

iMercado – IMBG.003

Relatório de Definições de Mensagens e Arquivos

Este documento descreve um conjunto de definições de mensagens desenvolvidas pela BM&FBOVESPA, a serem utilizadas no processo de Negociações em caso de exercício de opções

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição	Responsável
09/09/2016	1.0	Versão Inicial	
21/09/2016	1.0	Exclusão do arquivo IMBG.001.01 e criação do arquivo IMBG.003.01 para trafegar a mensagem imb.520.01.	

Versão de Schema

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

Nome Mensagem	Versão Schema XSD
imb.520.01	1.0

Conteúdo

Histórico de Revisão	2
Versão de Schema	3
Visão geral	5
<i>Escopo</i>	5
<i>Lista de Mensagens</i>	5
<i>Conteúdo do Arquivo</i>	6
<i>Como Ler</i>	7
Fluxos de Mensagens	8
<i>Informa Posições de Opções em Aberto</i>	8
Introdução	8
Cenário 1: Participante de Negociação Pleno recebe dados de posições de opções em aberto	8
IMBG.003.01 – OpenOptionPositionReport	9
Funcionalidade da mensagem	9
Escopo	9
Diagrama da mensagem	9
Regras	11
Estrutura da Mensagem – OpenOptionPositionReport (imb.520.01)	11

Visão geral

Escopo

Este documento descreve o conjunto de definição da mensagem desenvolvida pela BM&FBOVESPA que será utilizada no fluxo de exercício de opção via informações do iMercado.

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 normatizadas.

Lista de Mensagens

1. **OpenOptionPositionReport <IMBG.003.01>**

O arquivo **OpenOptionPositionReport** é enviado pela BM&FBOVESPA aos Participantes de Negociação Plenos (PNP) para informar as posições de opções em aberto de determinados Participantes de Negociação Plenos (PNP) ou Participantes de Liquidação (PL) mediante solicitações e aprovações nas telas do iMercado.

Conteúdo do Arquivo

Sigla do Arquivo	Nome do Arquivo	Conteúdo do Arquivo
IMBG.003.01	OpenOptionPositionReport	imb.520.01 - OpenOptionPositionReport

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

Informa Posições de Opções em Aberto

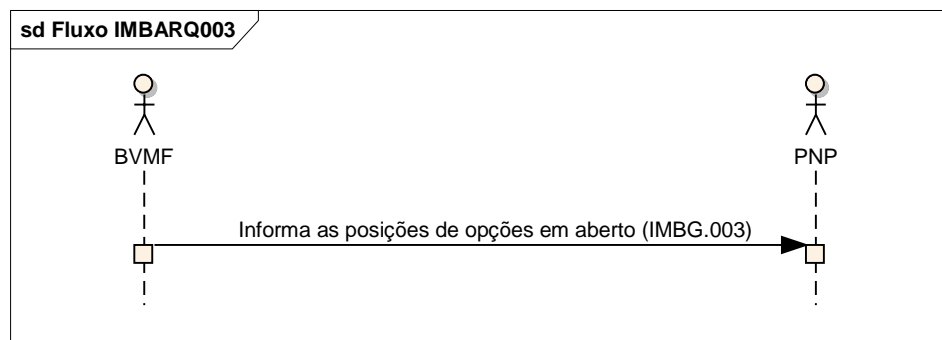
Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem OpenOptionPositionReport no típico cenário de informar aos Participantes de Negociação Plenos as posições de opções em aberto de investidores no qual o Participantes de Negociação Planos que possuem vínculos de contas.

Cenário 1: Participante de Negociação Pleno recebe dados de posições de opções em aberto

Este cenário é básico e o mais elementar para informar ao Participante de Negociação Pleno as posições de opções em abertos de clientes com vinculo de exercício de posições em Participantes de Liquidação ou Participantes de Negociação Pleno.

- A BMF&BOVESPA envia o arquivo OpenOptionPositionReport <IMBG.003.01> aos Participantes de Negociação Plenos, informando posições de opções em aberto de contas que possuem vínculo de exercício de opções. O arquivo IMBG.003 contem a mensagem OpenOptionPositionReport <imb.520.01>.





Definição – Catálogo de Mensagens e Arquivos

Data: 09/09/2016

iMercado - IMBARQ003

IMBG.003.01 – OpenOptionPositionReport

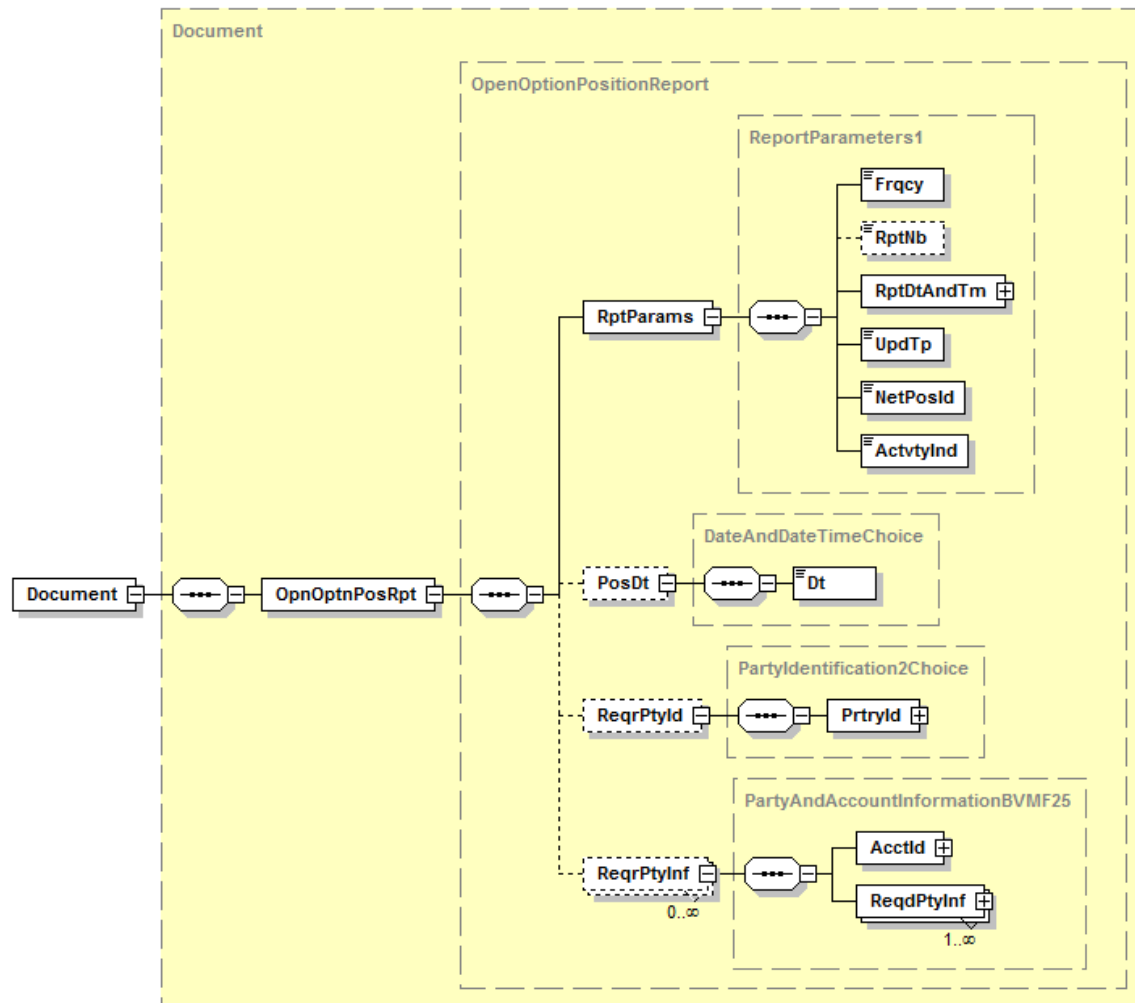
Funcionalidade da mensagem

O arquivo OpenOptionPositionReport é enviada pela BM&FBOVESPA aos Participantes de Negociação Plenos (PNP) para informar a posição de opções em aberto de investidores com vinculo de exercício de opções nos Participantes de Negociação Plenos (PNP) ou Participante de Liquidação (PL).

O arquivo IMBG.003 contem a mensagem OpenOptionPositionReport <imb.520.01>.

Escopo

Diagrama da mensagem



Generated by XmlSpy

www.altova.com

Regras

N/A.

Estrutura da Mensagem – OpenOptionPositionReport (imb.520.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
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		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1 Code	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".	
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		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".	
2.0		PositionDate	PosDt	[0..1]	+	Position Date.	Data da posição	
2.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
3.0		RequesterPartyIdentification	ReqrPtyId	[0..1]	+	Provides Requester Participant Identification.	Identificação do Participante Solicitante.	
3.1		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.	
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		RequesterPartyInformation	ReqrPtyInf	[0..*]	+	Provides Requester Participant Information.	Informação do Participante Solicitante.	
4.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornecer dados da 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.	
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		RequestedPartyInformation	ReqdPtyInf	[1..*]	+	This block in Requested participant Information.	Bloco com informações por participante da posição do solicitante.	
4.2.1		RequestedPartyIdentification	ReqdPtyId	[1..1]	+	Provides Requested Participant Identification.	Identificação do Participante Solicitado.	
4.2.1.1		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.	
4.2.1.1.1		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).	



4.2.1.1.2		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.	
4.2.1.1.3		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.	
4.2.2		RequestedAccountInformation	ReqdAcctInf	[1..*]	+	This block in Requested Account Information.	Bloco com informações por conta da posição do solicitante.	
4.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados da identificação da conta.	
4.2.2.1.1		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.	
4.2.2.1.1.1		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	
4.2.2.2		PositionInformation	PosInf	[1..*]	+	This block information Position.	Bloco com informação da posição.	

4.2.2.2.1	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 - 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>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 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>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>
4.2.2.2.2	Side	Sd	[1..1]	Side3Code	<p>Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL.</p>	<p>Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL</p>
4.2.2.2.3	Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	<p>Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.</p>	<p>Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.</p>
4.2.2.2.4	OptionType	OptnTp	[1..1]	+	<p>Specifies whether it is a Call option (right to purchase a specific underlying asset) or a Put option (right to sell a specific underlying asset).</p>	<p>Este bloco identifica se o estilo da opção é opção de compra (direito de comprar um ativo específico subjacente) ou opção de venda (direito de vender um ativo específico subjacente).</p>

4.2.2.2.4.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	Este bloco identifica o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente da opção) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente da opção). Valores válidos: CALL e PUTT.	
4.2.2.2.5		PositionDetails	PosDtls	[1..*]	+	This block details the Position.	Bloco com os detalhes da posição.	
4.2.2.2.5.1		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the Ticker Symbol.	Este bloco contém informações do código de negociação.	
4.2.2.2.5.1.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
4.2.2.2.5.2		ExpirationDate	XprtnDt	[1..1]	ISODate	Provides Settlement Date (Expired date)	Data de Vencimento.	
4.2.2.2.5.3		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 vencimento 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	
4.2.2.2.5.4		ExercisePrice	ExrcPric	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Predetermined price at which the holder of a derivative will buy or sell the underlying instrument.	Preço pré-determinado que determinará a compra ou venda de um papel pelo detentor de um derivativo.	
4.2.2.2.5.5		PositionQuantity	PosQty	[1..1]	DecimalNumber	Position Quantity.	Quantidade da posição.	



Definição – Catálogo de Mensagens e Arquivos

iMercado - IMBARQ003

Data: 09/09/2016

4.2.2.2.5.6	OpenOptionPositionSub Type	OpnOptnPosSu bTp	[1..1]	ExternalOpenOptionPosi tionSubTypeCode	Open Option Position SubType Code.	Código subtipos de posições de opções em aberto.	
-------------	-------------------------------	---------------------	--------	---	---------------------------------------	---	--