



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Tarifação

Relatório de Definições de Mensagens

Este documento descreve um conjunto de definições de mensagens desenvolvidas pela B3, a serem utilizadas no processo de tarifação de negócios, posições ou eventos.



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição
30/05/2014	1.14	Versão em produção na Clearing BM&FBOVESPA
17/09/2015	2.0	Ajuste na mensagem bvmf.089.02 Criação da bvmf.181.01 Criação dos arquivos BVBG.023.02, BVBG.072.01
23/10/2015	2.1	Mensagens bvmf.092.01 e bvmf.093.01 Atributo "DMAIndicator (DMAInd)" passa ser opcional.
21/12/2015	2.2	Substituição da bvmf.089.02 por bvmf.089.01 e da BVBG.023.02 por BVBG.023.01.
18/01/2016	2.3	Exclusão de regra da bvmf.092.01.
26/03/2020	2.4	Alterações no BVBG.072.01 (bvmf.181.01) – "Aguardando Implantação Projeto Nova Tarifação" Criação do BVBG.072.02 (bvmf.181.02) - "Aguardando Implantação Projeto Nova Tarifação" Mensagem bvmf.181 poderá ser trafegada fora do arquivo. - "Aguardando Implantação Projeto Nova Tarifação"
29/04/2022	2.5	Exclusão do arquivo BVBG.026.01 e mensagem bvmf.093.01.
05/05/2022	2.6	Mensagem bvmf.092.01 poderá ser trafegada fora do arquivo.
20/06/2022	2.7	Alteração na mensagem bvmf.092.01

Descrição detalhada no documento "Histórico de Alterações".



Versão de Schema

A versão deste catálogo contempla as versões abaixo dos schemas XSDs.

Nome Mensagem	Versão Schema XSD	Arquivo
bvmf.089.01	1.9	BVBG.023.01
bvmf.091.01	1.8	BVBG.024.01
bvmf.092.01	1.13	BVBG.025.01 BVBG.031.01 BVBG.043.01 BVBG.044.01
bvmf.181.01	1.0	BVBG.072.01

Descrição detalhada no documento "Manual Técnico".



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Status das Mensagens e Arquivos no Projeto IPN

Mensagem somente atendem a Clearing de Derivativos (V1 IPN)	Mensagem pode sofrer ajuste para atender Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada (V2 do IPN)	Mensagem revisada para atender V2 do IPN	Novas Mensagens para Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada
BVBG.025.01 FeeUnitCostReport			BVBG.072.01 EquitiesFeePublicInformation
BVBG.031.01 DailyFeeUnitCostReport			
BVBG.043.01 FeeUnitCost Public Report			
BVBG.044.01 DailyFeeUnitCost Public Report			
BVBG.024.01 FeeVariablesInformation			
BVBG.023.01 CalculatedFee			



Conteúdo

Histórico de Revisão	2
Versão de Schema	3
Status das Mensagens e Arquivos no Projeto IPN	4
Visão geral	9
<i>Escopo</i>	9
<i>Lista de Mensagens e Arquivos</i>	9
<i>Conteúdo do Arquivo</i>	11
<i>Como Ler</i>	12
Fluxos de Mensagens e Arquivos	13
<i>Informa Tarifas Calculadas</i>	13
Introdução	13
Cenário1 :BM&FBOVESPA Informa Tarifas Calculadas pelo sistema de tarifação	13
<i>Informa Parâmetros Tarifação</i>	14
Introdução	14
Cenário1	14
<i>Informa Custo Unitário</i>	15
Introdução	15
Cenário1	15
<i>Informa Custo Unitário - diário</i>	17



Introdução	17
Cenário1	17
<i>Informa valor das taxas de Equities</i>	19
Introdução	19
Cenário1	19
BVBG.023.01 CalculatedFee	21
Funcionalidade do Arquivo	21
Escopo	21
Uso	21
Diagrama da Mensagem	21
Regras:	23
Estrutura da mensagem “CalculatedFee” (bvmf.089.01)	23
O header do arquivo está no manual técnico.	23
BVBG.023.01 – Calculated Fee	23
<i>bvmf.089.01 – CalculatedFee</i>	23
BVBG.024.01 FeeVariablesInformation	31
Funcionalidade do Arquivo	31
Escopo	31
Uso	31
Estrutura	33
BVBG.025.01 FeeUnitCostReport	39



Funcionalidade do Arquivo.....	39
Escopo	39
Uso.....	39
BVBG.025.01- Fee Unit Cost Report.....	41
<i>bvmf.092.01 – FeeUnitCostReport.....</i>	<i>41</i>
<i>Regras</i>	<i>41</i>
<i>Estrutura</i>	<i>41</i>
BVBG.031.01- DailyFeeUnitCostReport.....	48
Funcionalidade do Arquivo.....	48
Escopo	48
Uso.....	48
BVBG.031.01- DailyFeeUnitCostReport.....	50
<i>bvmf.092.01 – FeeUnitCostReport.....</i>	<i>50</i>
<i>Regras</i>	<i>50</i>
BVBG.043.01 FeeUnitCostPublicReport	57
Funcionalidade do Arquivo.....	57
Escopo	57
Uso.....	57
BVBG.043.01- FeeUnitCostPublicReport.....	59
<i>bvmf.092.01 – FeeUnitCostReport.....</i>	<i>59</i>



<i>Regras</i>	59
BVBG.044.01- DailyFeeUnitCostPublicReport	66
Funcionalidade do Arquivo	66
Escopo	66
Uso	66
BVBG.044.01- DailyFeeUnitCostPublicReport	68
<i>bvmf.092.01 – FeeUnitCostReport</i>	68
<i>Regras</i>	68
<i>Estrutura</i>	68
BVBG.072.01- EquitiesFeePublicInformation	75
Funcionalidade do Arquivo	75
Escopo	75
Uso	75
<i>Regras</i>	76
<i>bvmf.181.01 – EquitiesFeePublicInformation</i>	76
bvmf.092.01 – FeeUnitCostReport	80
<i>Regras</i>	80
<i>Estrutura</i>	80



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Visão geral

Escopo

Este documento descreve o conjunto de definições de mensagens desenvolvidas pela BM&FBOVESPA que serão utilizadas nos fluxos de tarificação de negócios, posições e eventos.

Os cenários de negócios foram modelados e uma série de mensagens XML foi concebida. No devido tempo, essas mensagens serão submetidas à ISO20022, órgão de registro, para aprovação. Cada cenário de negócio é representado por um fluxo de trabalho padronizado e um número fixo de mensagens normalizadas.

Lista de Mensagens e Arquivos

1. CalculatedFee <BVBG.023.01>

O arquivo CalculatedFee é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Participante de Registro e detalha as tarifas calculadas e cobradas no dia.

2. FeeVariablesInformation< BVBG.024.01>

A BM&FBOVESPA disponibiliza no site, o arquivo FeeVariablesInformation informando os valores utilizados como parâmetros nos cálculos das tarifas. O Participante faz o download deste arquivo.

3. FeeUnitCostReport < BVBG.025.01>

O arquivo FeeUnitCostReport é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação contendo as informações de custo unitário vigentes para o período dos clientes normais e HFT com apuração periódica.



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

4. DailyFeeUnitCostReport < BVBG.031.01>

O arquivo DailyFeeUnitCostReport é enviado pela BM&FBOVESPA diariamente ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação contendo as informações de custo unitário vigentes para o período dos clientes normais e HFT com apuração periódica. O arquivo conterá informações de mercadorias cujos custos dependem do cálculo diário do prazo para seu vencimento.

5. FeeUnitCost Public Report < BVBG.043.01>

A BM&FBOVESPA disponibiliza no site, o arquivo FeeUnitCostPublicReport contendo as informações de custo unitário base vigentes para o período dos clientes normais e HFT com apuração periódica.

6. DailyFeeUnitCost Public Report < BVBG.044.01>

A BM&FBOVESPA disponibiliza no site, o arquivo DailyFeeUnitCostPublicReport contendo as informações de custo unitário base vigentes para o período dos clientes normais e HFT com apuração periódica. O arquivo conterá informações de mercadorias cujos custos dependem do cálculo diário do prazo para seu vencimento.

7. EquitiesFeePublicInformation < BVBG.072.01>

A BM&FBOVESPA disponibiliza no site, o arquivo EquitiesFeePublicInformation contendo as informações das taxas cobradas para operações normais e daytrade no segmento Equities.

8. FeeUnitCostReport <bvmf.092.01>

A BM&FBOVESPA enviará a mensagem bvmf.092,01 FeeUnitCostReport em decorrência de atualização cadastral ocorrida ao longo do dia que pode alterar o custo unitário já enviado nos arquivos de tarifação de Derivativos Listados no início do dia.



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Conteúdo do Arquivo

Sigla do Arquivo	Nome do Arquivo	Conteúdo do Arquivo
BVBG.023.01	CalculatedFee	bvmf.089.01
BVBG.024.01	FeeVariablesInformation	bvmf.091.01
BVBG.025.01	FeeUnitCostReport	bvmf.092.01
BVBG.031.01	DailyFeeUnitCostReport	bvmf.092.01
BVBG.043.01	FeeUnitCostPublicReport	bvmf.092.01
BVBG.044.01	DailyFeeUnitCostPublicReport	bvmf.092.01
BVBG.072.01	EquitiesFeePublicInformation	bvmf.181.01



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Como Ler

UML (Unified Modeling Language) tem sido usada para descrever modelos lógicos e de negócios. Como o entendimento de UML não é um requisito para a discussão de padrões de negócios, o formato de dados para as mensagens é apresentado de uma forma mais amigável. Esta forma de representação é gerada automaticamente a partir dos modelos, garantindo assim, a coerência absoluta entre as informações do modelo e a norma publicada.



Fluxos de Mensagens e Arquivos

Informa Tarifas Calculadas

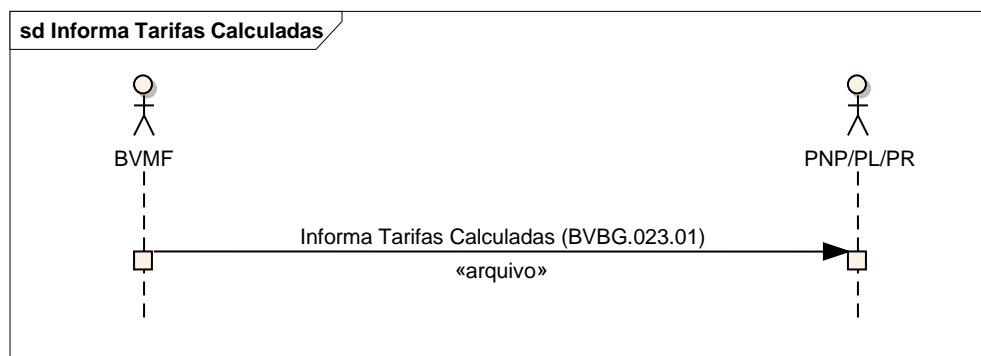
Introdução

Este fluxo ilustra o uso do arquivo CalculatedFee.

Cenário1 :BM&FBOVESPA Informa Tarifas Calculadas pelo sistema de tarifação

Este cenário é básico e o mais elementar para informar a tarifa calculada.

A BM&FBOVESPA envia um arquivo CalculatedFee (BVBG.023.01) ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação informando as tarifas calculadas de emolumentos, taxa de registro, taxa de permanência e taxa de liquidação.





Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Informa Parâmetros Tarifação

Introdução

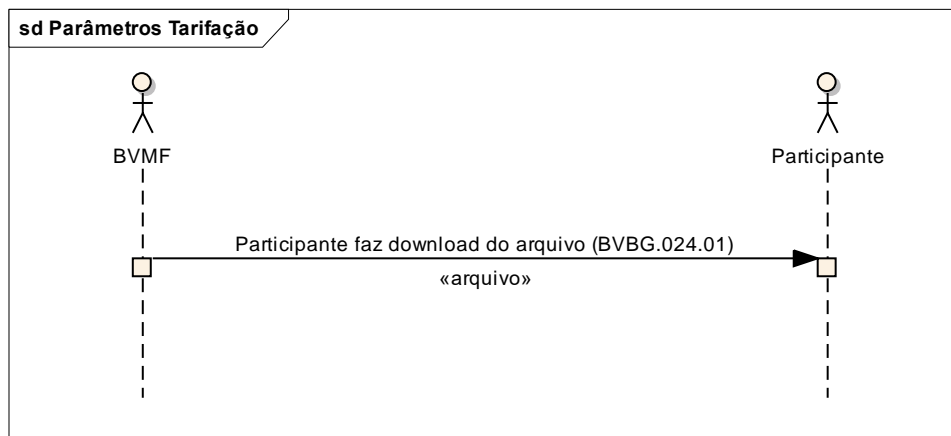
Este fluxo ilustra o uso do arquivo FeeVariablesInformation.

Cenário1

BM&FBOVESPA Informa os parâmetros dos cálculos das tarifas

Este cenário é básico e elementar para informar os parâmetros utilizados no cálculo das tarifas.

A BM&FBOVESPA disponibiliza no site, o arquivo FeeVariablesInformation (BVBG.024.01) informando os parâmetros utilizados no cálculo das tarifas de emolumentos, taxa de registro, taxa de permanência e taxa de liquidação. O Participante faz o download deste arquivo.





Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Informa Custo Unitário

Introdução

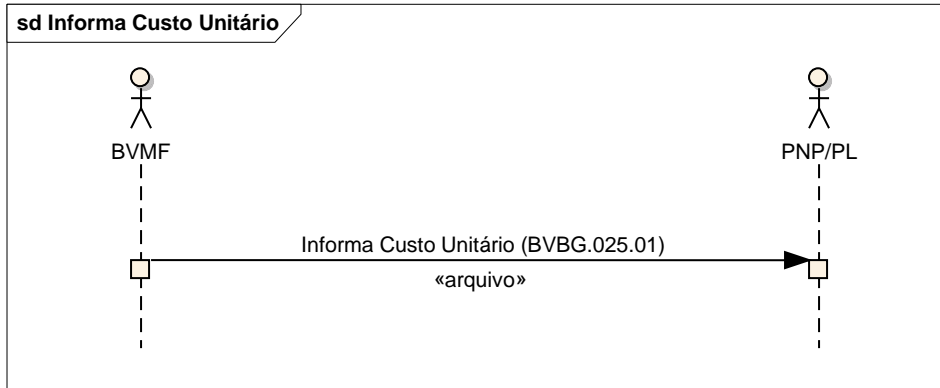
Este fluxo ilustra o uso do arquivo FeeUnitCostReport.

Cenário1

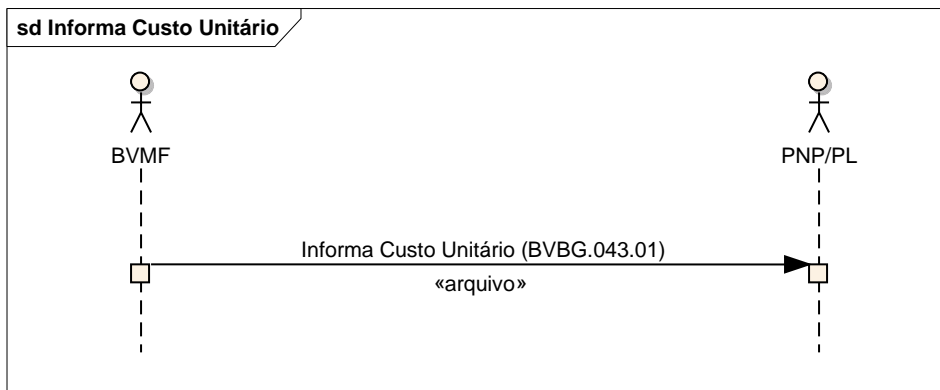
BM&FBOVESPA Informa os custos unitários

Este cenário é básico e elementar para informar os custos unitários do período.

O arquivo FeeUnitCostReport (BVBG.025.01) é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno e Participante de Liquidação para informar os valores dos custos unitários dos clientes normais e HFT periódicos mensais. Apenas as contas de clientes, com volume médio superior a primeira faixa de cobrança, são incluídas no arquivo BVBG.025. Os clientes que se encontram na primeira faixa de cobrança são tarifados considerando os custos divulgados no arquivo BVBG.043. Dessa forma, se o participante não tiver nenhuma conta de cliente que se enquadre no critério para estar nos arquivos BVBG.025, não terá o arquivo gerado na data. Este arquivo apresenta os custos unitários de clientes normais e clientes de alta frequência (HFT) com perfil periódico. É apurado semanalmente, porém a divulgação é diária para considerar contas e contratos cadastrados até o dia anterior. Aplicável a contratos que não utilizam prazo no cálculo da tarifação. O valor de custo neste arquivo está na moeda de liquidação do cliente. Se o cliente tem sua liquidação em dólares (Investidores não residentes pela Resolução CMN 2687) o valor do custo estará em dólares.



A BM&FBOVESPA disponibiliza no site, o arquivo FeeUnitCostPublicReport (BVBG.043.01) informando os valores base dos custos unitários aplicáveis para o período dos clientes normais e HFT periódicos.





Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Informa Custo Unitário - diário

Introdução

Este fluxo ilustra o uso do arquivo DailyFeeUnitCostReport.

Cenário1

BM&FBOVESPA Informa os custos unitários diários

Este cenário é básico e elementar para informar os custos unitários do período.

A BM&FBOVESPA envia um arquivo DailyFeeUnitCostReport (BVBG.031.01) ao Participante de Negociação ou Participante com Liquidação Direta informando os valores dos custos unitários diários aplicáveis para o período dos clientes normais e HFT periódicos. O arquivo conterá informações de mercadorias cujos custos dependem do cálculo diário do prazo para seu vencimento.

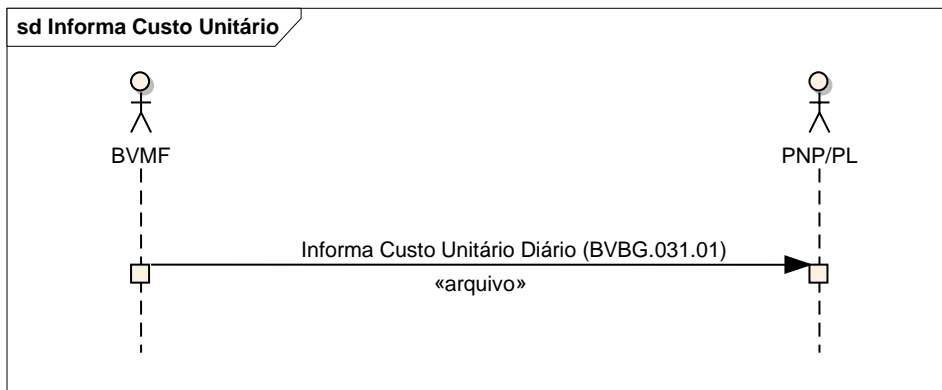
Este arquivo apresenta os custos unitários somente para os clientes normais e HFT periódicos que apresentam volume superior a primeira faixa de cobrança. Para os clientes que estão na primeira faixa de cobrança ou não apresentam volume médio, é aplicado o custo básico que está no arquivo BVBG.044.01.



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação



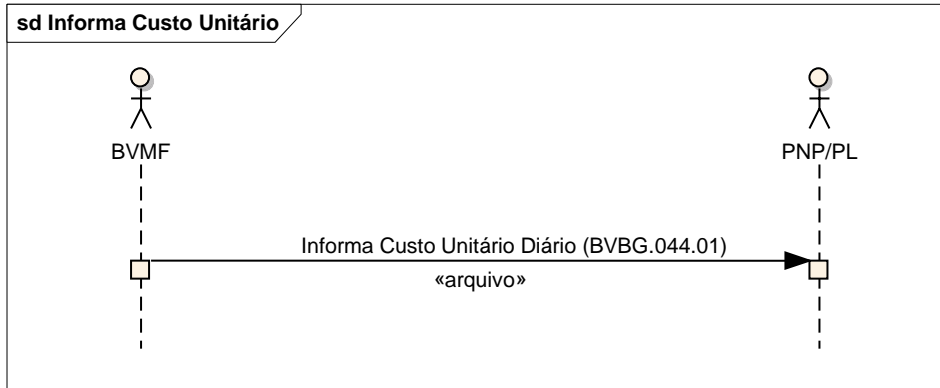
A BM&FBOVESPA disponibiliza no site, o arquivo DailyFeeUnitCostPublicReport (BVBG.044.01) informando os valores base dos custos unitários diários aplicáveis para o período dos clientes normais e HFT periódicos. O arquivo conterá informações de mercadorias cujos custos dependem do cálculo diário do prazo para seu vencimento.



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação



Informa valor das taxas de Equities

Introdução

Este fluxo ilustra o uso do arquivo EquitiesFeeInformation.

Cenário1

BM&FBOVESPA Informa os valores das taxas das negociações do segmento de Equities

Este cenário é básico e elementar para informar os valores das taxas.

O arquivo EquitiesFeeInformation é disponibilizado pela BM&FBOVESPA aos Participantes, no site BVMF, para informar os valores das taxas cobrados para operações normais e daytrade no segmento Equities

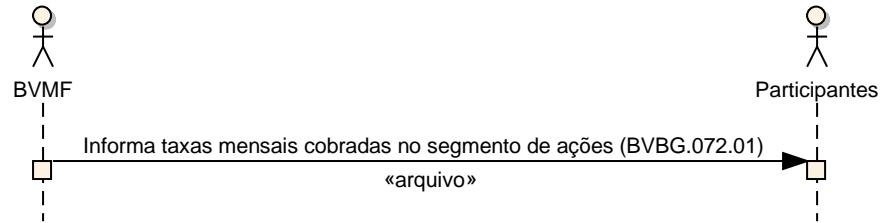


Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

sd Informa Taxas Mensais do Segmento Equities





Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

BVBG.023.01 CalculatedFee

Funcionalidade do Arquivo

Escopo

O arquivo CalculatedFee é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação para informar os negócios, posições ou eventos tarifados naquele dia com as respectivos tarifas.

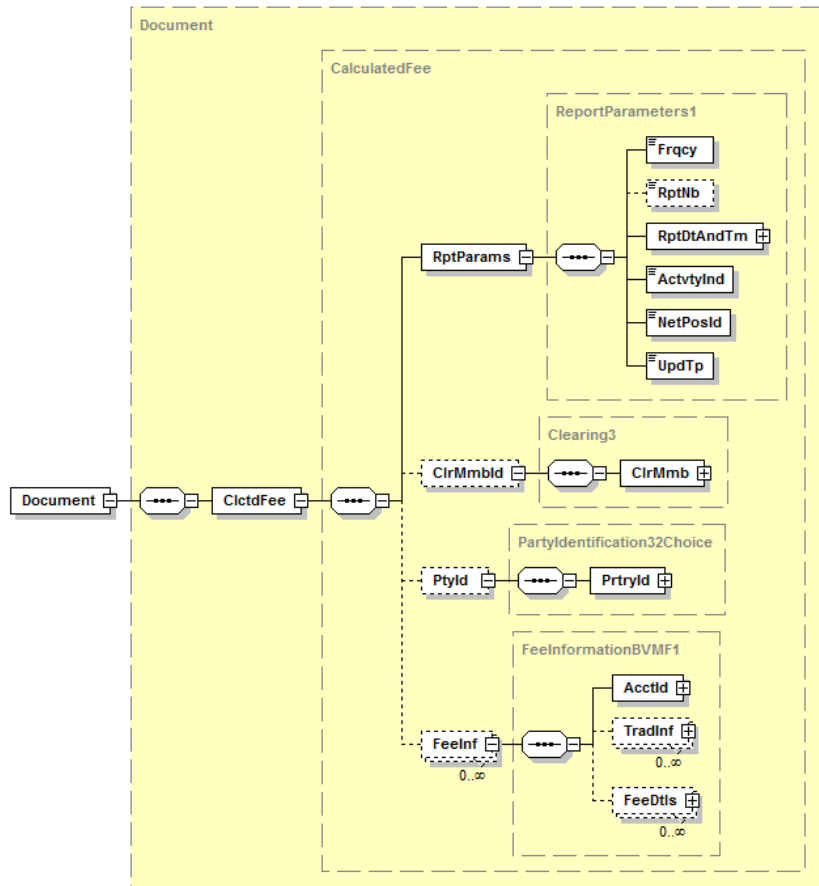
Esse arquivo é gerado diariamente.

Uso

Este arquivo detalha ao participante as tarifas calculadas naquele dia para cada cliente.

Diagrama da Mensagem

O arquivo BVBG.023.01 é composto pela mensagem “CalculatedFee” (bvmf.089.01)



Generated by XmlSpy

www.altova.com



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Regras:

R1 - Se o produto tem taxa de liquidação financeira o campo SettlementFeeValue deve ser preenchido.

R2 - Se o produto tem entrega física então o campo DeliveryCashSettlementValue deve ser preenchido.

Estrutura da mensagem “CalculatedFee” (bvmf.089.01)

O header do arquivo está no manual técnico.

BVBG.023.01 – Calculated Fee

bvmf.089.01 – CalculatedFee

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the calculated fee report	Parâmetros relacionados ao relatório de tarifas calculadas.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda.	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX" .	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbld	[0..1]	+	Provides Clearing Member Identification	Informa os detalhes de identificação do membro de compensação.	
2.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornecer detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CODIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CODIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		PartyIdentification	Ptyld	[0..1]	+	Block with the participant identification.	Bloco com a identificação do participante.	
3.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		FeeInformation	FeeInf	[0..*]	+	Provides Fee Information	Informações sobre a tarifação.	
4.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
4.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
4.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.2		TradeInformation	TradInf	[0..*]	+	Provides Trade Information	Informação sobre a negociação.	
4.2.1		TradeIdentification	TradId	[0..1]	Max35Text	References trade identification.	Referencia a identificação da negociação.	
4.2.2		TradeDate	TradDt	[0..1]	+	Provides the date and time of trade transaction.	Informa a data e hora da transação.	
4.2.2.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
4.2.3		AllocationInformation	AllcInf	[0..1]	+	Provides Allocation Identification	Informação da Identificação da Alocação	
4.2.3.1		AllocationIdentification	AllcId	[1..1]	Max35Text	Identification number of the allocation in the BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação provido pela BM&FBOVESPA.	
4.2.4		FeeDetails	FeeDtls	[1..1]	+	Provides Fee Details Information	Detalhes sobre as taxas (Emolumentos e Taxa de Registro).	
4.2.4.1		DayTradeIndicator	DayTradInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a day trade transaction or no.	Indica se é uma operação de Day Trade ou não.	
4.2.4.2		Quantity	Qty	[1..1]	+	Specifies the number of contracts.	Especifica a quantidade de contratos.	
4.2.4.2.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
4.2.4.3		ExchangeFeeSettlementDate	XchgFeeStlmDt	[0..1]	+	References the date of the trade payment.	Referencia data de pagamento dos emolumentos	
4.2.4.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
4.2.4.4		ExchangeFeeValue	XchgFeeVal	[0..1]	+	Provides the Exchange Fee Information	Informações de Emolumentos.	
4.2.4.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
4.2.4.5		RegistrationSettlementDate	RegnStlmDt	[0..1]	+	Date of payment of registration fees.	Data de pagamento da taxa de registro.	
4.2.4.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
4.2.4.6		RegistrationFeeValue	RegnFeeVal	[0..1]	+	Provides Registration Fee	Informações da Taxa de Registro.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
4.2.4.6.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF ActiveOrHistoric CurrencyAnd2D ecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
4.3		FeeDetails	FeeDtls	[0..*]	+	Provides Fee Details Information (Exchange fee and Registration fee)	Detalhes sobre as taxas (permanência e liquidação).	
4.3.1		PermanenceFeeInfor mation	PrmcFeeInf	[0..1]	+	Provides Permanence Fee Information.	Informações da Taxa de Permanência.	
4.3.1.1		ProvisionDate	PrvsnDt	[1..1]	+	Refers to the provision date of the trade payment.	Referencia a data prevista do pagamento.	
4.3.1.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
4.3.1.2		SettlementDate	SttlmDt	[0..1]	+	Refers to the date of the fee payment.	Referencia data de pagamento das taxas de negociações.	
4.3.1.2.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
4.3.1.3		FinancialInstrumentAt tributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
4.3.1.3.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmen tCode	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Equity - Cash2 - Equity derivative3 - Corporate bonds4 - Agribusiness5 - Financial6 - Metal7 - Energy8 - Gov. Bonds9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Ações - Vista2 - Ações - Derivativos3 - Renda fixa privada4 - Agronegócio5 - Financeiro6 - Metais7 - Energia elétrica8 - Títulos públicos9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.</p>	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
4.3.1.3.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	<p>Represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Spot2 - Future3 - Options on Spot4 - Options on Future5 - Forward10 - Cash12 - Options exercise (call)13 - Options exercise (put)17 - Auction20 - Odd Lot30 - Equity Forward70 - Equity Call80 - Equity Put <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo</p> <ul style="list-style-type: none">1 - MERCADO DISPONIVEL2 - MERCADO FUTURO3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL4 - OPCOES SOBRE FUTURO5 - MERCADO TERMO10 - Vista12 - Exercício de opções de compra13 - Exercício de opções de venda17 - Leilão20 - Fracionário30 - Termo70 - OPC80 - OPV <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists</p>	
4.3.1.3.3		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, etc.	Ativo associado ao papel., tal como DOL BGI OZ1, WDL, CNI, etc.	
4.3.1.4		PermanenceFeeValue	PrmcFeeVal	[0..1]	+	Provides daily permanence fee value.	Informações do cálculo diário da taxa de permanência	
4.3.1.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAndDecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
4.3.1.5		TotalPermanenceFeeValue	TtlPrmcFeeVal	[0..1]	+	Provides total permanence fee value	Informações do valor acumulado da taxa de permanência.	
4.3.1.5.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAndDecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
4.3.1.6		InitialPosition	InitlPos	[1..1]	+	Provides Initial Position	Informações da Posição Inicial.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
4.3.1.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa como um valor numérico.	
4.3.1.7		BuyQuantity	BuyQty	[1..1]	+	Provides Buy Quantity information.	Informações da Quantidade de Compra.	
4.3.1.7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa como um valor numérico.	
4.3.1.8		SellQuantity	SellQty	[1..1]	+	Provides Sell Quantity Information	Informações da Quantidade de Venda.	
4.3.1.8.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa como um valor numérico.	
4.3.2		SettlementFeeInformation	SttlmFeeInf	[0..1]	+	Provides Settlement Fee information	Informações da taxa de liquidação.	
4.3.2.1		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	+	References the date of the trade payment.	Referencia data de pagamento das taxas de negociações.	
4.3.2.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
4.3.2.2		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
4.3.2.2.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Equity - Cash2 - Equity derivative3 - Corporate bonds4 - Agribusiness5 - Financial6 - Metal7 - Energy8 - Gov. Bonds9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Ações - Vista2 - Ações - Derivativos3 - Renda fixa privada4 - Agronegócio5 - Financeiro6 - Metais7 - Energia elétrica8 - Títulos públicos9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.</p>	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
4.3.2.2.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	Represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists	
4.3.2.2.3		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, etc.	Ativo associado ao papel., tal como DOL BGI OZ1, WDL, CNI, etc.	
4.3.2.3		Quantity	Qty	[0..1]	+	Provides Quantity Information	Informações da Quantidade de Contratos.	
4.3.2.3.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa como um valor numérico.	
4.3.2.4		SettlementFeeValue	SttlmFeeVal	[0..1]	+	Provides calculated Fee value.	Valor da Tarifa Calculada.	R1
4.3.2.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
4.3.2.5		DeliveryCashSettlementValue	DivryCshSttlmVal	[0..1]	+	Delivery cash settlement value	Valor da liquidação por entrega física	R2
4.3.2.5.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF5ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

BVBG.024.01 FeeVariablesInformation

Funcionalidade do Arquivo

Escopo

O arquivo FeeVariablesInformation é disponibilizado pela BM&FBOVESPA aos Participantes, no site BVMF, com informações dos valores utilizados como parâmetros nas fórmulas dos cálculos das tarifas.

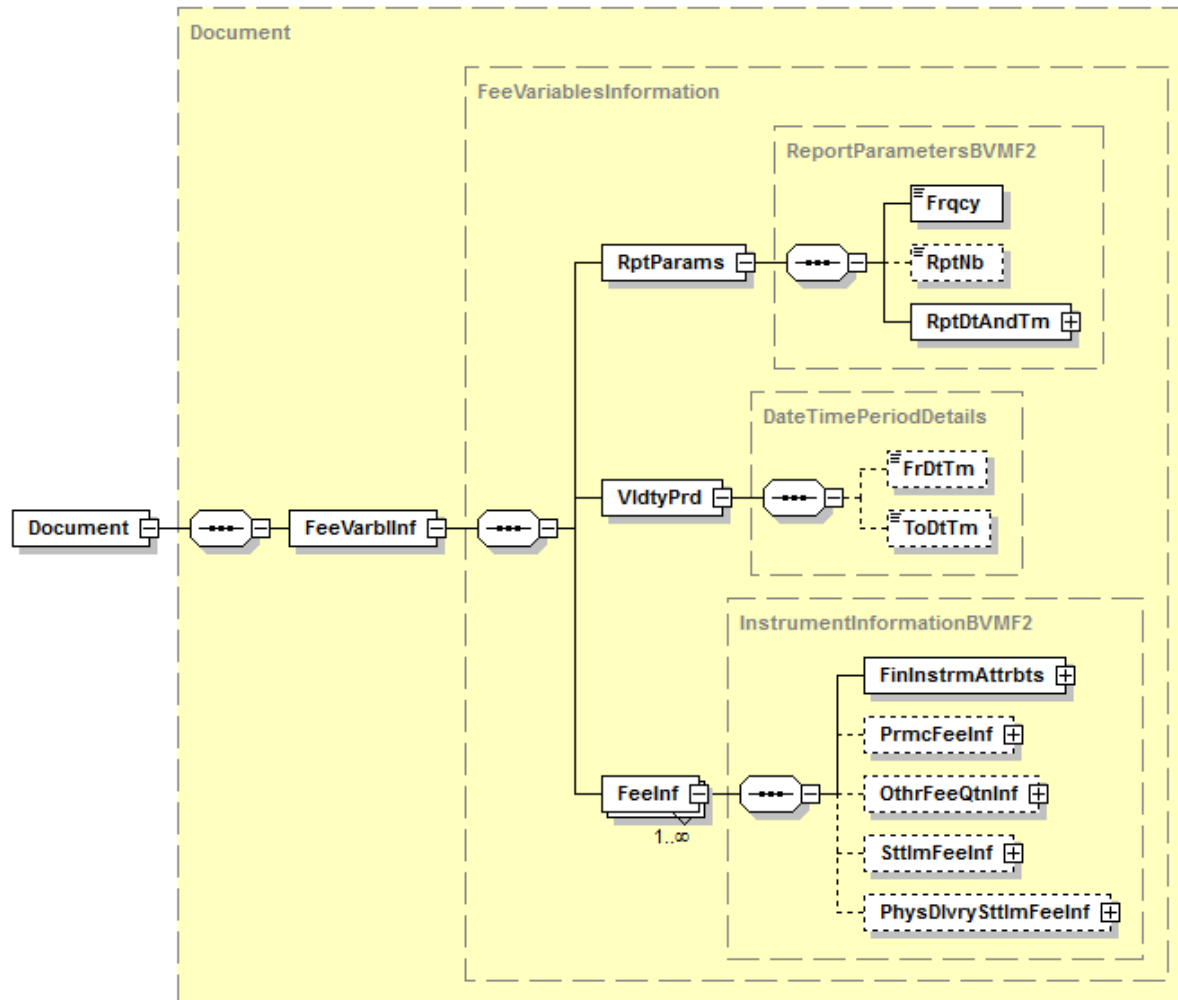
Esse arquivo é gerado mensalmente, porém se uma mercadoria nova é criada ele é gerado novamente durante o período.

Uso

Este arquivo permite que os Participantes utilizem os parâmetros utilizados pela tarifação para fins de conferências e réplicas dos cálculos.

Diagrama da Mensagem

O arquivo BVBG.024.01 é composto pela mensagem “FeeVariablesInformation” (bvmf.091.01)



Generated by XmlSpy

www.altova.com



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

Regras

R1 – O conteúdo válido para este campo é MNTH

Estrutura

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the calculated fee report.	Parâmetros relacionados ao relatório de tarifas calculadas.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency1Code	Frequency of the report. MNTH - Event takes place every month or once a month. DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand WEEK - Event takes place once a week.	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: MNTH – O evento ocorre a cada mês ou uma vez por mês. DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda. WEEK = Evento que ocorre uma vez por semana.	R1
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		ValidityPeriod	VldtyPrd	[1..1]	+	Beginning period for which the parameters are valid.	Início do período para o qual os parâmetros são válidos.	
2.1		FromDateTime	FrDtTm	[0..1]	ISODateTime	Date at which the range starts.	Data início.	
2.2		ToDateTime	ToDtTm	[0..1]	ISODateTime	Date at which the range ends.	Data fim.	
3.0		FeeInformation	FeeInf	[1..*]	+	Information on factors and values used to calculate rates.	Informação sobre fatores e valores utilizados no cálculo de taxas.	
3.1		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
3.1.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process.</p> <p>Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Equity - Cash2 - Equity derivative3 - Corporate bonds4 - Agribusiness5 - Financial6 - Metal7 - Energy8 - Gov. Bonds9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Ações - Vista2 - Ações - Derivativos3 - Renda fixa privada4 - Agronegócio5 - Financeiro6 - Metais7 - Energia elétrica8 - Títulos públicos9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.</p>	
3.1.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	<p>Represents the Second level of market classification in the post trade process.</p> <p>Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Spot2 - Future3 - Options on Spot4 - Options on Future5 - Forward10 - Cash12 - Options exercise (call)13 - Options exercise (put)17 - Auction20 - Odd Lot30 - Equity Forward70 - Equity Call80 - Equity Put <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case</p>	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo</p> <ul style="list-style-type: none">1 - MERCADO DISPONIVEL2 - MERCADO FUTURO3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL4 - OPCOES SOBRE FUTURO5 - MERCADO TERMO10 - Vista12 - Exercício de opções de compra13 - Exercício de opções de venda17 - Leilão20 - Fracionário30 - Termo70 - OPC80 - OPV <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o</p>	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
						the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists	
3.1.3		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, etc.	Ativo associado ao papel., tal como DOL BGI OZ1, WDL, CNI, etc.	
3.2		PermanenceFeeInformation	PrmcFeeInf	[0..1]	+	This block provides information about Permanence Fee.	Este bloco possui as informações referentes a taxa de permanência.	
3.2.1		ReductionFactor	RdctnFctr	[1..1]	DecimalNumber	Reduction factor of base rate.	Fator de redução da base de incidência da taxa.	
3.2.2		DailyFinancialValue	DailyFinVal	[1..1]	+	Daily Value rate to stay in the actual commodity.	Valor diário da taxa de permanência para a mercadoria	
3.2.2.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
3.2.3		QuotationInformation	QtnInf	[0..1]	+	This block provides information about the quotation parameters.	Este bloco possui as informações de cotação relacionadas às Taxas de Permanência.	
3.2.3.1		ReferenceDate	RefDt	[1..1]	ISODate	Reference date of used indicator.	Data de referência do indicador utilizado	
3.2.3.2		ConversionIndicatorValue	ConvIndVal	[1..1]	Max35Text	Value of indicator.	Valor do indicador.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
3.2.3.3		ConversionIndicator	Convslnd	[1..1]	+	Indicator used to convert to real values	Indicador utilizado para conversão de valores para reais	
3.2.3.3.1		OtherIdentification	Othrlid	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
3.2.3.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
3.2.3.3.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo de identificação.	
3.2.3.3.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8 (Security source)	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	
3.2.3.3.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
3.2.3.3.2.1		MarketIdentifierCode	MktldrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
3.3		OtherFeeQuotationInformation	OthrFeeQtnl nf	[0..1]	+	This block provides information about the quotation parameters.	Este bloco possui as informações referentes a indicadores utilizados para cálculos dos emolumentos e taxa de registro.	
3.3.1		ReferenceDate	RefDt	[1..1]	ISODate	Reference date of used indicator.	Data de referência do indicador utilizado	
3.3.2		ConversionIndicatorValue	ConvslndVal	[1..1]	Max35Text	Value of indicator.	Valor do indicador.	
3.3.3		ConversionIndicator	Convslnd	[1..1]	+	Indicator used to convert to real values	Indicador utilizado para conversão de valores para reais	
3.3.3.1		OtherIdentification	Othrlid	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
3.3.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
3.3.3.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo de identificação.	
3.3.3.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8 (Security source)	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	
3.3.3.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
3.3.3.2.1		MarketIdentifierCode	MktldrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
3.4		SettlementFeeInformation	SttlmFeeInf	[0..1]	+	This block provides information about Settlement Fee.	Este bloco possui informações sobre a taxa de liquidação.	
3.4.1		QuotationInformation	QtnInf	[0..1]	+	This block provides information about the quotation parameters related Settlement Fee.	Este bloco possui as informações de cotação relacionadas às Taxas de Liquidação.	
3.4.1.1		ReferenceDate	RefDt	[1..1]	ISODate	Reference date of used indicator.	Data de referência do indicador utilizado	
3.4.1.2		ConversionIndicatorValue	ConvslndVal	[1..1]	Max35Text	Value of indicator.	Valor do indicador.	
3.4.1.3		ConversionIndicator	Convslnd	[1..1]	+	Indicator used to convert to real values	Indicador utilizado para conversão de valores para reais	
3.4.1.3.1		OtherIdentification	Othrlid	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
3.4.1.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
3.4.1.3.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo de identificação.	
3.4.1.3.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8 (Security source)	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
3.4.1.3.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
3.4.1.3.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
3.4.2		ContractValue	CtrctVal	[1..1]	+	Fixed value by contract.	Valor fixo por contrato.	
3.4.2.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
3.5		PhysicalDeliverySettlementFeeInformation	PhysDlvrySttlmFeeInf	[0..1]	+	This block provides information about physical delivery rate.	Este bloco possui informações sobre a taxa de liquidação por entrega física.	
3.5.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa. Exemplo: A taxa de 70% deve ser expressa como o valor decimal 0.7.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

BVBG.025.01 FeeUnitCostReport

Funcionalidade do Arquivo

Escopo

O arquivo FeeUnitCostReport é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno e Participante de Liquidação para informar os valores dos custos unitários dos clientes normais e HFT periódicos.

Apenas as contas de clientes, com volume médio superior a primeira faixa de cobrança, são incluídas no arquivo BVBG.025. Os clientes que se encontram na primeira faixa de cobrança são tarifados considerando os custos divulgados no arquivo BVBG.043. Dessa forma, se o participante não tiver nenhuma conta de cliente que se enquadre no critério para estar nos arquivos BVBG.025, não terá o arquivo gerado na data.

Este arquivo apresenta os custos unitários de clientes normais e clientes de alta frequência (HFT) com perfil periódico. É apurado semanalmente, porém a divulgação é diária para considerar contas e contratos cadastrados até o dia anterior. Aplicável a contratos que não utilizam prazo no cálculo da tarifação.

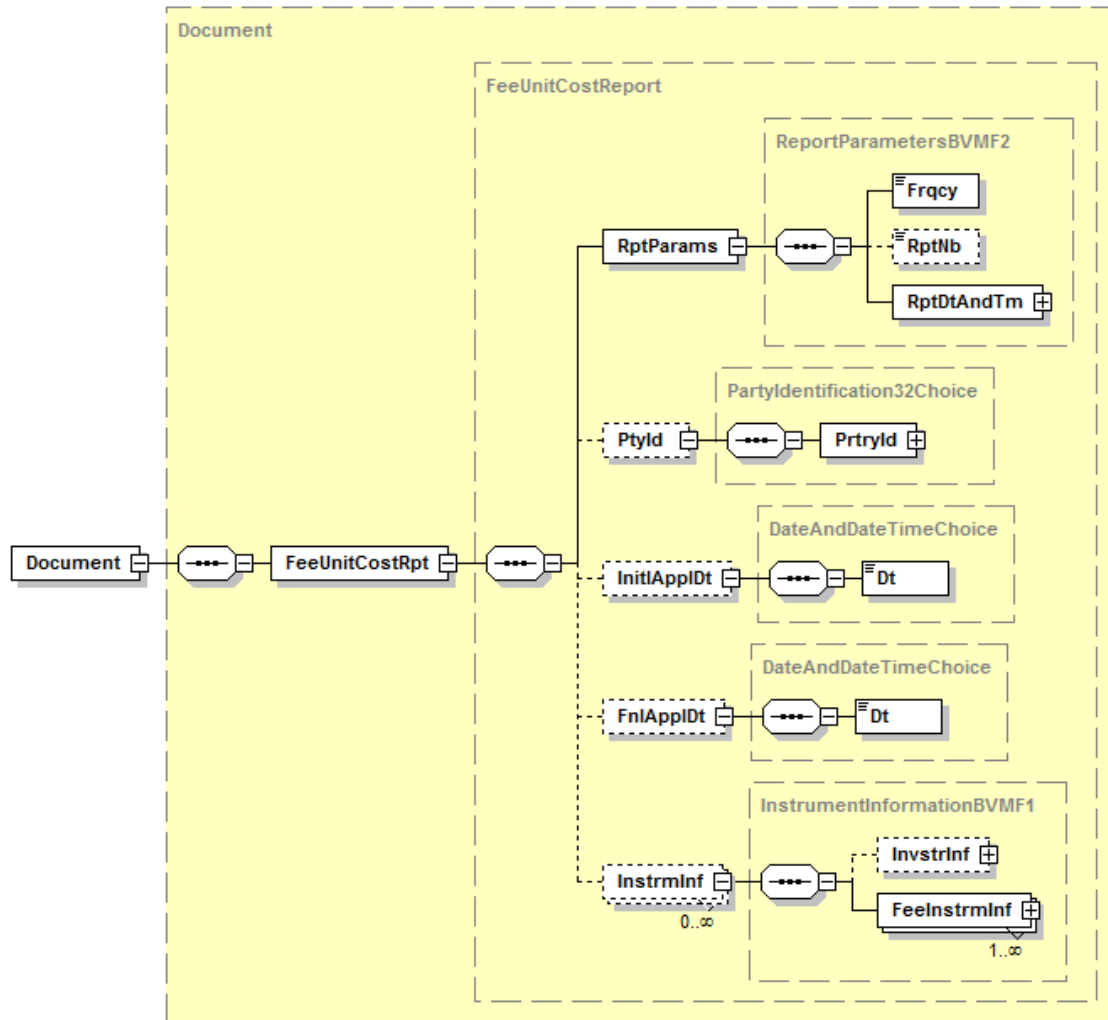
O valor de custo neste arquivo está na moeda de liquidação do cliente. Se o cliente tem sua liquidação em dólares (Investidores não residentes pela Resolução CMN 2687) o valor do custo estará em dólares.

Uso

Este arquivo permite aos Participantes conhecer o custo unitário que será aplicado por mercadoria e conta para o período.

Diagrama da Mensagem

O arquivo BVBG.025.01 é composto pela mensagem “FeeUnitCostReport” (bvmf.092.01)



Generated by XmlSpy

www.altova.com



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

BVBG.025.01- Fee Unit Cost Report

bvmf.092.01 – FeeUnitCostReport

Regras

R1 - Obrigatório apenas para clientes que apresentaram volume no mês anterior.

R2 – O tipo de consolidação é obrigatório caso o valor do indicador de HFT (HghFrqcyTradrlnd) seja “true”.

R3 - Obrigatório se mercadoria é DOL ou DR1 e mercado é 2.

R4 - Obrigatório para as operações de SCC e SCS.

R5 - Atributo de preenchimento obrigatório para os produtos de opções de dólar, opções de mini de dólar e volatilidade de dólar.

Estrutura

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the calculated fee report.	Prâmetros relacionados ao relatório de tarifas calculadas.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency1Code	Frequency of the report. MNTH - Event takes place every month or once a month. DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand WEEK - Event takes place once a week.	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: MNTH – O evento ocorre a cada mês ou uma vez por mês. DAIL - Evento que ocorre todo dia. ONDE - Evento que ocorre sobre demanda.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
							WEEK - Evento que ocorre uma vez por semana.	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		PartyIdentification	Ptyld	[0..1]	+	Provides Identification Party Identification	Informações do Participante	
2.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						This field should be filled with default value = 39.	BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		InitialApplicationDate	InitlAppldt	[0..1]	+	Provides Initial Application Date	Informação da data inicial do período de aplicação.	
3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
4.0		FinalApplicationDate	FnlnAppldt	[0..1]	+	Provides Final Application date	Informação da data final do período de aplicação.	
4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.0		InstrumentInformation	Instrmlnf	[0..*]	+	Provides Instrument Information	Informações do instrumento.	
5.1		InvestorInformation	Invstrlnf	[0..1]	+	Provides Investor information	Informações do investidor.	
5.1.1		HighFrequencyTraderIndicator	HghFrqcyTradrlnf	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the trader is a HFT or no.	Informações de tipo de agrupamento da mensagem.	
5.1.2		ConsolidationType	CnsltnTp	[0..1]	ExternalConsolidationTypeCode	Provides consolidation type information.	Informações de tipo da consolidação.	R2
5.1.3		AccountIdentification	Acctld	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	R1
5.1.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.1.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.1.4		DocumentInformation	Doclnf	[1..1]	+	Provides Document Information	Este bloco possui as informações sobre os documentos do investidor.	
5.1.4.1		ExtendedIdentificationType	XtndedldTp	[1..1]	Extended350Code	Specifies the nature of the identification. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates	Especifica a natureza da identificação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo	
5.1.4.2		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Name or number assigned by an entity to enable recognition of that entity, eg, account identifier.	Nome ou número atribuído por uma entidade para permitir o conhecimento, por exemplo, identificador de conta.	
5.2		FeeInstrumentInformation	FeeInstrmInf	[1..*]	+	Provides Fee Instrument Information	Informações das Taxas do Instrumento	
5.2.1		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
5.2.1.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Equity - Cash2 - Equity derivative3 - Corporate bonds4 - Agribusiness5 - Financial6 - Metal7 - Energy8 - Gov. Bonds9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Ações - Vista2 - Ações - Derivativos3 - Renda fixa privada4 - Agronegócio5 - Financeiro6 - Metais7 - Energia elétrica8 - Títulos públicos9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.</p>	
5.2.1.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	<p>Represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p>	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						<p>1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>exemplo</p> <p>1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	
5.2.1.3		Asset	Asst	[0..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
5.2.1.4		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	<p>Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year)</p> <p>If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence</p>	<p>Código de expiração de um Futuro ou de uma Opção. Ex.:</p> <p>Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano)</p> <p>Se Opção: MYOA:</p>	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
							M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
5.2.2		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	This block provides trade information.	Este bloco possui informações das operações e taxas.	
5.2.2.1		DayTradeIndicator	DayTradInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a day trade transaction or no.	Indica se é uma operação de Day Trade ou não.	
5.2.2.2		DMAIndicator	DMAInd	[0..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a DMA transaction or no.	Indicação se a negociação é DMA.	
5.2.2.3		TradeTransactionType	TradTxTp	[0..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Trade type code . This field requires an externalcodelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalTradeTransactionTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. E.g 0 Regular Trade 29 Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	Código do tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls Ex: 0 Regular Trade 29 (Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	
5.2.2.4		StrategyLegCode	StrtgyLegCd	[0..1]	ExternalStrategyLegCode	Indicates the number of strategy legs 0 - outright 1- 0,01 to 1,99 leg 2 - 2 to 2,99 legs 3 - 3 to 3,99 legs 4 - 4 to 4,99 legs 5 - 5 to 5,99 legs 6 - over 6 legs	Indica a quantidade de pernas da estratégia 0 - outright 1 - 0,01 a 1,99 pernas 2 - 2 a 2,99 pernas 3 - 3 a 3,99 pernas 4 - 4 a 4,99 pernas 5 - 5 a 5,99 pernas 6 - acima de 6 pernas	R5



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						This field requires an external code list. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the B3 updates. In this case the external is ExternalStrategyLegCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalStrategyLegCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
5.2.3		ExchangeFeeUnitCost	XchgFeeUnitCost	[1..1]	+	Provides Exchange Fee Unit Cost Information	Informações de Custo unitário do Emolumento	
5.2.3.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.4		RegistrationFeeUnitCost	RegnFeeUnitCost	[1..1]	+	Provides Registration Fee Unit Cost	Informações de custo unitário da taxa de registro.	
5.2.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.5		RolloverInitialDate	RlvrInitDt	[0..1]	+	Provides Rollover Initial Date	Informações da data inicial de rolagem	R3
5.2.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2.6		RolloverFinalDate	RlvrFnlDt	[0..1]	+	Provides Rollover Final Date	Informações da Data Final de Rolagem.	R3
5.2.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2.7		RolloverExchangeFeeUnitCost	RlvrXchgFeeUnitCost	[0..1]	+	Provides Rollover Exchange Fee Unit Cost	Informações do custo unitário de emolumento durante o período de rolagem.	R3
5.2.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.8		RolloverRegistrationFeeUnitCost	RlvrRegnFeeUnitCost	[0..1]	+	Provides Rollover Registration Fee Unit Cost	Informações do custo unitário de taxa de registro durante o período de rolagem.	R3
5.2.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.9		BacenAuctionDetails	BacenAuctnDtls	[0..1]	+	Contain information about BACEN Auction trades (dollar swap trades).	Detalha informações sobre leilões de swap cambial realizados pelo BACEN.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
5.2.9.1		BacenAuctionIndicator	BacenAuctnInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether an operation to swap auction of BACEN.	Indica se é uma operação de leilão de swap do BACEN	R4

BVBG.031.01- DailyFeeUnitCostReport

Funcionalidade do Arquivo

Escopo

O arquivo DailyFeeUnitCostReport é enviado pela BM&FBOVESPA diariamente ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação contendo as informações de custo unitário vigentes para o período dos clientes normais e HFT com apuração periódica. O arquivo conterá informações de mercadorias cujos custos dependem do cálculo diário do prazo para seu vencimento.

Este arquivo apresenta os custos unitários somente para os clientes normais e HFT periódicos que apresentam volume superior a primeira faixa de cobrança. Para os clientes que estão na primeira faixa de cobrança ou não apresentam volume médio, é aplicado o custo básico que está no arquivo BVBG.044.01.

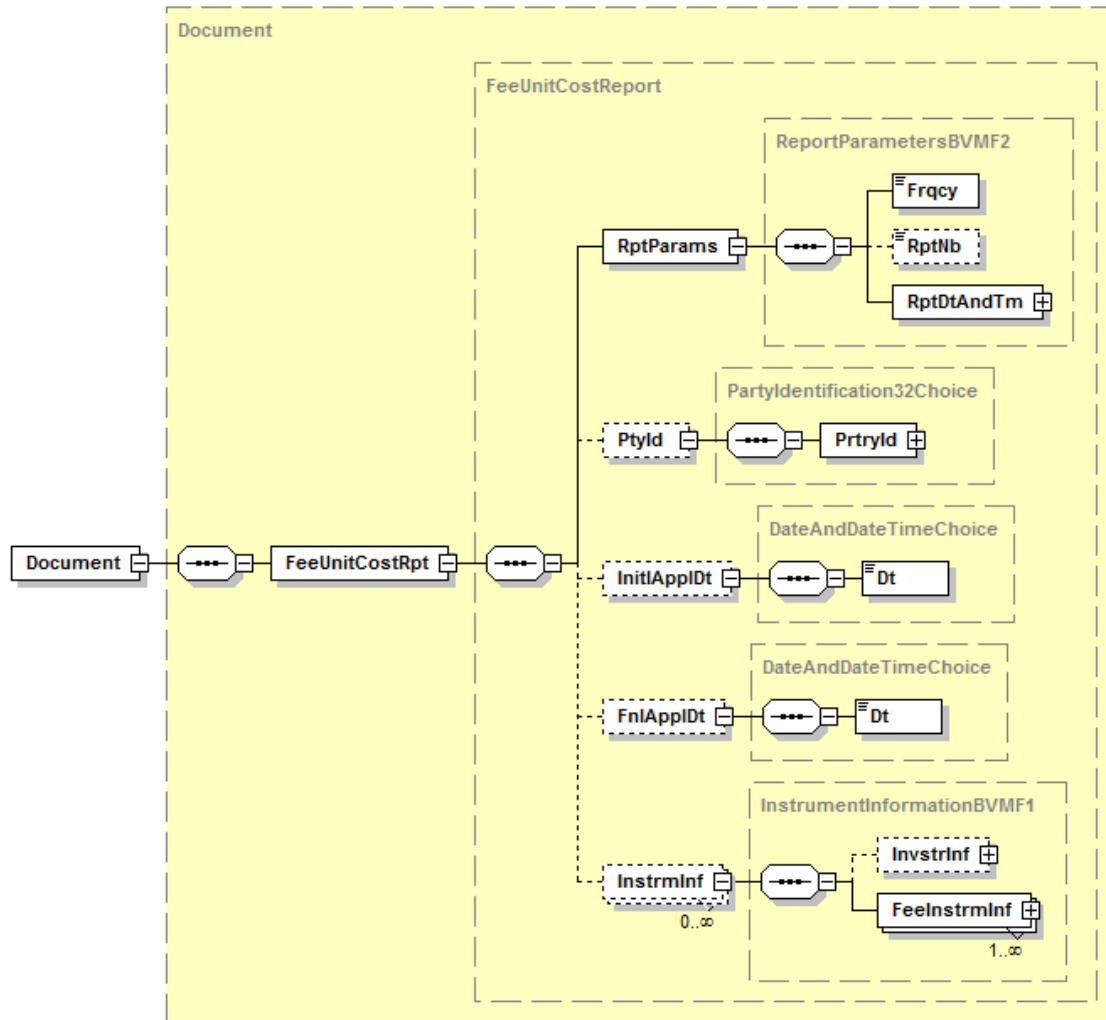
Este arquivo é gerado diariamente para os contratos de grupo de taxa de juros.

Uso

Este arquivo permite aos Participantes conhecer o custo unitário que será aplicado por mercadoria e conta para o período.

Diagrama da Mensagem

O arquivo BVBG.031.01 é composto pela mensagem “FeeUnitCostReport” (bvmf.092.01)



Generated by XmlSpy

www.altova.com



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação**BVBG.031.01- DailyFeeUnitCostReport****bvmf.092.01 – FeeUnitCostReport****Regras**

R1 - Obrigatório apenas para clientes que apresentaram volume no mês anterior.

R2 – O tipo de consolidação é obrigatório caso o valor do indicador de HFT (HghFrqcyTradrlnd) seja “true”.

R3 - Obrigatório se mercadoria é DOL ou DR1 e mercado é 2.

R4 - Obrigatório para as operações de SCC e SCS.

R5 - Atributo de preenchimento obrigatório para os produtos de opções de dólar, opções de mini de dólar e volatilidade de dólar.

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the calculated fee report.	Prâmetros relacionados ao relatório de tarifas calculadas.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency1Code	Frequency of the report. MNTH - Event takes place every month or once a month. DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand WEEK - Event takes place once a week.	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: MNTH – O evento ocorre a cada mês ou uma vez por mês. DAIL - Evento que ocorre todo dia. ONDE - Evento que ocorre sobre demanda. WEEK - Evento que ocorre uma vez por semana.	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		PartyIdentification	Ptyld	[0..1]	+	Provides Identification Party Identification	Informações do Participante	
2.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		InitialApplicationDate	InitlAppIDt	[0..1]	+	Provides Initial Application Date	Informação da data inicial do período de aplicação.	
3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
4.0		FinalApplicationDate	FnlApplDt	[0..1]	+	Provides Final Application date	Informação da data final do período de aplicação.	
4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.0		InstrumentInformation	InstrmInf	[0..*]	+	Provides Instrument Information	Informações do instrumento.	
5.1		InvestorInformation	InvstrInf	[0..1]	+	Provides Investor information	Informações do investidor.	
5.1.1		HighFrequencyTraderIndicator	HghFrqcyTradrInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the trader is a HFT or no.	Informações de tipo de agrupamento da mensagem.	
5.1.2		ConsolidationType	CnsltnTp	[0..1]	ExternalConsolidationTypeCode	Provides consolidation type information.	Informações de tipo da consolidação.	R2
5.1.3		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.	R1
5.1.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.1.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.1.4		DocumentInformation	DocInf	[1..1]	+	Provides Document Information	Este bloco possui as informações sobre os documentos do investidor.	
5.1.4.1		ExtendedIdentificationType	XtndedIdTp	[1..1]	Extended350Code	Specifies the nature of the identification. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Especifica a natureza da identificação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
5.1.4.2		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Name or number assigned by an entity to enable recognition of that entity, eg, account identifier.	Nome ou número atribuído por uma entidade para permitir o conhecimento, por exemplo, identificador de conta.	
5.2		FeeInstrumentInformation	FeeInstrmInf	[1..*]	+	Provides Fee Instrument Information	Informações das Taxas do Instrumento	
5.2.1		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
5.2.1.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Equity - Cash2 - Equity derivative3 - Corporate bonds4 - Agribusiness5 - Financial6 - Metal7 - Energy8 - Gov. Bonds9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Ações - Vista2 - Ações - Derivativos3 - Renda fixa privada4 - Agronegócio5 - Financeiro6 - Metais7 - Energia elétrica8 - Títulos públicos9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.</p>	
5.2.1.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	<p>Represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Spot2 - Future3 - Options on Spot4 - Options on Future	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>exemplo</p> <ul style="list-style-type: none">1 - MERCADO DISPONIVEL2 - MERCADO FUTURO	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.2.1.3		Asset	Asst	[0..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
5.2.1.4		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de expiração de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
5.2.2		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	This block provides trade information.	Este bloco possui informações das operações e taxas.	
5.2.2.1		DayTradeIndicator	DayTradInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a day trade transaction or no.	Indica se é uma operação de Day Trade ou não.	
5.2.2.2		DMAIndicator	DMAInd	[0..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a DMA transaction or no.	Indicação se a negociação é DMA.	
5.2.2.3		TradeTransactionType	TradTxTp	[0..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Trade type code . This field requires an externalcodelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalTradeTransactionTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. E.g 0 Regular Trade 29 Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	Código do tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls Ex: 0 Regular Trade 29 (Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	
5.2.2.4		StrategyLegCode	StrtgyLegCd	[0..1]	ExternalStrategyLegCode	Indicates the number of strategy legs 0 - outright 1- 0,01 to 1,99 leg 2 - 2 to 2,99 legs 3 - 3 to 3,99 legs 4 - 4 to 4,99 legs 5 - 5 to 5,99 legs 6 - over 6 legs This field requires an external code list. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in	Indica a quantidade de pernas da estratégia 0 - outright 1 - 0,01 a 1,99 pernas 2 - 2 a 2,99 pernas 3 - 3 a 3,99 pernas 4 - 4 a 4,99 pernas 5 - 5 a 5,99 pernas 6 - acima de 6 pernas Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir	R5



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						accordance with the requirements of the B3 updates. In this case the external is ExternalStrategyLegCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalStrategyLegCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
5.2.3		ExchangeFeeUnitCost	XchgFeeUnitCost	[1..1]	+	Provides Exchange Fee Unit Cost Information	Informações de Custo unitário do Emolumento	
5.2.3.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.4		RegistrationFeeUnitCost	RegnFeeUnitCost	[1..1]	+	Provides Registration Fee Unit Cost	Informações de custo unitário da taxa de registro.	
5.2.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.5		RolloverInitialDate	RlvrInitDt	[0..1]	+	Provides Rollover Initial Date	Informações da data inicial de rolagem	R3
5.2.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2.6		RolloverFinalDate	RlvrFnlDt	[0..1]	+	Provides Rollover Final Date	Informações da Data Final de Rolagem.	R3
5.2.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2.7		RolloverExchangeFeeUnitCost	RlvrXchgFeeUnitCost	[0..1]	+	Provides Rollover Exchange Fee Unit Cost	Informações do custo unitário de emolumento durante o período de rolagem.	R3
5.2.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.8		RolloverRegistrationFeeUnitCost	RlvrRegnFeeUnitCost	[0..1]	+	Provides Rollover Registration Fee Unit Cost	Informações do custo unitário de taxa de registro durante o período de rolagem.	R3
5.2.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.9		BacenAuctionDetails	BacenAuctnDtls	[0..1]	+	Contain information about BACEN Auction trades (dollar swap trades).	Detalha informações sobre leilões de swap cambial realizados pelo BACEN.	
5.2.9.1		BacenAuctionIndicator	BacenAuctnInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether an operation to swap auction of BACEN.	Indica se é uma operação de leilão de swap do BACEN	R4



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

BVBG.043.01 FeeUnitCostPublicReport

Funcionalidade do Arquivo

Escopo

O arquivo FeeUnitCostPublicReport é disponibilizado pela BM&FBOVESPA aos Participantes, no site BVMF, para informar os valores base dos custos unitários dos clientes normais e HFT periódicos, ou seja, os valores que serão utilizados para clientes que não apresentaram histórico de volume (ADTV) no respectivo período de apuração.

Este arquivo é gerado mensalmente com referência aos valores base para todos os contratos, com exceção daqueles cuja fórmula depende de cálculo de dias para seu vencimento (grupos taxas de juros). No cadastramento de um novo contrato, esse arquivo é gerado novamente.

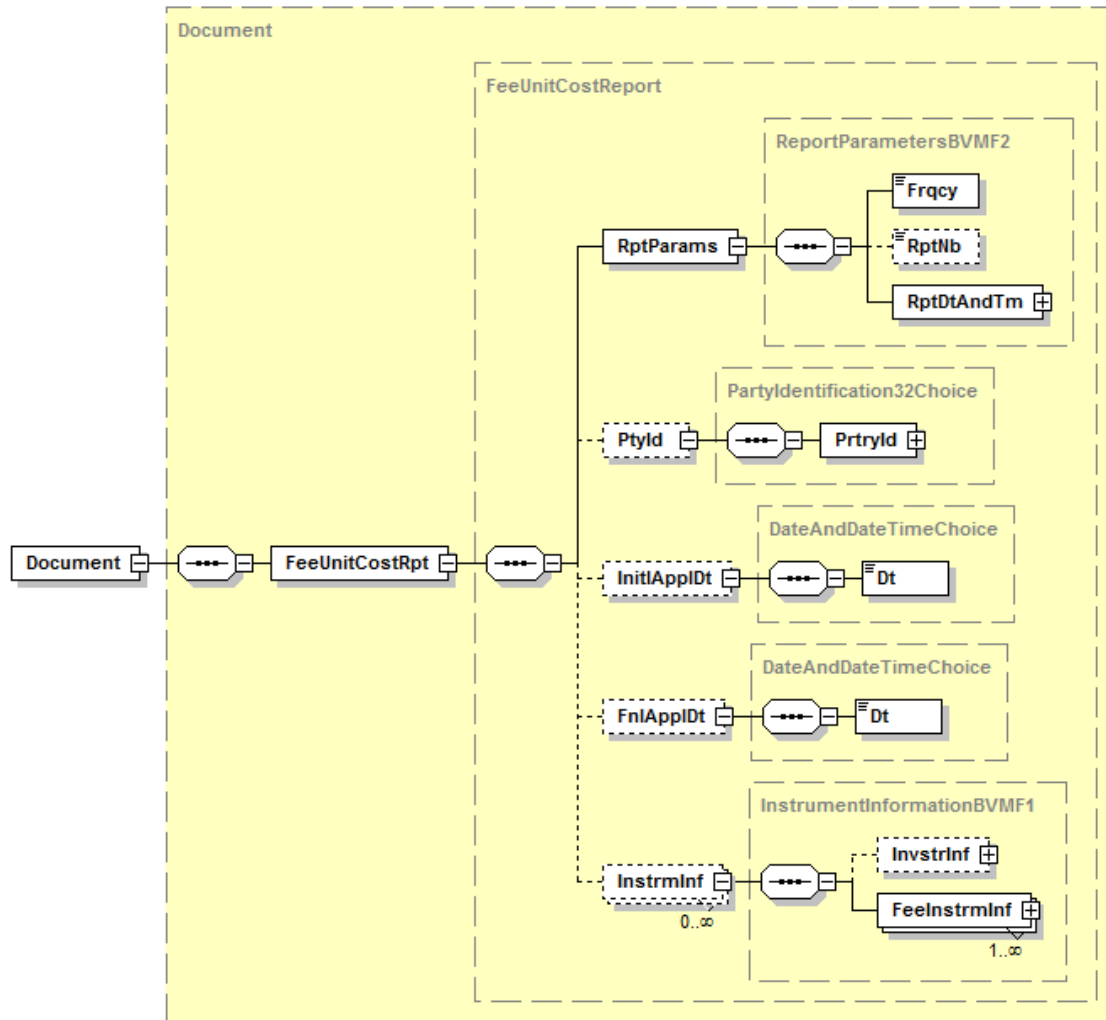
O custos apresentados neste arquivo estão todos em reais.

Uso

Este arquivo permite aos Participantes conhecer o custo unitário que será aplicado por mercadoria para o período.

Diagrama da Mensagem

O arquivo BVBG.043.01 é composto pela mensagem “FeeUnitCostReport” (bvmf.092.01)



Generated by XmlSpy

www.altova.com



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação**BVBG.043.01- FeeUnitCostPublicReport****bvmf.092.01 – FeeUnitCostReport****Regras**

R1 - Obrigatório apenas para clientes que apresentaram volume no mês anterior.

R2 – O tipo de consolidação é obrigatório caso o valor do indicador de HFT (HghFrqcyTradrlnd) seja “true”.

R3 - Obrigatório se mercadoria é DOL ou DR1 e mercado é 2.

R4 - Obrigatório para as operações de SCC e SCS.

R5 - Atributo de preenchimento obrigatório para os produtos de opções de dólar, opções de mini de dólar e volatilidade de dólar.

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the calculated fee report.	Prâmetros relacionados ao relatório de tarifas calculadas.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency1Code	Frequency of the report. MNTH - Event takes place every month or once a month. DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand WEEK - Event takes place once a week.	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: MNTH – O evento ocorre a cada mês ou uma vez por mês. DAIL - Evento que ocorre todo dia. ONDE - Evento que ocorre sobre demanda. WEEK - Evento que ocorre uma vez por semana.	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		PartyIdentification	Ptyld	[0..1]	+	Provides Identification Party Identification	Informações do Participante	
2.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		InitialApplicationDate	InitlAppIDt	[0..1]	+	Provides Initial Application Date	Informação da data inicial do período de aplicação.	
3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
4.0		FinalApplicationDate	FnlApplDt	[0..1]	+	Provides Final Application date	Informação da data final do período de aplicação.	
4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.0		InstrumentInformation	InstrmInf	[0..*]	+	Provides Instrument Information	Informações do instrumento.	
5.1		InvestorInformation	InvstrInf	[0..1]	+	Provides Investor information	Informações do investidor.	
5.1.1		HighFrequencyTraderIndicator	HghFrqcyTradrInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the trader is a HFT or no.	Informações de tipo de agrupamento da mensagem.	
5.1.2		ConsolidationType	CnsltnTp	[0..1]	ExternalConsolidationTypeCode	Provides consolidation type information.	Informações de tipo da consolidação.	R2
5.1.3		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	R1
5.1.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.1.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.1.4		DocumentInformation	DocInf	[1..1]	+	Provides Document Information	Este bloco possui as informações sobre os documentos do investidor.	
5.1.4.1		ExtendedIdentificationType	XtndedIdTp	[1..1]	Extended350Code	Specifies the nature of the identification. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Especifica a natureza da identificação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
5.1.4.2		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Name or number assigned by an entity to enable recognition of that entity, eg, account identifier.	Nome ou número atribuído por uma entidade para permitir o conhecimento, por exemplo, identificador de conta.	
5.2		FeeInstrumentInformation	FeeInstrmInf	[1..*]	+	Provides Fee Instrument Information	Informações das Taxas do Instrumento	
5.2.1		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
5.2.1.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Equity - Cash2 - Equity derivative3 - Corporate bonds4 - Agribusiness5 - Financial6 - Metal7 - Energy8 - Gov. Bonds9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Ações - Vista2 - Ações - Derivativos3 - Renda fixa privada4 - Agronegócio5 - Financeiro6 - Metais7 - Energia elétrica8 - Títulos públicos9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.</p>	
5.2.1.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	<p>Represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Spot2 - Future3 - Options on Spot4 - Options on Future	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>exemplo</p> <ul style="list-style-type: none">1 - MERCADO DISPONIVEL2 - MERCADO FUTURO	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.2.1.3		Asset	Asst	[0..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
5.2.1.4		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de expiração de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
5.2.2		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	This block provides trade information.	Este bloco possui informações das operações e taxas.	
5.2.2.1		DayTradeIndicator	DayTradInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a day trade transaction or no.	Indica se é uma operação de Day Trade ou não.	
5.2.2.2		DMAIndicator	DMAInd	[0..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a DMA transaction or no.	Indicação se a negociação é DMA.	
5.2.2.3		TradeTransactionType	TradTxTp	[0..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	<p>Trade type code .</p> <p>This field requires an externalcodelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA.</p> <p>In this case, the external is ExternalTradeTransactionTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.</p> <p>E.g</p> <p>0 Regular Trade 29 Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade</p>	<p>Código do tipo de negócio.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls</p> <p>Ex:</p> <p>0 Regular Trade 29 (Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade</p>	
5.2.2.4		StrategyLegCode	StrtgyLegCd	[0..1]	ExternalStrategyLegCode	<p>Indicates the number of strategy legs</p> <p>0 - outright 1- 0,01 to 1,99 leg 2 - 2 to 2,99 legs 3 - 3 to 3,99 legs 4 - 4 to 4,99 legs 5 - 5 to 5,99 legs 6 - over 6 legs</p> <p>This field requires an external code list. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in</p>	<p>Indica a quantidade de pernas da estratégia</p> <p>0 - outright 1 - 0,01 a 1,99 pernas 2 - 2 a 2,99 pernas 3 - 3 a 3,99 pernas 4 - 4 a 4,99 pernas 5 - 5 a 5,99 pernas 6 - acima de 6 pernas</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir</p>	R5



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						accordance with the requirements of the B3 updates. In this case the external is ExternalStrategyLegCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalStrategyLegCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
5.2.3		ExchangeFeeUnitCost	XchgFeeUnitCost	[1..1]	+	Provides Exchange Fee Unit Cost Information	Informações de Custo unitário do Emolumento	
5.2.3.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.4		RegistrationFeeUnitCost	RegnFeeUnitCost	[1..1]	+	Provides Registration Fee Unit Cost	Informações de custo unitário da taxa de registro.	
5.2.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.5		RolloverInitialDate	RlvrlnitDt	[0..1]	+	Provides Rollover Initial Date	Informações da data inicial de rolagem	R3
5.2.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2.6		RolloverFinalDate	RlvrfnlDt	[0..1]	+	Provides Rollover Final Date	Informações da Data Final de Rolagem.	R3
5.2.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2.7		RolloverExchangeFeeUnitCost	RlvrxchgFeeUnitCost	[0..1]	+	Provides Rollover Exchange Fee Unit Cost	Informações do custo unitário de emolumento durante o período de rolagem.	R3
5.2.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.8		RolloverRegistrationFeeUnitCost	RlvrrgnFeeUnitCost	[0..1]	+	Provides Rollover Registration Fee Unit Cost	Informações do custo unitário de taxa de registro durante o período de rolagem.	R3
5.2.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.9		BacenAuctionDetails	BacenAuctionDtls	[0..1]	+	Contain information about BACEN Auction trades (dollar swap trades).	Detalha informações sobre leilões de swap cambial realizados pelo BACEN.	
5.2.9.1		BacenAuctionIndicator	BacenAuctionInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether an operation to swap auction of BACEN.	Indica se é uma operação de leilão de swap do BACEN	R4



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

BVBG.044.01- DailyFeeUnitCostPublicReport

Funcionalidade do Arquivo

Escopo

O arquivo DailyFeeUnitCostPublicReport é disponibilizado pela BM&FBOVESPA aos Participantes, no site BVMF, para informar os valores base dos custos unitários dos clientes normais e HFT periódicos, ou seja, os valores que serão utilizados para clientes que não apresentaram histórico de volume (ADTV) no respectivo período de apuração.

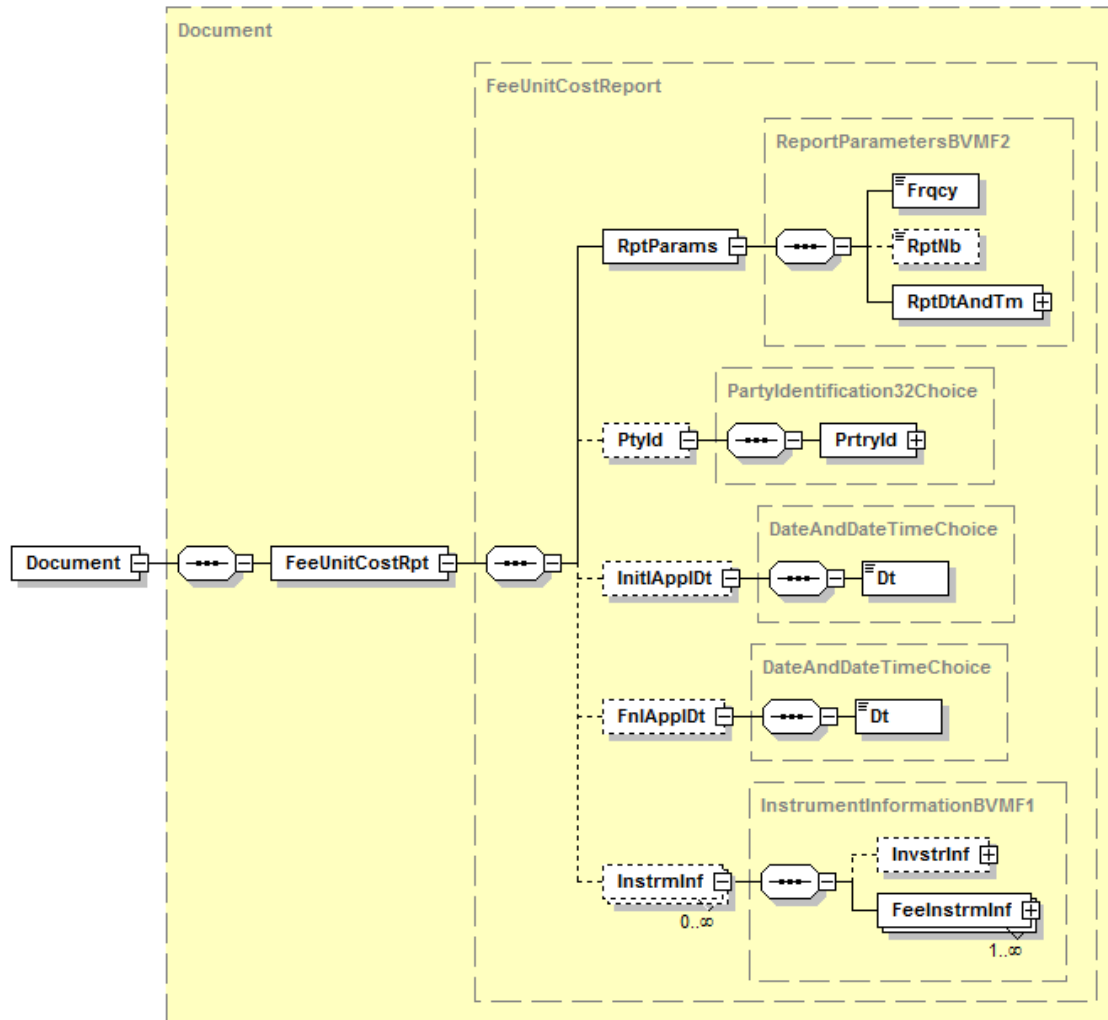
Este arquivo é gerado diariamente para os contratos cujos custos dependem do cálculo diário do prazo para seu vencimento , ou seja, os grupos de taxa de juros.

Uso

Este arquivo permite aos Participantes conhecer o custo unitário que será aplicado por mercadoria para o período.

Diagrama da Mensagem

O arquivo BVBG.044.01 é composto pela mensagem “FeeUnitCostReport” (bvmf.092.01)



Generated by XmlSpy

www.altova.com



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

BVBG.044.01- DailyFeeUnitCostPublicReport

bvmf.092.01 – FeeUnitCostReport

Regras

R1 - Obrigatório apenas para clientes que apresentaram volume no mês anterior.

R2 – O tipo de consolidação é obrigatório caso o valor do indicador de HFT (HghFrqcyTradrlnd) seja “true”.

R3 - Obrigatório se mercadoria é DOL ou DR1 e mercado é 2.

R4 - Obrigatório para as operações de SCC e SCS.

R5 - Atributo de preenchimento obrigatório para os produtos de opções de dólar, opções de mini de dólar e volatilidade de dólar.

Estrutura

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the calculated fee report.	Prâmetros relacionados ao relatório de tarifas calculadas.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency1Code	Frequency of the report. MNTH - Event takes place every month or once a month. DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand WEEK - Event takes place once a week.	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: MNTH – O evento ocorre a cada mês ou uma vez por mês. DAIL - Evento que ocorre todo dia. ONDE - Evento que ocorre sobre demanda. WEEK - Evento que ocorre uma vez por semana.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[0..1]	+	Provides Identification Party Identification	Informações do Participante	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		InitialApplicationDate	InitlAppIdt	[0..1]	+	Provides Initial Application Date	Informação da data inicial do período de aplicação.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
4.0		FinalApplicationDate	FnlAppDt	[0..1]	+	Provides Final Application date	Informação da data final do período de aplicação.	
4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.0		InstrumentInformation	InstrmInf	[0..*]	+	Provides Instrument Information	Informações do instrumento.	
5.1		InvestorInformation	InvstrInf	[0..1]	+	Provides Investor information	Informações do investidor.	
5.1.1		HighFrequencyTraderIndicator	HghFrqcyTradrInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the trader is a HFT or no.	Informações de tipo de agrupamento da mensagem.	
5.1.2		ConsolidationType	CnsltnTp	[0..1]	ExternalConsolidationTypeCode	Provides consolidation type information.	Informações de tipo da consolidação.	R2
5.1.3		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	R1
5.1.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.1.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.1.4		DocumentInformation	DocInf	[1..1]	+	Provides Document Information	Este bloco possui as informações sobre os documentos do investidor.	
5.1.4.1		ExtendedIdentificationType	XtndedIdTp	[1..1]	Extended350Code	Specifies the nature of the identification. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Especifica a natureza da identificação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
							ExternalIdentificationTypeCode no arquivo	
5.1.4.2		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Name or number assigned by an entity to enable recognition of that entity, eg, account identifier.	Nome ou número atribuído por uma entidade para permitir o conhecimento, por exemplo, identificador de conta.	
5.2		FeeInstrumentInformation	FeeInstrmInf	[1..*]	+	Provides Fee Instrument Information	Informações das Taxas do Instrumento	
5.2.1		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
5.2.1.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Equity - Cash2 - Equity derivative3 - Corporate bonds4 - Agribusiness5 - Financial6 - Metal7 - Energy8 - Gov. Bonds9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Ações - Vista2 - Ações - Derivativos3 - Renda fixa privada4 - Agronegócio5 - Financeiro6 - Metais7 - Energia elétrica8 - Títulos públicos9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.</p>	
5.2.1.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	<p>Represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Spot2 - Future	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>exemplo</p>	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						<p>3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	
5.2.1.3		Asset	Asst	[0..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
5.2.1.4		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	<p>Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year)</p> <p>If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence</p>	<p>Código de expiração de um Futuro ou de uma Opção. Ex.:</p> <p>Se Futuro: MMY:</p> <p>M: Código do mês</p> <p>YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano)</p> <p>Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano</p>	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
							O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
5.2.2		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	This block provides trade information.	Este bloco possui informações das operações e taxas.	
5.2.2.1		DayTradeIndicator	DayTradInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a day trade transaction or no.	Indica se é uma operação de Day Trade ou não.	
5.2.2.2		DMAIndicator	DMAInd	[0..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a DMA transaction or no.	Indicação se a negociação é DMA.	
5.2.2.3		TradeTransactionType	TradTxTp	[0..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Trade type code . This field requires an externalcodelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalTradeTransactionTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. E.g 0 Regular Trade 29 Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	Código do tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls Ex: 0 Regular Trade 29 (Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	
5.2.2.4		StrategyLegCode	StrtgyLegCd	[0..1]	ExternalStrategyLegCode	Indicates the number of strategy legs 0 - outright 1- 0,01 to 1,99 leg 2 - 2 to 2,99 legs 3 - 3 to 3,99 legs 4 - 4 to 4,99 legs 5 - 5 to 5,99 legs 6 - over 6 legs This field requires an external code list. These codes and values were	Indica a quantidade de pernas da estratégia 0 - outright 1 - 0,01 a 1,99 pernas 2 - 2 a 2,99 pernas 3 - 3 a 3,99 pernas 4 - 4 a 4,99 pernas 5 - 5 a 5,99 pernas 6 - acima de 6 pernas	R5



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the B3 updates. In this case the external is ExternalStrategyLegCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalStrategyLegCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
5.2.3		ExchangeFeeUnitCost	XchgFeeUnitCost	[1..1]	+	Provides Exchange Fee Unit Cost Information	Informações de Custo unitário do Emolumento	
5.2.3.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.4		RegistrationFeeUnitCost	RegnFeeUnitCost	[1..1]	+	Provides Registration Fee Unit Cost	Informações de custo unitário da taxa de registro.	
5.2.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.5		RolloverInitialDate	RlvrInltDt	[0..1]	+	Provides Rollover Initial Date	Informações da data inicial de rolagem	R3
5.2.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2.6		RolloverFinalDate	RlvrFnldt	[0..1]	+	Provides Rollover Final Date	Informações da Data Final de Rolagem.	R3
5.2.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2.7		RolloverExchangeFeeUnitCost	RlvrXchgFeeUnitCost	[0..1]	+	Provides Rollover Exchange Fee Unit Cost	Informações do custo unitário de emolumento durante o período de rolagem.	R3
5.2.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.8		RolloverRegistrationFeeUnitCost	RlvrRegnFeeUnitCost	[0..1]	+	Provides Rollover Registration Fee Unit Cost	Informações do custo unitário de taxa de registro durante o período de rolagem.	R3
5.2.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.9		BacenAuctionDetails	BacenAuctnDtls	[0..1]	+	Contain information about BACEN Auction trades (dollar swap trades).	Detalha informações sobre leilões de swap cambial realizados pelo BACEN.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
5.2.9.1		BacenAuctionIndicator	BacenAuctnInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether an operation to swap auction of BACEN.	Indica se é uma operação de leilão de swap do BACEN	R4

BVBG.072.01- EquitiesFeePublicInformation

Funcionalidade do Arquivo

Escopo

O arquivo EquitiesFeeInformation é disponibilizado pela BM&FBOVESPA aos Participantes, no site BVMF, para informar as taxas cobradas para operações normais e daytrade no segmento Equities

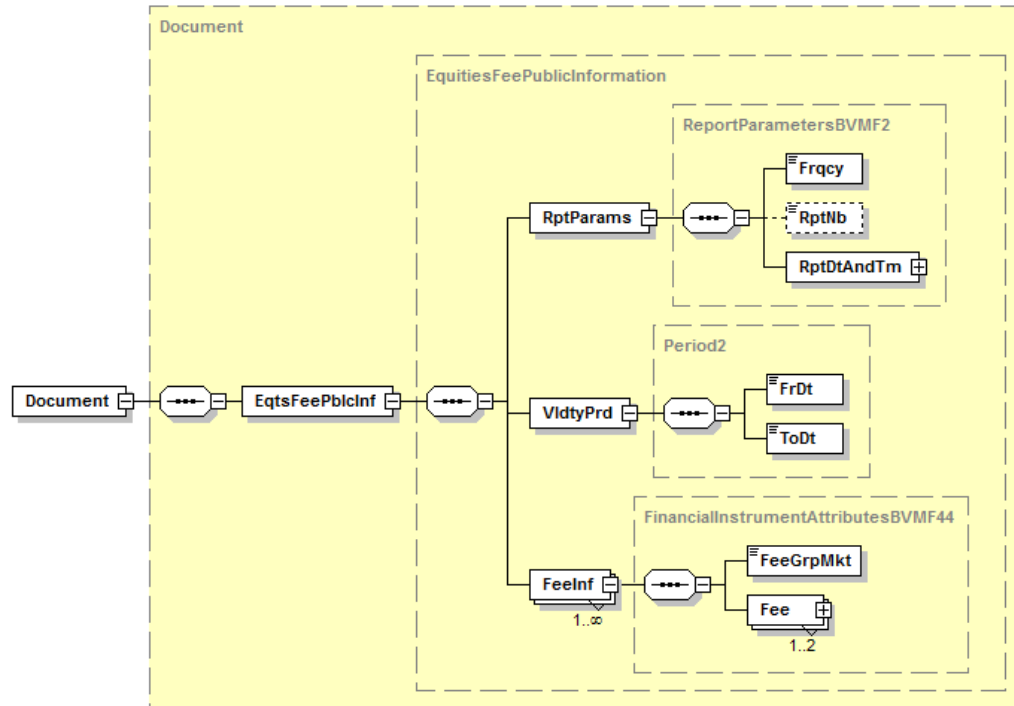
Este arquivo é gerado mensalmente.

Uso

Este arquivo permite aos Participantes conhecer as taxas que serão aplicadas por mercado para o período.

Diagrama da Mensagem

O arquivo BVBG.072.01 é composto pela mensagem “EquitiesFeePublicInformation” (bvmf.181.01)



Generated by XmlSpy

www.altova.com

Regras

R1 - Obrigatorio se o Tipo de Operação é igual a daytrade.

bvmf.181.01 – EquitiesFeePublicInformation

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the fee report.	Parâmetros relacionados ao relatório de tarifas.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency 1Code	Frequency of the report. MNTH - Event takes place every month or once a month. DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand WEEK - Event takes place once a week.	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: MNTH – O evento ocorre a cada mês ou uma vez por mês. DAIL - Evento que ocorre todo dia. ONDE - Evento que ocorre sobre demanda. WEEK - Evento que ocorre uma vez por semana.	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5Numeric Text	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		ValidityPeriod	VldtyPrd	[1..1]	+	Beginning period for which the parameters are valid.	Início do período para o qual os parâmetros são válidos.	
2.1		FromDate	FrDt	[1..1]	ISODate	Date at which the range starts.	Data inicio	
2.2		ToDate	ToDt	[1..1]	ISODate	Date at which the range ends.	Data Fim	
3.0		FeeInformation	FeeInf	[1..*]	+	Provides Fee Instrument Information.	Informações das taxas do instrumento.	
3.1		FeeGroupMarket	FeeGrpMkt	[1..1]	ExternalFeeGro upMarketCode	Represents the market grouping for fee purposes. This field requires an external code list. Those codes and values have been	Representa o agrupamento de mercados que recebem os mesmos valores de tarifação.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalFeeGroupMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalFeeGroupMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
3.2		Fee	Fee	[1..2]	+	Provides Fee Instrument Information.	Informações das taxas do instrumento.	
3.2.1		DayTradeIndicator	DayTradInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a day trade transaction or no.	Indica se é uma operação de Day Trade ou não.	
3.2.2		TierAndCost	TierAndCost	[1..*]	+	Provides Tier and Cost Information.	Informações das faixas e custos.	
3.2.2.1		TierInitialValue	TierInItVal	[0..1]	RestrictedBVMF5ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	It references the initial range of financial volume of contracts.	Volume financeiro dos contratos que inicia a faixa na tabela de contratos.	R1
3.2.2.2		TierFinalValue	TierFnVal	[0..1]	RestrictedBVMF5ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	It references the final range of financial volume of contracts.	Volume financeiro dos contratos que finaliza a faixa na tabela de contratos.	R1
3.2.2.3		FeeType	FeeTp	[1..1]	ExternalBillingTypeCode	Indicates the type of fee. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalBillingTypeCode.	Indica o tipo de tarifação. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram disponibilizados em planilhas externas para permitir uma manutenção flexível em consonância com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista externa é ExternalBillingTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
3.2.2.4		CostInformation	CostInf	[1..*]	+	Cost information.	Informações sobre os custos da tarifação.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
3.2.2.4.1		FeeCostValue	FeeCostVal	[1..1]	RestrictedBVMF5ActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Fee Cost Value.	Aliquota cobrada para taxa.	
3.2.2.4.2		ClientCategoryDetails	ClntCtgyDtls	[0..*]	+	Client category details.	Detalhes da categoria do cliente	
3.2.2.4.2.1		ClientCategory	ClntCtgy	[1..1]	ExternalClientCategoryTypeCode	Provides client category. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalClientCategoryTypeCode.	Informa a categoria do cliente. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram disponibilizados em planilhas externas para permitir uma manutenção flexível em consonância com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista externa é ExternalClientCategoryTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

bvmf.092.01 – FeeUnitCostReport

Regras

R1 - Obrigatório apenas para clientes que apresentaram volume no mês anterior.

R2 – O tipo de consolidação é obrigatório caso o valor do indicador de HFT (HghFrqcyTradrlnd) seja “true”.

R3 - Obrigatório se mercadoria é DOL ou DR1 e mercado é 2.

R4 - Obrigatório para as operações de SCC e SCS.

R5 - Atributo de preenchimento obrigatório para os produtos de opções de dólar, opções de mini de dólar e volatilidade de dólar.

Estrutura

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the calculated fee report.	Prâmetros relacionados ao relatório de tarifas calculadas.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency1Code	Frequency of the report. MNTH - Event takes place every month or once a month. DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand WEEK - Event takes place once a week.	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: MNTH – O evento ocorre a cada mês ou uma vez por mês. DAIL - Evento que ocorre todo dia. ONDE - Evento que ocorre sobre demanda. WEEK - Evento que ocorre uma vez por semana.	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		PartyIdentification	Ptyld	[0..1]	+	Provides Identification Party Identification	Informações do Participante	
2.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		InitialApplicationDate	InitlAppIDt	[0..1]	+	Provides Initial Application Date	Informação da data inicial do período de aplicação.	
3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
4.0		FinalApplicationDate	FnlApplDt	[0..1]	+	Provides Final Application date	Informação da data final do período de aplicação.	
4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.0		InstrumentInformation	InstrmInf	[0..*]	+	Provides Instrument Information	Informações do instrumento.	
5.1		InvestorInformation	InvstrInf	[0..1]	+	Provides Investor information	Informações do investidor.	
5.1.1		HighFrequencyTraderIndicator	HghFrqcyTradrInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the trader is a HFT or no.	Informações de tipo de agrupamento da mensagem.	
5.1.2		ConsolidationType	CnsltnTp	[0..1]	ExternalConsolidationTypeCode	Provides consolidation type information.	Informações de tipo da consolidação.	R2
5.1.3		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	R1
5.1.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.1.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.1.4		DocumentInformation	DocInf	[1..1]	+	Provides Document Information	Este bloco possui as informações sobre os documentos do investidor.	
5.1.4.1		ExtendedIdentificationType	XtndedIdTp	[1..1]	Extended350Code	Specifies the nature of the identification. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Especifica a natureza da identificação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
5.1.4.2		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Name or number assigned by an entity to enable recognition of that entity, eg, account identifier.	Nome ou número atribuído por uma entidade para permitir o conhecimento, por exemplo, identificador de conta.	
5.2		FeeInstrumentInformation	FeeInstrmInf	[1..*]	+	Provides Fee Instrument Information	Informações das Taxas do Instrumento	
5.2.1		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
5.2.1.1		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Equity - Cash2 - Equity derivative3 - Corporate bonds4 - Agribusiness5 - Financial6 - Metal7 - Energy8 - Gov. Bonds9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Ações - Vista2 - Ações - Derivativos3 - Renda fixa privada4 - Agronegócio5 - Financeiro6 - Metais7 - Energia elétrica8 - Títulos públicos9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.</p>	
5.2.1.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	<p>Represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none">1 - Spot2 - Future3 - Options on Spot4 - Options on Future	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>exemplo</p> <ul style="list-style-type: none">1 - MERCADO DISPONIVEL2 - MERCADO FUTURO	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.2.1.3		Asset	Asst	[0..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
5.2.1.4		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de expiração de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
5.2.2		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	This block provides trade information.	Este bloco possui informações das operações e taxas.	
5.2.2.1		DayTradeIndicator	DayTradInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a day trade transaction or no.	Indica se é uma operação de Day Trade ou não.	
5.2.2.2		DMAIndicator	DMAInd	[0..1]	YesNoIndicator	It indicates whether is a DMA transaction or no.	Indicação se a negociação é DMA.	
5.2.2.3		TradeTransactionType	TradTxTp	[0..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Trade type code . This field requires an externalcodelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalTradeTransactionTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. E.g 0 Regular Trade 29 Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	Código do tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls Ex: 0 Regular Trade 29 (Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	
5.2.2.4		StrategyLegCode	StrtgyLegCd	[0..1]	ExternalStrategyLegCode	Indicates the number of strategy legs 0 - outright 1- 0,01 to 1,99 leg 2 - 2 to 2,99 legs 3 - 3 to 3,99 legs 4 - 4 to 4,99 legs 5 - 5 to 5,99 legs 6 - over 6 legs This field requires an external code list. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in	Indica a quantidade de pernas da estratégia 0 - outright 1 - 0,01 a 1,99 pernas 2 - 2 a 2,99 pernas 3 - 3 a 3,99 pernas 4 - 4 a 4,99 pernas 5 - 5 a 5,99 pernas 6 - acima de 6 pernas Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir	R5



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 20/06/2022

Tarifação

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
						accordance with the requirements of the B3 updates. In this case the external is ExternalStrategyLegCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalStrategyLegCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
5.2.3		ExchangeFeeUnitCost	XchgFeeUnitCost	[1..1]	+	Provides Exchange Fee Unit Cost Information	Informações de Custo unitário do Emolumento	
5.2.3.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.4		RegistrationFeeUnitCost	RegnFeeUnitCost	[1..1]	+	Provides Registration Fee Unit Cost	Informações de custo unitário da taxa de registro.	
5.2.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.5		RolloverInitialDate	RlvrlnitDt	[0..1]	+	Provides Rollover Initial Date	Informações da data inicial de rolagem	R3
5.2.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2.6		RolloverFinalDate	RlvrfnlDt	[0..1]	+	Provides Rollover Final Date	Informações da Data Final de Rolagem.	R3
5.2.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2.7		RolloverExchangeFeeUnitCost	RlvrxchgFeeUnitCost	[0..1]	+	Provides Rollover Exchange Fee Unit Cost	Informações do custo unitário de emolumento durante o período de rolagem.	R3
5.2.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.8		RolloverRegistrationFeeUnitCost	RlvrrgnFeeUnitCost	[0..1]	+	Provides Rollover Registration Fee Unit Cost	Informações do custo unitário de taxa de registro durante o período de rolagem.	R3
5.2.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
5.2.9		BacenAuctionDetails	BacenAuctionDtls	[0..1]	+	Contain information about BACEN Auction trades (dollar swap trades).	Detalha informações sobre leilões de swap cambial realizados pelo BACEN.	
5.2.9.1		BacenAuctionIndicator	BacenAuctionInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether an operation to swap auction of BACEN.	Indica se é uma operação de leilão de swap do BACEN	R4