREF'
366	16	A	Referência-IB	Referência da Interbolsa Referência atribuída pelo CSD à Instrução de Liquidação se nenhum: 'NONREF'
382	16	A	Referência-Proc.	Referência atribuída por Terceiro à Instrução de Liquidação (Referência do Processador de Transações) se nenhum: NONREF
398	16	A	Referência-T2S	Referência do T2S
414	16	A	Ref-Comum	Referência atribuída pelo <i>T2S Actor</i> quando a Instrução LCMM já está <i>matched</i> ou para facilitar o <i>matching</i> no T2S
430	16	A	COAF	Referência do evento corporativo: referência atribuída pelo <i>Account Servicer</i> para identificar inequivocamente um evento de ação corporativa
446	16	A	Ref-T2S-Match	Referência de <i>matching</i> do T2S
462	11	A	Instr-Part.(BIC)	BIC do <i>T2S Instructing Party</i> da Instrução de Liquidação

PENMOCAL - Informação do Cálculo das Penalidades Modificadas

Mnemónica = PENMOCAL

Denominação = Penalidades Modificadas - Cálculo

Menu = Penalidades

Descrição = Este ficheiro contém informação relativa ao cálculo das penalidades modificadas após a última informação disponibilizada (*reporting*)

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	11	A	Part.(BIC)	BIC do Participante
21	16	A	T2S-Ref-Penalidade	Referência atribuída pelo T2S que é a identificação individual da penalidade para o proprietário relevante da conta
37	08	D	Data	Data das penalidades modificadas e comunicadas, por cada sub-montante - Formato AAAAMMDD Aplicável: <ul style="list-style-type: none"> 'SEFPs' - é sempre 1 dia (Data de deteção) 'LMFPs' - é o número de dias úteis em que à penalidade se aplica
45	05	A	Falta Dados-Ref	Indica se o valor mobiliário está sujeito a penalidade em cada dia de negócio ou não Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> "TRUE" - Faltam dados de referência no dia útil aplicável 'Blank' - Se não for fornecido, significa que a penalidade pode ser calculada e não falta nenhuma referência
50	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
62	05	A	Val.Mob. suj.penalidade	Indica se o valor mobiliário está sujeito a penalidade em cada dia de negócio ou não Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'FALSE' 'Blank'
67	04	A	Tipo-Instrum.	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> SHRS SOVR DEBT SECU ETFS UCIT MMKT EMAL OTHR
71	05	A	Liquidez	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'TRUE' - Instrumento financeiro (ações) líquido 'FALSE' - Instrumento financeiro (ações) ilíquido
76	13+05	N	Euro-taxa-câmbio	O valor da primeira taxa de câmbio do euro

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				aplicável em cada dia útil da penalidade com 5 casas decimais
94	03	A	Moeda-taxa-câmbio	Moeda em que a primeira taxa de câmbio é expressa
97	03	A	Moeda-cot.-taxa-câmbio	Moeda na qual a moeda base é convertida
100	04	A	MIC	MIC - <i>Market Identifier Code</i> Mercado de negociação da transação subjacente (ISO 10383)
104	05	A	SME-Growth	SME - indicador <i>Growth Market</i> Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'TRUE' - As instruções foram negociadas no SME - indicador <i>Growth Market</i> 'FALSE' - As instruções não foram negociadas no SME - indicador <i>Growth Market</i>
109	03+05	N	Taxa-penalidade Valor-Mob.	A taxa aplicável ao tipo de ativo, expressa em percentagem, com 5 casas decimais. Por exemplo, 0,00500 é 0,005%.
117	03+14	N	Taxa-penalidade-desconto	A taxa de desconto da moeda relevante para o dia útil, com 14 casas decimais
134	12+02	N	Montante Sub-Montante-1	Montante do Sub-montante, com duas casas decimais. Disponibilizado nos casos seguintes: Caso 1): O número de dias sujeito a aplicação de penalidade é maior que um (LMFP para instruções que fizeram <i>match</i> mais que um dia após ISD); Caso 2): O método de cálculo é 'BOTH'.
148	03	A	Moeda Sub- montante-1	Moeda do Sub-montante
151	04	A	Tipo Sub-Montante-1	Indica o tipo de cada sub-montante que constitui uma penalidade Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'SECU': o sub-valor refere-se a valores mobiliários (valor baseado na quantidade de valores mobiliários que não foi entregue e na taxa de penalidade do tipo de ativo de valor mobiliário). 'CASH': o sub-valor refere-se a dinheiro (valor baseado na quantidade de dinheiro que não foi entregue e na taxa de desconto da moeda)
155	12+02	N	Montante Sub-montante-2	Montante do sub-montante, com duas casas decimais. Somente disponibilizado se o método de cálculo é 'BOTH'.
169	03	A	Moeda Sub- montante-2	Moeda do Sub-montante-2
172	04	A	Tipo Sub-Montante-2	Indica o tipo do sub-montante-2 que constitui uma penalidade Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> 'CASH': o sub-valor refere-se a dinheiro (valor baseado na quantidade de dinheiro que não foi entregue e na taxa de desconto da moeda)

PENAPfil/PENAPmsg – Pedido das Penalidades a Modificar (Ficheiro/Mensagem)

Mnemónica = PENAPfil/PENAPmsg
Denominação = Pedido das Penalidades a Modificar (Ficheiro/Mensagem)
Menu = Penalidades
Descrição = Este ficheiro/Mensagem é enviado pelo Participante à INTERBOLSA e contém informação relativa ao pedido de alteração das instruções de penalidades

Conteúdo do ficheiro/mensagem:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	11	A	Part.(BIC)	BIC do Participante
15	04	A	Ped.- Tipo	Tipo de Pedido: <ul style="list-style-type: none"> • REMO – Removal • REIN – Re-inclusion • RALO – Re-allocation • SWIC - Switch
19	16	A	T2S-Ref-Penalidade	Referência atribuída pelo T2S à instrução da penalidade
35	04	A	Tipo-Penalidade	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • 'SEFP' - <i>Settlement Fail Penalty</i> • 'LMFP' - <i>Late Matching Fail Penalty</i>
39	12	A	Cod-ISIN	Identificação – Código ISIN
51	04	A	Motivo	Código do motivo da remoção - deve ser preenchido caso o tipo de solicitação seja 'REMO'. <ul style="list-style-type: none"> • 'SESU' - penalidade que deve ser removida devido à suspensão do ISIN da liquidação devido a um problema de reconciliação nos termos do artigo 65 (2) e (6) do RTS sobre Requisitos de CSD; • 'SEMP' - penalidade que deve ser removida porque as instruções de liquidação envolviam liquidação em dinheiro fora do sistema de liquidação de valores mobiliários operado pela CSD se, no respetivo dia, o sistema de pagamento relevante estiver fechado para liquidação • 'SUSP' – penalidade suspensa • 'TECH' - penalidade que deve ser removida porque havia impossibilidades técnicas ao nível da CSD que impedem a liquidação, como: falha dos suportes técnicos, ataque cibernético, problemas de rede, etc. • 'OTHR' - penalidade que deve ser removida devido a um motivo não padrão da CSD
55	210	A	Mot-Descr	Descrição (texto) adicional do motivo pelo qual a

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				penalidade deve ser removida ou trocada. Só deve ser preenchida no caso de: <ul style="list-style-type: none"> • Ped-Tipo = 'REMO' e Motivo = 'OTHR' • Ped-Tipo = 'SWIC'
265	11	A	Novo- em falta Part. (BIC)	Novo participante (BIC) em falha. BIC do Participante que se tornará a parte insolvente da penalidade após a realocação. Deve ser preenchido caso o tipo de appeal seja 'RALO', caso contrário, deve estar em 'branco'. Nota: Deve ser o participante a débito ou o participante a crédito da instrução de liquidação subjacente que foi enviada já matched
276	11	A	Novo- não-faltoso Part. (BIC) -	Novo participante (BIC) não faltoso. BIC do participante que passa a não faltoso da penalidade após a realocação. É necessário preencher no caso do pedido tipo 'RALO', caso contrário deve estar em branco. Nota: no caso do novo participante faltoso (BIC) corresponde ao participante a débito da instrução de liquidação subjacente o novo não faltoso participante (BIC) deve corresponder ao participante a crédito e vice-versa.
287	16	A	Referência-T2S	Referência do T2S da instrução de liquidação. Para os tipos de pedido REMO, REIN, SWIC terá que ser a Referência T2S da instrução que deu origem a penalidade. Para o tipo de pedido RALO (Re-Allocation) terá que ser a Referência T2S da instrução faltosa.
303	04	A	ISO-Tx-Cod	Código de Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>) da instrução subjacente.
307	08	D	ISD	ISD=Data de Liquidação Contratada - formato AAAAMMDD

PENAP – Mensagem com o Pedido das Penalidades a Modificar

Mnemónica = **PENAP**

Denominação = Mensagem com os pedidos das Penalidades a Modificar

Menu = Penalidades

Descrição = Esta Mensagem contém informação relativa ao pedido de alteração das instruções de penalidades

Conteúdo da mensagem:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	Part.	Identificação do Participante: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	11	A	Part.(BIC)	BIC do Participante
15	04	A	Ped. Tipo	Tipo de Pedido: <ul style="list-style-type: none"> • REMO – Remover • REIN – Re-incluir • RALO – Re-alocar • SWIC – Trocar participante faltoso e não faltoso
19	09	N	ID Pedido.	Identificação única do pedido de modificação, atribuída pela Interbolsa.
28	16	A	T2S-Ref-Penalidade	Referência atribuída pelo T2S à instrução da penalidade
44	04	A	Tipo-Penalidade	Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • 'SEFP' - <i>Settlement Fail Penalty</i> • 'LMFP' - <i>Late Matching Fail Penalty</i>
48	12	A	Código-ISIN	Identificação - Código ISIN
60	04	A	Motivo	Código do motivo da remoção - deve ser preenchido caso o tipo de solicitação seja 'REMO'. Valores possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • 'SESU' - penalidade que deve ser removida devido à suspensão do ISIN da liquidação devido a um problema de reconciliação nos termos do artigo 65 (2) e (6) do RTS sobre Requisitos de CSD; • 'SEMP' - penalidade que deve ser removida porque as instruções de liquidação envolviam liquidação em dinheiro fora do sistema de liquidação de valores mobiliários operado pela CSD se, no respetivo dia, o sistema de pagamento relevante estiver fechado para liquidação • 'SUSP' – penalidade suspensa • 'TECH' - penalidade que deve ser removida porque havia impossibilidades técnicas ao nível da CSD que impedem a liquidação, como: falha dos suportes técnicos, ataque cibernético, problemas de rede, etc. • 'INSO' – penalidade removida devido à insolvência. • 'OTHR' - penalidade que deve ser removida devido a

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				um motivo não padrão da CSD
64	210	A	Mot-Descr	Descrição (texto) adicional do motivo pelo qual a penalidade deve ser removida ou trocada
274	11	A	Novo- em falta Part. (BIC)	Novo participante (BIC) em falha. BIC do Participante que se tornará a parte insolvente da penalidade após a reatribuição. Deve ser preenchido caso o tipo de appeal seja 'RALO', caso contrário, deve estar em 'branco'. Nota: Deve ser o participante a débito ou o participante a crédito da instrução de liquidação subjacente que foi enviada já matching
285	11	A	Novo- não-faltoso Part. (BIC) -	Novo participante (BIC) não faltoso. BIC do participante que passa a não faltoso da penalidade após a realocação. É necessário preencher no caso do pedido tipo 'RALO', caso contrário deve estar em branco. Nota: no caso do novo participante faltoso (BIC) corresponde ao participante a débito da instrução de liquidação subjacente o novo não faltoso participante (BIC) deve corresponder ao participante a crédito e vice versa.
296	16	A	Referência-T2S	Referência do T2S da instrução de liquidação que deu origem à penalidade. Para os tipos de pedido REMO, REIN, SWIC é a Referência T2S da instrução que deu origem a penalidade. Para o tipo de pedido RALO (Re-Allocation) terá que ser a Referência T2S da instrução faltosa.
312	04	A	ISO-Tx-Cod	Código de Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>)
316	08	D	ISD	ISD=Data de Liquidação Contratada - formato AAAAMMDD
324	04	A	Estado	Estados possíveis: <ul style="list-style-type: none"> • 'PEND' – Appeal pendente • 'ACPT' – Appeal aceite • 'EXEC' – Appeal/Modificação executado • 'REJT' – Appeal rejeitado
328	210	A	Desc-Estado	Descrição adicional (texto) do motivo pelo qual a modificação da penalidade foi rejeitada ou aceite
538	16	A	Novo-T2S-Match-Ref. Penalidade	Referência comum atribuída pelo T2S à nova realocação da penalidade

O campo Descr-Estado contém informações adicionais sobre o motivo do indeferimento do pedido de modificação da penalidade.

Existem duas categorias de descrições.

Para a primeira categoria (Mensagens com informações de campos individuais) também são informados os nomes dos campos que estão relacionados com a rejeição.

A segunda categoria (mensagens genéricas) fornece apenas uma descrição do erro.

Descrição - Estado
Mensagens com informação de campos individuais:
<i>Not authorized:</i>
<i>Mandatory fields missing:</i>
<i>Penalty does not exist:</i>
<i>An other pending appeal request for the same penalty already exists:</i>
<i>Fields not corresponding with underlying penalty:</i>
<i>Fields only allowed for Request Type RALO, and must be either the Delivering or the Receiving Party of the underlying instruction:</i>
Mensagens Genéricas:
<i>The individual modification request (body) is invalid</i>
<i>The 'Individual Penalty Identification' is not empty for RALO (Reallocation)</i>
<i>The 'Individual Penalty Identification' field is empty. The 'Individual Penalty Identification' must be filled in case the Request Type is 'REMO' (Removal), 'REIN' (Re-inclusion) or 'SWIC' (Switch)</i>
<i>The Individual Penalty Identification does not exist in T2S</i>
<i>The removal, re-inclusion or switch does not refer to the individual penalty identification of the failing party</i>
<i>The Request Type is 'RALO' and the requestor CSD is not the same as the CSD of the LMFP (CSD of the Instructing Party of the underlying instruction)</i>
<i>It is not possible to modify the Penalty as its appeal period has ended</i>
<i>The 'Market Infrastructure Identification' is not empty for 'REMO' (Removal), 'REIN' (Re-inclusion) or 'SWIC' (Switch)</i>
<i>The 'Market Infrastructure Identification' field is empty. The Market 'Infrastructure Identification' must be filled in case the Request Type is 'RALO' (Reallocation)</i>
<i>The Market Infrastructure Identification does not exist in T2S</i>
<i>The field 'Removal Reason Code' is empty for REMO (Removal)</i>
<i>The field 'Removal Reason Code' is not empty for REIN (Re-inclusion), RALO (Re-allocation) and SWIC (Switch)</i>
<i>The field 'Description text' is empty for Request Type REMO with Removal Reason Code OTHR or for a Request Type SWIC (Switch)</i>
<i>The field 'Description text' is not empty for REIN (Re-inclusion), RALO (Re-allocation) or REMO without Removal Reason Code OTHR</i>
<i>The field 'New failing Party BIC' is empty in a RALO (Re-allocation) modification</i>
<i>The new failing Party is neither the delivering nor the receiving party of the underlying Settlement Instruction that was sent already matched</i>
<i>The field 'New Non-failing Party BIC' is empty in a RALO (Re-allocation) modification</i>
<i>The New failing Party BIC corresponds to the delivering party of the underlying Settlement Instruction but the New non-failing Party BIC is not the receiving party, or vice versa</i>
<i>The 'New failing Party BIC' is equal to 'New non-failing Party BIC', but the 'T2S reference of the failed Settlement Instruction' field is empty</i>
<i>The 'T2S reference of the failed Settlement Instruction' is neither the delivering nor the receiving Settlement Instruction created in T2S from the already matched</i>
<i>'New failing Party BIC' and 'New non-failing Party BIC' are different, but the 'T2S reference of the failed Settlement Instruction' is not empty</i>
<i>The 'New failing Party BIC' is filled, but the Request Type is not RALO (Re-allocation)</i>
<i>The 'New non-failing Party BIC' is filled, but the Request Type is not RALO (Re-allocation)</i>
<i>The 'T2S reference of the failed Settlement Instruction' is filled for a Request Type different to RALO (Re-allocation)</i>

Descrição - Estado
<i>It is not possible to remove a Penalty that is not active</i>
<i>It is not possible to re-include a Penalty that is not removed</i>
<i>It is not possible to re-include a Penalty that was removed because of a Reallocation</i>
<i>It is not possible to switch a Penalty that is not active</i>
<i>It is not possible to reallocate a Penalty that is not active</i>
<i>It is not possible to reallocate a Penalty that is not a LMFP</i>
<i>It is not possible to reallocate a Penalty already reallocated before</i>
<i>The underlying Settlement Instruction of the Penalty was not sent as already matched to T2S</i>