



Layout do Arquivo do IMBARQ002

Data: 18/07/2015

Serviço iMercado Layout do Arquivo Intradiário do iMercado: IMBARQ002 - Liquidação de Ativos

Histórico de alterações

Data de atualização	Versão	Informações
23/12/2015	1.0	Divulgação dos atributos do Arquivo do IMBARQ002 (<i>intraday</i>) que substituirá dados de liquidação de ativos de relatórios COLD.
18/07/2016	1.1	Alteração do conteúdo dos campos abaixo relacionados: <ul style="list-style-type: none">• Tipo Liquidação• Natureza da Operação• Tipo de restrição• Situação do resultado• Delivery Restricted on Position Account level• Delivery Restricted on TP/DP level true or false• Delivery Restricted on CM level Alteração dos tamanhos dos campos abaixo relacionados de N(19) para N(13)V06: <ul style="list-style-type: none">• Quantidade Total da Instrução de Liquidação• Quantidade Liquidada• Quantidade Não Liquidada• Quantidade para ser liquidada• Quantidade aceita pelo Custodiante• Quantidade Restringível• Quantidade da falha



Sumário

Histórico de alterações.....	2
Sobre o documento.....	4
Proposta do Arquivo do IMBARQ.....	4
<i>Layout</i> dos registros do arquivo do IMBARQ002 – Liquidação de Ativos.....	6
Header.....	6
Trailer.....	6
Liquidação de Ativos.....	7
Registro 50 – Detalhes das instruções de liquidadas.....	7

Sobre o documento

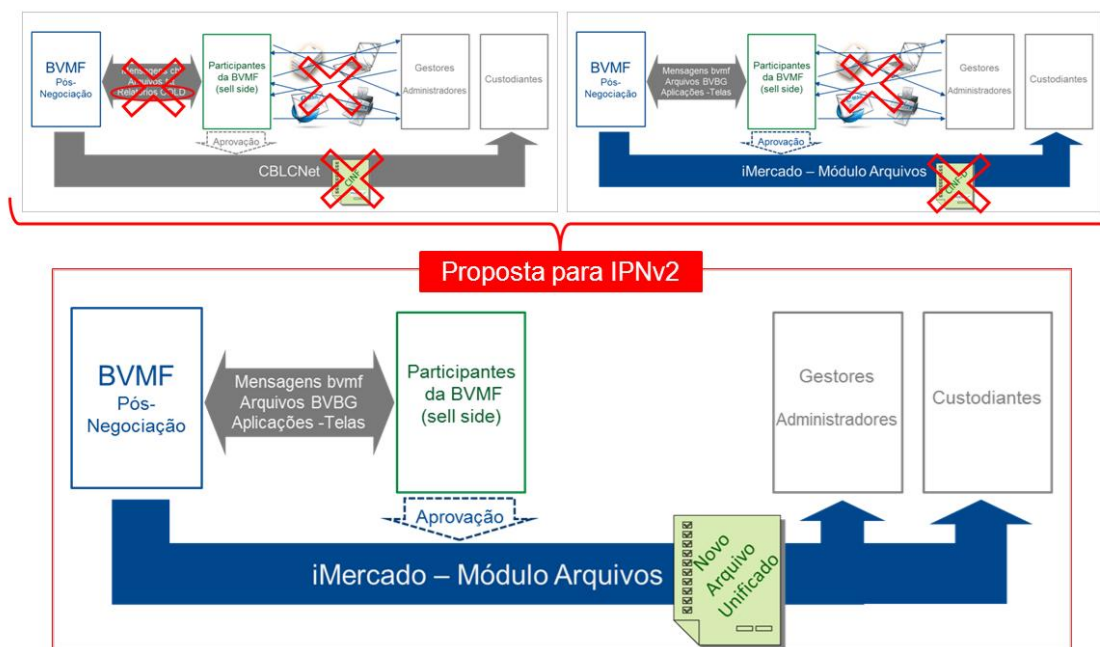
Este documento tem a proposta de (i) apresentar, de uma maneira objetiva, o layout do Arquivo do IMBARQ002 que substituirá informações de relatórios COLD (câmara CBLC) para liquidação de ativos intradiários.

Os participantes que recebem atualmente estas informações da BM&FBOVESPA ou de seus participantes (Corretoras, PNP/PL) poderão receber informações unificadas da Clearing Integrada através deste arquivo – para tanto os participantes interessados deverão ser participantes iMercado

Proposta do Arquivo do IMBARQ002

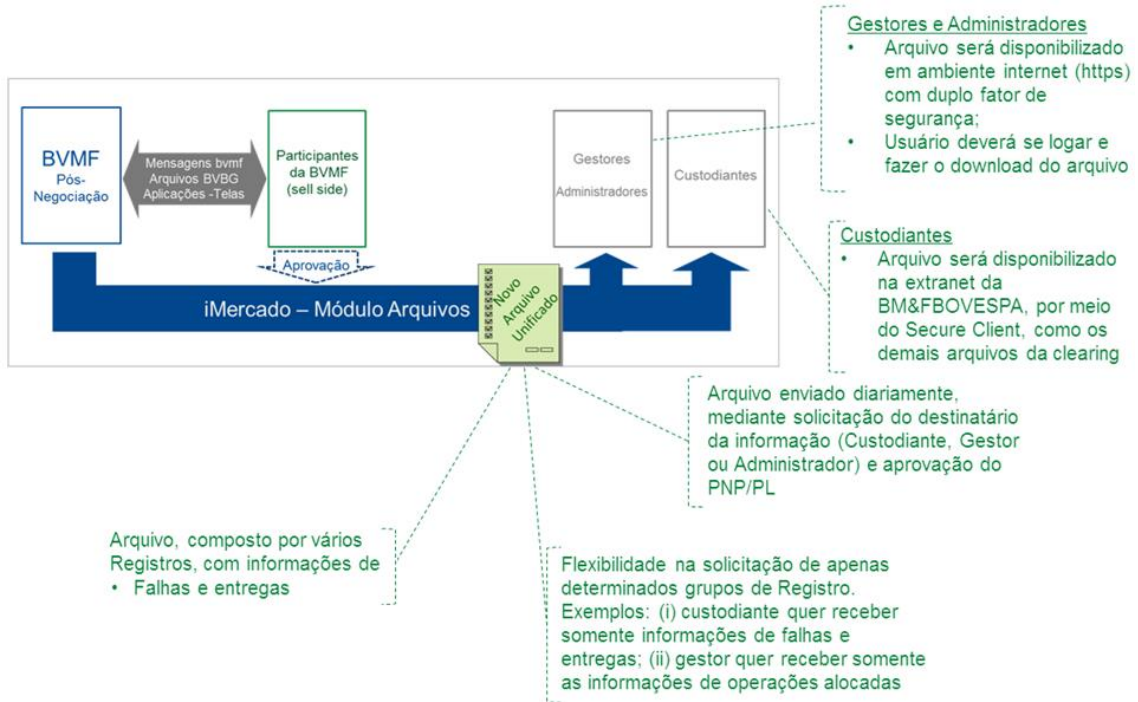
Para padronizar a troca de informações entre os participantes do mercado, será disponibilizado através do iMercado um arquivo que contém informações de liquidação de ativos da *Clearing* BM&FBovespa. Esse arquivo é enviado Automaticamente após o processamento da liquidação

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:



O documento contém detalhes dos seguintes processos:

- Liquidação de ativos.



Layout dos registros do arquivo do IMBARQ002 - Liquidação de Ativos

Abaixo apresentamos os campos por registro:

Header

Descrição do Campo	Conteúdo	Tipo	Tamanho	Posição inicial	Posição final
TIPO DE REGISTRO	FIXO "00"	Numero	2	1	2
NOME DO ARQUIVO	VER REDEFINIÇÃO ABAIXO	Texto	17		
CÓDIGO DO ARQUIVO	FIXO "IMBARQ002"	Texto	9	3	11
CÓDIGO DA CATEGORIA DO USUÁRIO		Numero	3	12	14
CÓDIGO DO USUÁRIO	CÓDIGO DO USUÁRIO NA BVMF	Numero	5	15	19
CÓDIGO DA ORIGEM	FIXO "BVMF"	Texto	8	20	27
CÓDIGO DO DESTINO	CÓDIGO DO USUÁRIO NA BVMF	Numero	15	28	42
NÚMERO DO MOVIMENTO	SEQUENCIAL POR USUÁRIO, ATRIBUÍDO P/ CONTROLE DOS ARQUIVOS GERADOS	Numero	9	43	51
DATA DA GERAÇÃO DO ARQUIVO	FORMATO = "AAAAMMDD"	Numero	8	52	59
DATA DO MOVIMENTO	FORMATO = "AAAAMMDD"	Numero	8	60	67
RESERVA	PREENCHIDO COM BRANCOS	Texto	933	68	1000

Trailer

Descrição do Campo	Conteúdo	Tipo	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
TIPO DE REGISTRO	FIXO "99"	Numero	2	1	2
NOME DO ARQUIVO	VER REDEFINIÇÃO ABAIXO	Texto	17		
CÓDIGO DO ARQUIVO	FIXO "IMBARQ002"	Texto	9	3	11
CÓDIGO DA CATEGORIA DO USUÁRIO		Numero	3	12	14
CÓDIGO DO USUÁRIO	CÓDIGO DO USUÁRIO NA BVMF	Numero	5	15	19
CÓDIGO DA ORIGEM	FIXO "BVMF"	Texto	8	20	27
CÓDIGO DO DESTINO	CÓDIGO DO USUÁRIO NA BVMF	Numero	15	28	42
NÚMERO DO MOVIMENTO		Numero	9	43	51
DATA DA GERAÇÃO DO	FORMATO =	Numero	8	52	59



ARQUIVO	"AAAAMMDD"				
TOTAL DE REGISTROS GERADOS		Numero	9	60	68
DATA DO MOVIMENTO	FORMATO = "AAAAMMDD"	Numero	8	69	70
RESERVA	PREENCHIDO COM BRANCOS	Texto	930	71	1000

Liquidação de Ativos

Registro 50 - Detalhes das instruções de liquidadas

Descrição do Campo	Conteúdo	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "50"	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 do Pregão	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	63	72
Data de Liquidação	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	73	82
Tipo Liquidação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: SettlementType	N(10)	83	92
Número de Instrução de Liquidação		X(64)	93	156
Número de Instrução Liquidação Original		X(64)	157	220
Carteira		N(10)	221	230
ISIN		X(12)	231	242
Distribuição do ISIN		N(10)	243	252
Natureza da Operação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: LaunchType	X(01)	253	253
Preço Médio de Referência		N(23)V07	254	283
Quantidade Total da Instrução de Liquidação		N(13)V06	284	302
Volume Total da Instrução de Liquidação		N(23)V07	303	332
Tipo de restrição	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: RestrictionType	X(02)	333	334
Situação do resultado	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: NetSettlementResultStatus	X(05)	335	339
Quantidade Liquidada		N(13)V06	340	358



Volume financeiro liquidado		N(23)V07	359	388
Quantidade Não Liquidada		N(13)V06	389	407
Volume financeiro não liquidado		N(23)V07	408	437
Quantidade para ser liquidada		N(13)V06	438	456
Volume financeiro para ser liquidado		N(23)V07	457	486
Quantidade aceita pelo Custodiante		N(13)V06	487	505
Quantidade Restringível		N(13)V06	506	524
Delivery Restricted on Position Account level	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	525	525
Delivery Restricted on TP/DP level true or false	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	526	526
Delivery Restricted on CM level	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator	X(01)	527	527
Quantidade da falha		N(13)V06	528	546
Fallback Settlement Account		X(15)	547	561
Informação adicional de ETF	Informa p Lote do ETF	X(05)	562	566
Reservado	PREENCHIDO COM BRANCOS	X(434)	567	1000