

Formador de Mercado

Relatório de Definições de Mensagens e Arquivos

Este documento descreve um conjunto de definições de mensagens desenvolvidas pela BM&FBOVESPA, a serem utilizadas pelos formadores de mercado da BM&FBOVESPA.

A implantação da integração das clearings da BM&FBOVESPA e do novo sistema de risco CORE (Closeout Risk Evaluation) depende de prévia autorização dos órgãos reguladores.

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição	Responsável
17/09/2015	1.0	Versão Inicial	
21/12/2015	1.1	Ajuste no texto descritivo e no fluxo das mensagens bvmf.177.01 e bvmf.178.01 para contemplar as categorias de participante dos formadores de mercado.	

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
bvmf.177.01	1.0
bvmf.178.01	1.0

Descrição detalhada no documento "Manual Técnico".

Conteúdo

Histórico de Revisão	2
Versão de Schema	3
Visão geral	6
<i>Escopo</i>	6
<i>Lista de Mensagens</i>	6
<i>Como Ler</i>	7
Fluxo de Mensagens e Arquivos	8
<i>Formadores de mercado</i>	8
Introdução	8
Cenário 1: Formador de mercado solicita informações relacionadas aos descontos nas taxas de determinados instrumentos	8
Cenário 2: Formador de mercado solicita informações relacionadas aos descontos nas taxas de determinados instrumentos	9
bvmf.177.01 – MarketMakerFeeRequest	10
<i>Funcionalidade da Mensagem</i>	10
Escopo	10
Diagrama da Mensagem	11
Regras	11
<i>Estrutura da Mensagem “MarketMakerFeeRequest” (bvmf.177.01)</i>	12
bvmf.178.01– MarketMakerFeeResponse	14
<i>Funcionalidade da Mensagem</i>	14



Definição – Catálogo de Mensagens e Arquivos

Data: 21/12/2015

Formador de Mercado

Escopo	14
Diagrama da Mensagem.....	15
Regras.....	15
<i>Estrutura da Mensagem “MarketMakerFeeResponse” (bvmf.178.01).</i>	16

Visão geral

Escopo

Este documento descreve o conjunto de definições de mensagens desenvolvidas pela BM&FBOVESPA que serão utilizadas nos fluxos de informações de descontos para formadores de mercado.

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

1. MarketMakerFeeRequest <bvmf.177.01>

A mensagem MarketMakerFeeRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação dos formadores de mercado à BM&FBOVESPA com o objetivo de solicitar informações de descontos em taxas específicas para um determinado instrumento.

2. MarketMakerFeeResponse <bvmf.178.01>

A mensagem MarketMakerFeeResponse é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação dos formadores de mercado e contempla os descontos em taxas específicas para um determinado instrumento. Esses descontos são aplicados durante um período cadastrado no sistema.

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.

Fluxo de Mensagens e Arquivos

Formadores de mercado

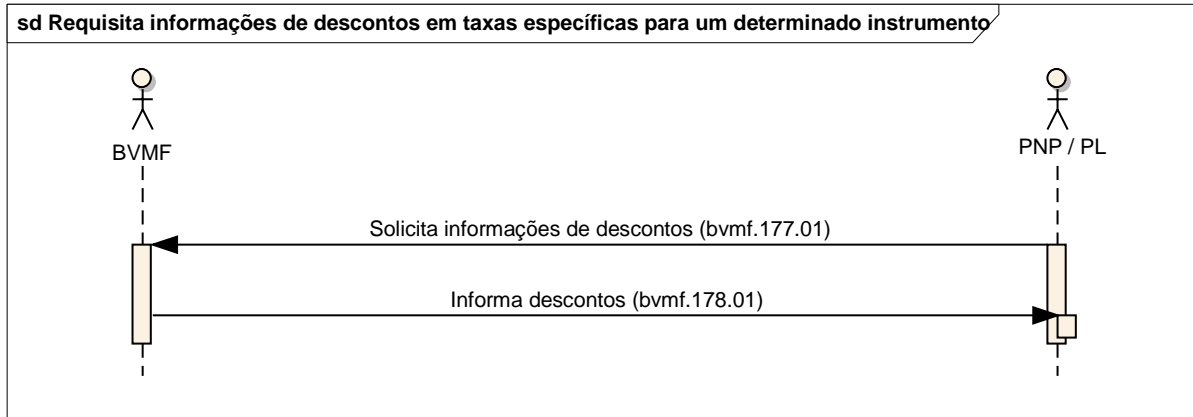
Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem e do arquivo para formador de mercado.

Cenário 1: Formador de mercado solicita informações relacionadas aos descontos nas taxas de determinados instrumentos

Este cenário é básico e o mais elementar para informar descontos nas taxas de determinados instrumentos.

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação dos formadores de mercado enviam a mensagem MarketMakerFeeRequest <bvmf.177.01> para a BM&FBOVESPA requisitando as informações de descontos em taxas específicas para um determinado instrumento;
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem MarketMakerFeeResponse <bvmf.178.01> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação dos formadores de mercado informando os descontos em taxas específicas para um determinado instrumento.



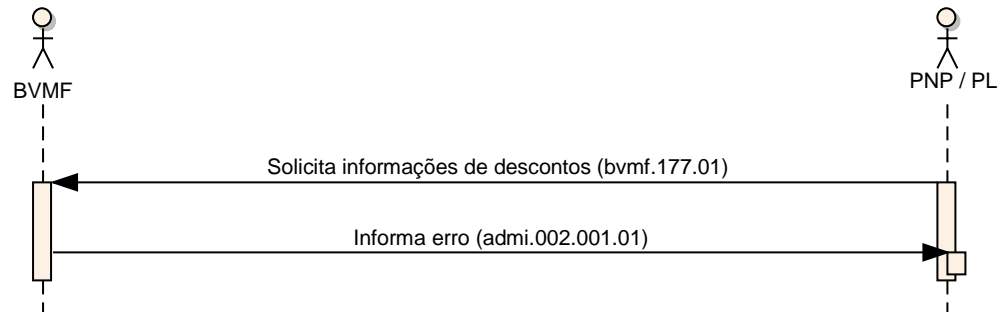
Cenário 2: Formador de mercado solicita informações relacionadas aos descontos nas taxas de determinados instrumentos

Cenário de Erro

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação dos formadores de mercado enviam a mensagem MarketMakerFeeRequest <bvmf.177.01> à BM&FBOVESPA requisitando as informações de descontos em taxas específicas para um determinado instrumento com alguma não conformidade.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem admi.002.001.01 com a descrição do erro.

sd Requisita informações de descontos em taxas específicas para um determinado instrumento - Cenário Erro



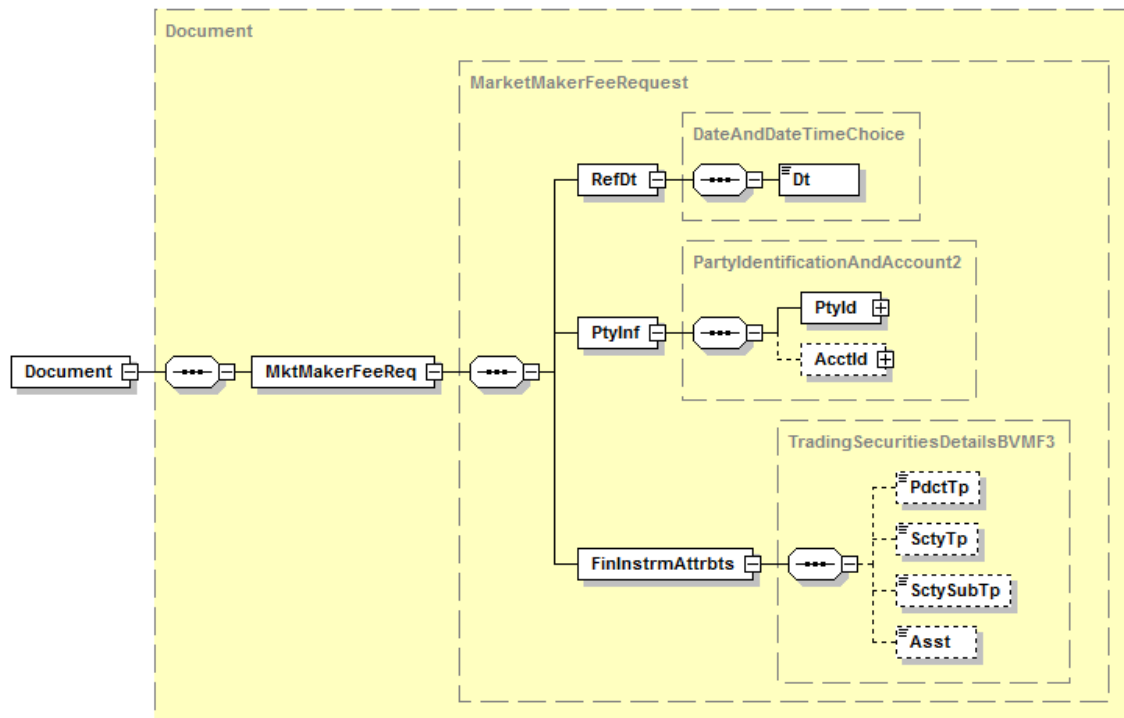
bvmf.177.01 – MarketMakerFeeRequest

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem “MarketMakerFeeRequest” <bvmf.177.01> é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação dos formadores de mercado à BM&FBOVESPA com o objetivo de solicitar as informações de descontos em taxas específicas para um determinado instrumento.

Diagrama da Mensagem



Generated by XmlSpy

www.altova.com

Regras

R1 - Caso não seja informada uma conta específica, serão consideradas todas as contas do participante com dados para a consulta realizada.

R2 - Caso nenhum campo específico seja informado, serão considerados todos os campos deste bloco com dados válidos para a consulta realizada.

Estrutura da Mensagem “MarketMakerFeeRequest” (bvmf.177.01).

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReferenceDate	RefDt	[1..1]	+	Reference date for the selection of valid data of market maker.	Data de referência para seleção dos dados válidos de formação de mercado.	
1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	This block contains information about the party identification and account identification as request parameter.	Este bloco contém informações sobre a identificação do participante e da conta como parâmetro da solicitação.	
2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
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.	
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).	
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.	

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.	
2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.	R1
2.2.1		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.	
2.2.1.1		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	
3.0		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument in the trade process.	Elementos que caracterizam um instrumento no processo de negociação.	R2
3.1		ProductType	PdctTp	[0..1]	ExternalProduct TypeCode	A Product represents the first level of security market classification in the trade process. 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 ExternalProductTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Produto representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de negociação. 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 ExternalProductTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

3.2		SecurityType	SctyTp	[0..1]	ExternalSecurityTypeCode	<p>A Security Type represents the Second level of security market classification in the trade process.</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 ExternalSecurityTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de negociação.</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 ExternalSecurityTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	
3.3		SecuritySubType	SctySubTp	[0..1]	ExternalSecuritySubTypeCode	<p>A Security Sub Type represents the third level of security market classification in the trade process.</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 ExternalSecuritySubTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	<p>Representa o terceiro nível da classificação de mercado no processo de negociação.</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 ExternalSecuritySubTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls</p>	
3.4		Asset	Asst	[0..1]	Max30Text	<p>Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, etc.</p>	<p>Ativo associado ao papel., tal como DOL BGI OZ1, WDL, CNI, etc.</p>	

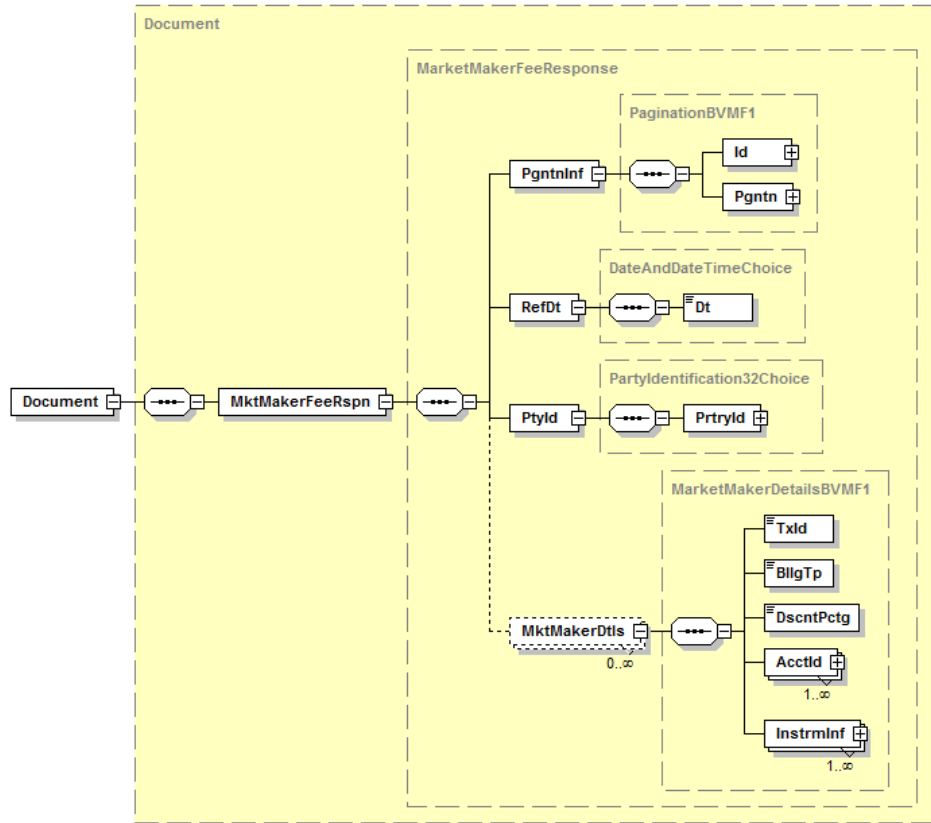
bvmf.178.01- MarketMakerFeeResponse

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem “MarketMakerFeeResponse” <bvmf.178.01> é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação dos formadores de mercado para informar os descontos em taxas específicas para um determinado instrumento.

Diagrama da Mensagem



Generated by XmlSpy

www.altova.com

Regras

Não há

Estrutura da Mensagem “MarketMakerFeeResponse” (bvmf.178.01).

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PaginationInformation	PgntnInf	[1..1]	+	Provides pagination information.	Fornecer informação sobre a paginação.	
1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique identification for the group partitioned messages.	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.1.1		PaginationIdentification	PgntnId	[1..1]	Max35Text	Unique identification for the group partitioned messages	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.2		Pagination	Pgntn	[1..1]	+	Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	Número da página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuação, informando se é a última página ou se existem mais.	
1.2.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	Page number.	Número da página.	
1.2.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	
2.0		ReferenceDate	RefDt	[1..1]	+	Provides the date of the benefit granted.	Fornecer a data do benefício concedido.	
2.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
3.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornecer detalhes da identificação do participante.	
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.	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	

						The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	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		MarketMakerDetails	MktMakerDtIs	[0..*]	+	This block provides details on the benefits granted to the market maker.	Este bloco fornece os detalhes sobre os benefícios concedidos ao formador de mercado.	
4.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação.	
4.2		BillingType	BllgTp	[1..1]	ExternalBillingTypeCode	Defines the type of discount that will be applied.	Define o tipo de desconto que será aplicado.	
4.3		DiscountPercentage	DscntPctg	[1..1]	RestrictBVMFPercentageRate	Percentage of discount that will be applied.	Percentual de desconto que será aplicado.	
4.4		AccountIdentification	AcctId	[1..*]	+	Provides the account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.	
4.4.1		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.	
4.4.1.1		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	
4.5		InstrumentInformation	InstrmInf	[1..*]	+	This block contains information about instrument.	Este bloco contém informações sobre o instrumento.	
4.5.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornecer detalhes da identificação do instrumento.	

4.5.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.
4.5.1.1.1		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).
4.5.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.
4.5.1.1.2.1		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).
4.5.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.
4.5.1.2.1		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)
4.5.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the Ticker Symbol.	Este bloco contém informações do código de negociação.
4.5.2.1		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