



Adequação do Layout do Arquivo do IMBARQ001 - Negociação Eletrônica, Conta Intermediação, Empréstimo de Títulos Públicos e Compromissada Específica

Data: 15/06/2020

Adequação do Layout do Arquivo IMBARQ001 devido aos Projetos Negociação Eletrônica, Conta Intermediação, Empréstimo de Títulos Públicos e Compromissada Específica



Histórico de alterações

Data de atualização	Versão	Informações
10/05/2019	1.0	<p>Registro 04:</p> <ul style="list-style-type: none">Inclusão dos campos "Vencimento do Título" e "Código Identificador do Título na Selic";Alteração do campo "Reserva" de X(592) para X(576); <p>Registro 06:</p> <ul style="list-style-type: none">Inclusão dos campos "Quantidade de posição com cobertura a ser efetuada com ativo à vista", "Tipo do contrato original", "Código da intermediação", "Indicador da Origem do Contrato por negociação eletrônica", "Indicador de oferta certificada doadora", "Vencimento do Título", "Código Identificador do Título na Selic", "Percentual do índice de correção", "Código Instrumento do índice de correção", "Código Origem Identificação Instrumento do índice de correção", "Código Bolsa Valor do índice de correção" e "Preço do Título Público Atualizado";Alteração do campo "Reserva" de X(238) para X(87); <p>Registro 14:</p> <ul style="list-style-type: none">Inclusão dos campos "Quantidade Renovada", "Tipo de atualização de contrato", "Indicador da Origem do Contrato por negociação eletrônica" e "Tipo do contrato original", "Código Identificador do Título na Selic", "Vencimento do Título", "Percentual do índice de correção", "Código Instrumento do índice de correção", "Código Origem Identificação Instrumento do índice de correção", "Código Bolsa Valor do índice de correção";Alteração do campo "Reserva" de X(91) para X(08); <p>Registro 15:</p> <ul style="list-style-type: none">Inclusão dos campos "Tipo de atualização de contrato", "Indicador da Origem do Contrato por negociação eletrônica", "Tipo do contrato original", "Vencimento do Título", "Código Identificador do Título na Selic", "Percentual do índice de correção", "Código Instrumento do índice de correção", "Código Origem Identificação Instrumento do índice de correção" e "Código Bolsa Valor do índice de correção";Alteração do campo "Reserva" de X(191) para X(127); <p>Registro 16:</p> <ul style="list-style-type: none">Inclusão dos campos "Conta Selic", "Vencimento do Título" e "Código Identificador do Título na Selic";Alteração do campo "Reserva" de X(578) para X(553); <p>Registro 17:</p> <ul style="list-style-type: none">Inclusão dos campos "Conta Selic", "Vencimento do Título" e "Código Identificador do Título na Selic";Alteração do campo "Reserva" de X(654) para X(589); <p>Registro 20:</p> <ul style="list-style-type: none">Inclusão dos campos Tipo Liquidação (bruto ou líquido)", "Prazo de Liquidação", "Indicador da Origem do Contrato por negociação eletrônica", "Indicador Certificada", "Indicador de permissão de liquidação antecipada pelo tomador", "Mercado", "Indexador de correção", Percentual do índice de correção";Alteração do campo "Reserva" de X(609) para X(605); <p>Registro 32</p> <ul style="list-style-type: none">Criação do registro 32 de gestão de ativos. <p>ExternalCodeList</p> <ul style="list-style-type: none">Criação do ExternalCodeList SettlementTime e CorrectionTypeCode



		<ul style="list-style-type: none">Alteração do ExternalCodeList PartialSubscriptionOption, ContractType e MarketType.
02/08/2019	1.1	Registro 33 <ul style="list-style-type: none">Criação do registro 33 de posição de compromissada de títulos públicos. Registro 20 <ul style="list-style-type: none">Inclusão do campo "Volume negociado". Registro 10 <ul style="list-style-type: none">Inclusão dos campos "Sinal-Ponta passiva" e "Valor dos juros – Ponta passiva".
01/06/2020	1.2	Registro 14 <ul style="list-style-type: none">Correção de digitação na posição inicial do campo "Reserva". Registro 17 <ul style="list-style-type: none">Correção de digitação na posição inicial e final dos campos "Conta Selic", "Vencimento do Título", "Código Identificador do Título na Selic" e "Reserva".
15/06/2020	1.3	Registro 32 <ul style="list-style-type: none">Correção de digitação na posição final do campo "Quantidade Total" e posição inicial do campo "Reserva"



Sumário

Histórico de alterações.....	2
Sobre o documento.....	5
Proposta do Arquivo do iMercado	5
Tabela resumo das informações a serem alteradas nos registros do IMBARQ001	6
<i>Layout</i> dos registros do arquivo do IMBARQ a serem alterados	7
Controle de Posição	7
Registro 04 - Posição de recompra	7
Registro 06 - Posições de aluguel de ativos	8
Registro 33 – Posições de compromissada de títulos públicos federais.....	10
Liquidação de Contratos	13
Registro 14 - Informação das liquidações e renovações de contratos termo e aluguel de ativos	13
Registro 15 – Liquidações antecipadas de contratos de termo e aluguel de ativos.....	15
Liquidação de Ativos	18
Registro 16 - Detalhes dos resultados líquidos liquidados no dia.....	18
Registro 17 - Detalhes dos resultados líquidos a serem liquidados.....	19
Aluguel de Ativos.....	20
Registro 20 – Ofertas do <i>book</i>	20
Gestão de Ativos	22
Registro 32 – Saldo de ativos	22

Sobre o documento

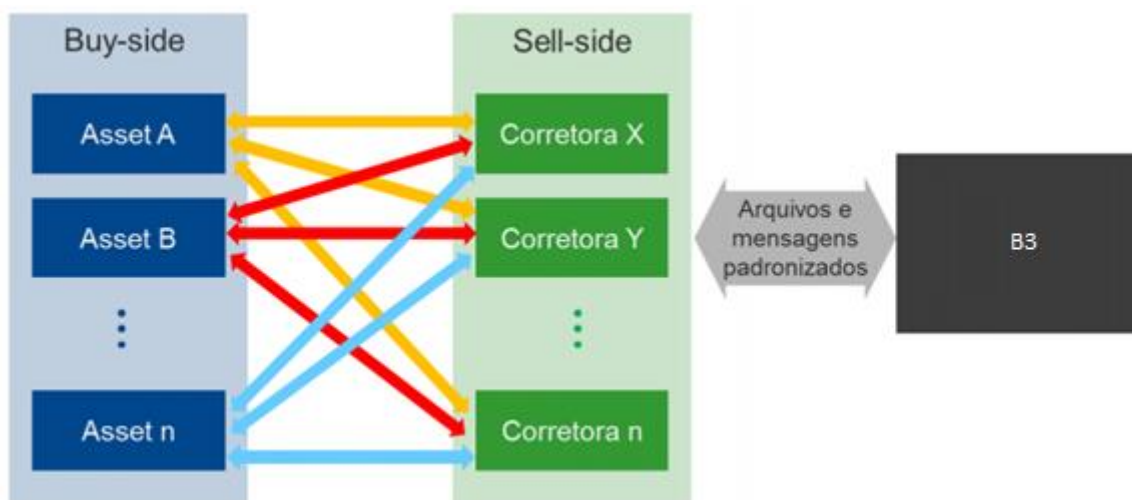
Este documento tem a proposta de informar ao mercado as adequações que o layout do arquivo IMBARQ001 deve ter em razão da implementação dos Projetos Negociação Eletrônica de Empréstimos de Ativos, Conta Intermediação e Empréstimos de Títulos Públicos.

Proposta do Arquivo do iMercado

Para padronizar a troca de informações entre os participantes do mercado, será disponibilizado através do iMercado um arquivo que contém informações da *Clearing* BM&FBovespa.

Nota-se que participantes *Buy-Side* recebem informações de diferentes segmentos de diversas maneiras e formatos. A proposta do arquivo é unificar as informações dos participantes do iMercado e disponibilizar diretamente os dados da Câmara, como se pode observar no fluxo abaixo:

Modelo atual:



Modelo Novo proposto pelo iMercado Módulo arquivos:



Tabela resumo das informações a serem alteradas nos registros do IMBARQ001

Bloco de Informação	Registros	Tipo de Informação	Conteúdo
Controle de Posições	04	Recompra	Contêm dados dos mercados: ações (10), fracionário (20), ouro (1) e renda fixa (5).
	06	Empréstimos de Ativos	Contêm dados do mercado: empréstimo de ativos (91).
	33	Compromissada de Títulos Públicos Federais	Contêm dados de posição de compromissada de títulos públicos federais.
Balcão	10	Swap	Contém dados do mercado: Swaps negociados em ambiente de Balcão organizado (81)
Liquidação de Contratos	14	Liquidações do dia e renovações de contratos de empréstimos de ativos	Contêm dados dos contratos de derivativos não fungíveis e de empréstimo de ativos que serão liquidados no dia e dados de contratos de empréstimos de ativos que foram renovados na data do pregão de referência
	15	Liquidações antecipadas	Contêm dados das liquidações antecipadas dos contratos de derivativos não fungíveis e de empréstimo de ativos
Liquidação de Ativos	16	Resultados líquidos liquidados	Contêm dados dos resultados das liquidações em ativos
	17	Resultados líquidos a serem liquidados	Contêm dados dos resultados líquidos em ativos a serem liquidados
Empréstimo de Ativos	20	Ofertas	Contêm dados das ofertas de empréstimo de ativos certificadas em aberto (disponíveis/estoque)
Gestão de Ativos	32	Gestão de Ativos	Contêm dados de títulos públicos do modulo gestão de ativos.



Layout dos registros do arquivo do IMBARQ a serem alterados

Controle de Posição

Registro 04 - Posição de recompra

Posição de Recompra	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "04"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado		X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado		X(15)	48	62
Código Custodiante		X(15)	63	77
Código do Investidor no Custodiante		X(15)	78	92
ISIN		X(12)	93	104
Distribuição		N(05)	105	109
Número da Recompra		X(35)	110	144
Data de negociação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	145	154
Data de Encerramento da Posição de Recompra	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	155	164
Natureza da Operação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: Side	X(01)	165	165
Código da Carteira		X(35)	166	200
Quantidade Original		N(13)V06	201	219
Quantidade Cancelada		N(13)V06	220	238
Quantidade Executada		N(13)V06	239	257
Quantidade Revertida		N(13)V06	258	276
Valor Original		N(18)V02	277	296
Valor Cancelado		N(18)V02	297	316
Valor Executado		N(18)V02	317	336
Valor Revertido		N(18)V02	337	356
Preço Médio Entrega Original		N(19)V07	357	382
Preço da Reversão		N(19)V07	383	408
Vencimento do Título	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	409	418
Código Identificador do Título na Selic		X(06)	419	424
Reserva	Preenchido com brancos	X(576)	425	1000

**Registro 06 - Posições de aluguel de ativos**

Posições de aluguel de ativos	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "06"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado	Este campo informará o Participante Carryng	X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado	Este campo informará o Investidor no Participante Carryng	X(15)	48	62
Data de Movimento	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	63	72
Código Instrumento	Security ID	X(35)	73	107
Código Origem Identificação Instrumento	Security Source	X(35)	108	142
Código Bolsa Valor	Security Exchange	X(04)	143	146
Origem		X(12)	147	158
Número do Contrato		X(35)	159	193
Número Contrato Anterior		X(35)	194	228
Natureza/Lado Doador/Vendedor	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: Side	N(01)	229	229
Código Instrumento do ativo objeto	Security ID do ativo objeto	X(35)	230	264
Código Origem Identificação Instrumento do ativo objeto	Security Source do ativo objeto	X(35)	265	299
Código Bolsa Valor do ativo objeto	Exchange ID do ativo objeto	X(04)	300	303
ISIN do Ativo Objeto		X(12)	304	315
Distribuição do ativo-objeto		N(10)	316	325
Mercado	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: MarketType	N(03)	326	328
Código de Negociação		X(35)	329	363
Data de negociação	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	364	373
Data de Vencimento	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	374	383
Data de Carência	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	384	393
Código da carteira		X(35)	394	428
Preço referência do ativo objeto		N(19)V07	429	454
Fator		N(10)	455	464
Quantidade Original		N(15)	465	479
Quantidade em Liquidação		N(15)	480	494
Quantidade total de títulos liquidados		N(19)V07	495	520
Quantidade Coberta		N(15)	521	535
Quantidade Descoberta		N(15)	536	550
Quantidade Renovada		N(19)V07	551	576
Quantidade Atual		N(15)	577	591
Volume		N(18)V02	592	611
Tipo Liquidação (bruto ou líquido)	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: SettlementType	N(01)	612	612
Indicador Liquidação Antecipada	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_	N(01)	613	613



Posições de aluguel de ativos	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
	MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator			
Indicador de Liquidação Antecipada em caso de OPA	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	N(01)	614	614
Taxa doadora ou tomadora dependendo da posição		N(19)V07	615	640
Participante Executor		X(10)	641	650
Investidor do Participante Executor		X(15)	651	665
Contraparte tributada ref. Juros sobre o capital próprio	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	N(01)	666	666
Contraparte tributada ref. Rendimento	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	N(01)	667	667
Tipo de contrato	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: ContractType	N(01)	668	668
Número da Instrução de Liquidação		X(64)	669	732
Código do Custodiante		X(15)	733	747
Código do Investidor no Custodiante		X(15)	748	762
Quantidade de posição com cobertura a ser efetuada com ativo à vista		N(19)V07	763	788
Tipo do contrato original	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: ContractType	X(01)	789	789
Código da intermediação		X(35)	790	824
Indicador da Origem do Contrato por negociação eletrônica	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	825	825
Indicador de oferta certificada doadora	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	826	826
Vencimento do Título	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	827	836
Código Identificador do Título na Selic		X(06)	837	842
Percentual do índice de correção		N(12)V04	843	858
Código Instrumento do índice de correção	Security ID do índice de correção	X(20)	859	878
Código Origem Identificação Instrumento do índice de correção	Security Source do índice de correção	X(04)	879	882
Código Bolsa Valor do índice de correção	Exchange ID do índice de correção	X(04)	883	886
Preço do Título Público Atualizado		N(19)V07	887	913
Reserva	Preenchido com brancos	X(87)	914	1000

**Registro 33 – Posições de compromissada de títulos públicos federais**

Posições de compromissada de títulos públicos federais	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "33"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado	Este campo informará o Participante Carryng	X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado	Este campo informará o Investidor no Participante Carryng	X(15)	48	62
Data de Movimento	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	63	72
Código Instrumento	Security ID	X(35)	73	107
Código Origem Identificação Instrumento	Security Source	X(35)	108	142
Código Bolsa Valor	Security Exchange	X(04)	143	146
Origem		X(12)	147	158
Número do Contrato		X(35)	159	193
Natureza/Lado Doador/Vendedor	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: Side	N(01)	194	194
Código Instrumento do ativo objeto	Security ID do ativo objeto	X(35)	195	229
Código Origem Identificação Instrumento do ativo objeto	Security Source do ativo objeto	X(35)	230	264
Código Bolsa Valor do ativo objeto	Exchange ID do ativo objeto	X(04)	265	268
ISIN do Ativo Objeto		X(12)	269	280
Mercado	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: MarketType	N(03)	281	283
Código de Negociação do ativo objeto		X(35)	284	318
Data de negociação	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	319	328
Data de Vencimento	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	329	338
Data de Carência	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	339	348
Código da carteira		X(35)	349	383
Preço referência do ativo objeto		N(19)V07	384	409
Fator da taxa de juros		N(01)V16	410	426



Quantidade Original		N(15)	427	441
Quantidade em Liquidação		N(15)	442	456
Quantidade total de títulos liquidados		N(19)V07	457	482
Quantidade Coberta		N(15)	483	497
Quantidade Descoberta		N(15)	498	512
Quantidade Renovada		N(19)V07	513	538
Quantidade Atual		N(15)	539	553
Volume Original		N(18)V02	554	573
Volume renovado		N(18)V02	574	593
Volume liquidado		N(18)V02	594	613
Volume atual		N(18)V02	614	633
Indicador Liquidação Antecipada	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	N(01)	634	634
Indicador de Liquidação Antecipada pelo comprador	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	N(01)	635	635
Taxa		N(19)V07	636	661
Participante Executor		X(10)	662	671
Tipo de contrato	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ContractType	N(01)	672	672
Número da Instrução de Liquidação		X(64)	673	736
Código do Custodiante		X(15)	737	751
Código do Investidor no Custodiante		X(15)	752	766
Tipo do contrato original	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ContractType	X(01)	767	767
Vencimento do Título	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	768	777
Código Identificador do Título na Selic		X(06)	778	783
Percentual do índice de correção		N(12)V04	784	799
Código Instrumento do índice de correção	Security ID do índice de correção	X(20)	800	819
Código Origem Identificação Instrumento do índice de correção	Security Source do índice de correção	X(04)	820	823



Adequação do Layout do Arquivo do IMBARQ001 - Negociação Eletrônica, Conta Intermediação, Empréstimo de Títulos Públicos e Compromissada Específica

Data: 15/06/2020

Código Bolsa Valor do índice de correção	Exchange ID do índice de correção	X(04)	824	827
Preço do Título Público Atualizado		N(19)V08	828	854
Reserva	Preenchido com brancos	X(146)	855	1000



Liquidação de Contratos

Registro 14 - Informação das liquidações e renovações de contratos termo e aluguel de ativos

Liquidações e renovações de contratos termo e aluguel de ativos	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "14"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado	Este campo informará o Participante Carryng	X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado	Este campo informará o Investidor no Participante Carryng	X(15)	48	62
Data de negociação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	63	72
Número do negócio		N(32)	73	104
Quantidade original		N(19)V06	105	129
Número do Contrato		X(35)	130	164
Natureza da posição	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: Side	X(01)	165	165
Código Instrumento	Security ID	X(35)	166	200
Código Origem Identificação Instrumento	Security Source	X(35)	201	235
Código Bolsa Valor	Security Exchange	X(04)	236	239
Código de negociação		X(35)	240	274
Mercado	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: MarketType	N(10)	275	284
Mercadoria		X(30)	285	314
ISIN		X(12)	315	326
Distribuição		N(10)	327	336
Código Instrumento do ativo objeto	Security ID do ativo objeto	X(35)	337	371
Código Origem Identificação Instrumento do ativo objeto	Security Source do ativo objeto	X(35)	372	406
Código Bolsa Valor do ativo objeto	Security Exchange do ativo objeto	X(04)	407	410
Código de negociação do ativo objeto		X(35)	411	445
ISIN do ativo objeto		X(12)	446	457
Distribuição do ativo objeto		N(10)	458	467
Data de vencimento	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	468	477
Fator de cotação		N(10)	478	487
Carteira		X(35)	488	522



Request ID		X(35)	523	557
Tipo de liquidação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ForwardSettlementType	N(01)	558	558
Quantidade liquidada antecipadamente (*)		N(15)	559	573
Quantidade Vencida		N(19)	574	592
Data da liquidação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	593	602
Data da requisição da liquidação antecipada	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	603	612
Status		N(06)	613	618
Valor da liquidação		N(19)V07	619	644
Preço do termo		N(19)V07	645	670
Código de vencimento		X(04)	671	674
Tipo de termo	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ForwardType	X(01)	675	675
Tipo de contrato	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ContractType	X(01)	676	676
Ultimo dia possível para liquidação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	677	686
Taxa		N(19)V07	687	712
Participante Executor		X(15)	713	727
Investidor do Participante Executor		X(15)	728	742
Indicador de anônimo	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	743	743
Dias uteis entre abertura do contrato e liquidação		N(06)	744	749
Valor pago pelo/para o investidor		N(19)V07	750	775
Preço de referência do ativo objeto		N(19)V07	776	801
Taxa doador		N(19)V07	802	827
Imposto sobre o valor bruto		N(19)V07	828	853
Valor bruto do doador		N(19)V07	854	879
Código do Custodiante		X(15)	880	894
Código do Investidor no Custodiante		X(15)	895	909
Quantidade Renovada		N(19)	910	928
Tipo de atualização de contrato	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ContractUpdateType	X(02)	929	930



Indicador da Origem do Contrato por negociação eletrônica	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicador	X(01)	931	931
Tipo do contrato original	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ContractType	X(01)	932	932
Código Identificador do Título na Selic		X(06)	933	938
Vencimento do Título	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	939	948
Percentual do índice de correção		N(12)V04	949	964
Código Instrumento do índice de correção	Security ID do índice de correção	X(20)	965	984
Código Origem Identificação Instrumento do índice de correção	Security Source do índice de correção	X(04)	985	988
Código Bolsa Valor do índice de correção	Exchange ID do índice de correção	X(04)	989	992
Reserva	Preenchido com brancos	X(08)	993	1000

Registro 15 - Liquidações antecipadas de contratos de termo e aluguel de ativos

Liquidações antecipadas de contratos termo e aluguel de ativos	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "15"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado	Este campo informará o Participante Carryng	X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado	Este campo informará o Investidor no Participante Carryng	X(15)	48	62
Data da negociação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	63	72
Número do negócio		N(32)	73	104
Quantidade original		N(19)V06	105	129
Número do contrato		X(35)	130	164
Natureza da posição	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: Side	X(01)	165	165
Código Instrumento	Security ID	X(35)	166	200
Código Origem Identificação Instrumento	Security Source	X(35)	201	235
Código Bolsa Valor	Security Exchange	X(04)	236	239
Código de negociação		X(35)	240	274



Mercado	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: MarketType	N(10)	275	284
Mercadoria		X(30)	285	314
ISIN		X(12)	315	326
Distribuição		N(10)	327	336
Código Instrumento do ativo objeto	Security ID do ativo objeto	X(35)	337	371
Código Origem Identificação Instrumento do ativo objeto	Security Source do ativo objeto	X(35)	372	406
Código Bolsa Valor do ativo objeto	Security Exchange do ativo objeto	X(04)	407	410
Código de negociação do ativo objeto		X(35)	411	445
ISIN do ativo objeto		X(12)	446	457
Distribuição do ativo objeto		N(10)	458	467
Data de vencimento	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	468	477
Fator de cotação		N(10)	478	487
Carteira		X(35)	488	522
Request ID		X(35)	523	557
Tipo de liquidação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ForwardSettlementType	X(01)	558	558
Quantidade liquidada antecipadamente		N(15)	559	573
Quantidade disponível		N(19)	574	592
Dia da liquidação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	593	602
Data da requisição da liquidação antecipada	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	603	612
Valor de liquidação antecipada		N(19)V07	613	638
Preço do termo		N(19)V07	639	664
Código de vencimento		X(04)	665	668
Tipo de termo	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ForwardType	X(01)	669	669
Indicador de cancelado final de dia	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	670	670
Tipo de contrato	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ContractType	X(01)	671	671
Ultimo dia possível para liquidação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	672	681
Taxa		N(19)V07	682	707



Participante Executor		X(15)	708	722
Investidor do Participante Executor		X(15)	723	737
Preço de referência do ativo objeto		N(19)V07	738	763
Código do Participante Contraparte	Esta informação não será enviada para empréstimos de ativos	X(15)	764	778
Status do contrato de termos (ações e ouro)	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ForwardStatusCode	X(01)	779	779
Código do Custodiante		X(15)	780	794
Código do Investidor no Custodiante		X(15)	795	809
Tipo de atualização de contrato	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ContractUpdateType	X(02)	810	811
Indicador da Origem do Contrato por negociação eletrônica	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	812	812
Tipo do contrato original	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: ContractType	X(01)	813	813
Vencimento do Título	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	814	823
Código Identificador do Título na Selic		X(06)	824	829
Percentual do índice de correção		N(12)V04	830	845
Código Instrumento do índice de correção	Security ID do índice de correção	X(20)	846	865
Código Origem Identificação Instrumento do índice de correção	Security Source do índice de correção	X(04)	866	869
Código Bolsa Valor do índice de correção	Exchange ID do índice de correção	X(04)	870	873
Reserva	Preenchido com brancos	X(127)	874	1000



Liquidação de Ativos

Registro 16 - Detalhes dos resultados líquidos liquidados no dia

Resultados líquidos liquidados no dia	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "16"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado		X(09)	33	41
Código do Investidor Solicitado		X(15)	42	56
Data do Pregão	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	57	66
Data de Liquidação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	67	76
Tipo Liquidação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: SettlementType	X(10)	77	86
Número de Instrução de Liquidação		X(64)	87	150
Número de Instrução Liquidação Original		X(64)	151	214
Carteira		N(10)	215	224
ISIN		X(12)	225	236
Distribuição do ISIN		N(10)	237	246
Natureza da Operação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: LaunchType	X(01)	247	247
Quantidade Total da Instrução de Liquidação		N(13)V06	248	266
Preço Médio de Referência		N(23)V07	267	296
Volume Total da Instrução de Liquidação		N(23)V07	297	326
Quantidade Liquidada		N(15)V04	327	345
Quantidade Não Liquidada		N(15)V04	346	364
Quantidade para ser liquidada		N(15)V04	365	383
Quantidade Restringível		N(15)V04	384	402
Quantidade da falha		N(15)V04	403	421
Tipo de Resultado Líquido	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: NettingType	X(01)	422	422
Conta Selic		X(09)	423	431
Vencimento do Título	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	432	441
Código Identificador do Título na Selic		X(06)	442	447
Reserva	Preenchido com brancos	X(553)	448	1000

**Registro 17 - Detalhes dos resultados líquidos a serem liquidados**

Resultados líquidos a serem liquidados	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "17"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado		X(09)	33	41
Código do Investidor Solicitado		X(15)	42	56
Data do Pregão	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	57	66
Data de Liquidação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	67	76
Data Movimento	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	77	86
Número de Instrução de Liquidação		X(64)	87	150
Número de Instrução Liquidação Original		X(64)	151	214
Carteira		N(10)	215	224
ISIN		X(12)	225	236
Distribuição do ISIN		N(10)	237	246
Natureza da Operação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: LaunchType	X(01)	247	247
Quantidade Total da Instrução de Liquidação		N(13)V06	248	266
Preço Médio de Referência		N(23)V07	267	296
Volume Total da Instrução de Liquidação		N(23)V07	297	326
Quantidade Aceita		N(15)V04	327	345
Tipo de Resultado Líquido	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: NettingType	X(01)	346	346
Conta Selic		X(09)	347	355
Vencimento do Título	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	356	365
Código Identificador do Título na Selic		X(06)	366	371
Reserva	PREENCHIDO COM BRANCOS	X(629)	372	1000



Aluguel de Ativos

Registro 20 - Ofertas do book

Ofertas de aluguel de ativos	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "20"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado		X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado		X(15)	48	62
Número Oferta		N(19)	63	81
Situação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: SecLendingOfferStatus	N(02)	82	83
Tipo de Oferta	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: Side	N(02)	84	85
Data de Criação da Oferta	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	86	95
Participante Doador		X(07)	96	102
Investidor no Participante Doador		X(15)	103	117
Custodiante Doador		X(07)	118	124
Investidor Custodiante Doador		X(15)	125	139
Participante Tomador Executor		X(07)	140	146
Investidor do Participante Tomador Executor		X(15)	147	161
Custodiante Tomador		X(07)	162	168
Investidor Custodiante Tomador		X(15)	169	183
Participante Carrying		X(7)	184	190
Investidor do Participante Carrying		X(15)	191	205
Código Instrumento do ativo objeto	Security Id do ativo objeto	X(35)	206	240
Código Origem Identificação Instrumento do ativo objeto	Security Id Source do ativo objeto	X(35)	241	275
Código Bolsa Valor do ativo objeto	Security Exchange do ativo objeto	X(04)	276	279
ISIN do ativo objeto		X(12)	280	291
Distribuição do ativo objeto		N(04)	292	295
Código de Negociação do ativo objeto		X(12)	296	307
Quantidade original		N(19)	308	326
Quantidade disponível		N(19)	327	345
Carteira Doador ou Tomador		N(05)	346	350
Taxa		N(06)V05	351	361
Data de Carência	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	362	371
Data de Vencimento	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	372	381
Indicador Reversível ao Doador	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_	X(01)	382	382



	MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator			
Indicador Reversível ao Doador em caso de OPA	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	383	383
Indicador Contrato Diferenciado	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	384	384
Participante para Fechar		X(07)	385	391
Tipo Liquidação (bruto ou líquido)	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: SettlementType	X(01)	392	392
Prazo de Liquidação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: SettlementTime	X(01)	393	393
Indicador Buy Side	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	394	394
Indicador Certificada	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	395	395
Indicador de permissão de liquidação antecipada pelo tomador	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	396	396
Mercado	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: MarketType	N(03)	397	399
Indexador de correção	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: IndexTypeCode	N(02)	400	401
Percentual do índice de correção		N(12)V04	402	417
Tipo de Correção	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: CorrectionTypeCode	X(01)	418	418
Volume negociado		N(19)V07	419	444
Reserva	Preenchido com brancos	X(556)	445	1000



Gestão de Ativos

Registro 32 - Saldo de ativos

Ofertas de aluguel de ativos	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "32"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado		X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado		X(15)	48	62
Data de referência	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	63	72
Carteira		X(35)	73	107
Conta Selic		X(15)	108	122
Código de Negociação		X(35)	123	157
ISIN		X(12)	158	169
Código Identificador do Título na Selic		X(06)	170	175
Vencimento do Título	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	176	185
Quantidade total		N(15)V06	186	206
Reserva	Preenchido com brancos	X(794)	207	1000