

# LAYOUT EM IMPLEMENTAÇÃO

## SWAP SEM CCP – FEV/25

## **CONTEÚDO**

<b>1 ATUALIZAÇÕES</b> .....	<b>3</b>
<b>2 LEGENDAS</b> .....	<b>3</b>
<b>3 ENVIAR ARQUIVOS</b> .....	<b>4</b>
3.1 SWAP – REGISTRO DE CONTRATO PAGAMENTO FINAL .....	4
3.2 SWAP – REGISTRO DE CONTRATO FLUXO CONSTANTE .....	11
3.3 SWAP – REGISTRO DE CONTRATO FLUXO NÃO CONSTANTE...	17
<b>4 RECEBER ARQUIVOS</b> .....	<b>25</b>
4.1 SWAP – DPOSIÇÃO .....	25

## 1 ATUALIZAÇÕES

Atualizado em	Referência	Atualização
12/12/2024	Enviar Arquivos Receber Arquivos	Inclusão do domínio D0 no campo <b>Data Cotação</b> , para as curvas de Dólar EUA e Dólar 30/360 referente aos layouts “Registro Swap Pagamento Final”; “Registro Swap Fluxo Não Constante”; “Registro Swap Fluxo Constante”; e “DPOSICAO”.

## 2 LEGENDAS

Novos domínios

### 3 ENVIAR ARQUIVOS

#### 3.1 SWAP – REGISTRO DE CONTRATO PAGAMENTO FINAL

<b>Módulo: Swap Sem CCP</b>	
<b>Nome do Arquivo: Registro de Contrato com Pagamento Final</b>	<b>Tamanho do Registro: 1923 caracteres</b>
<b>Descrição:</b> Esse layout possibilita registrar um contrato de pagamento final.	

HEADER				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
1	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	SWAP
2	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Linha de Header = 0
3	Código da Operação	9(04)	7 - 10	Código identificador da operação. 0001 e 0301
4	Participante que gerou o arquivo	X(20)	11 - 30	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
5	Data	9(08)	31 - 38	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
6	Controle de versão	9(05)	39 - 43	Versão do Layouts. Conteúdo: 00003

Dados Iniciais				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
1	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	SWAP
2	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Linha de Dados = 1
3	Código operação	9(04)	7 - 10	Código identificador da operação. 0001 e 0301
4	Meu Número	9(10)	11 - 20	Código de controle atribuído pelo participante
5	Parte	9(08)	21 - 28	Código da Instituição lançadora da operação.
6	CPF/CNPJ Cliente Parte	X(14)	29 - 42	CNPJ ou CPF da Parte. Informar quando a Parte for uma conta cliente (10 ou 20)
7	Comissão Parte	9(2)v9(8)	43 - 52	Comissão da Parte
8	Contraparte	9(08)	53 - 60	Código da contraparte na operação.
9	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	X (14)	61 - 74	CNPJ ou CPF da Contraparte. Informar quando a Contraparte for uma conta cliente (10 ou 20)
10	Comissão ContraParte	9(2)v9(8)	75 - 84	Comissão da Contraparte

Características				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
11	Data início	9(08)	85 - 92	Data de início do contrato. Formato: AAAAMMDD.
12	Data vencimento	9(08)	93 - 100	Data de vencimento do contrato. Formato: AAAAMMDD.
13	Adesão a Contrato	9(02)	101 - 102	Tipo de adesão: 0 (SEM ADESAO), 1 (CGD), 2(CSA), 3(CGD/CSA)
14	Valor base	9(14)v9(02)	103 - 118	Valor base do contrato.

15	Funcionalidades	9(02)	119 - 120	Funcionalidade do Contrato: 00 (SEM_FUNCIONALIDADE), 01 (KNOCK_IN), 02 (KNOCK_OUT), 03 (KNOCK_INOUT), 04 (SWAPTION), 05 (COMPOUND), 06 (OPCAO_ARREPEND), 07 (KNOCK_IN_COM_OPCAO), 08 (KNOCK_OUT_COM_OPCAO), 09 (SWAP_COM_PRÊMIO)
16	Agenda de Prêmio	9(02)	121 - 122	Paga prêmio. Possíveis valores: 00 (sim) e 01 (não)
17	Reset	9(02)	123 - 124	Com Reset. Possíveis valores: 00 (sim) e 01 (não)
18	Observação	X(100)	125 - 224	Campo de preenchimento opcional pelo participante.

**Exclusivo para Contrato a Termo**

Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
19	Data operação termo	9(08)	225 - 232	Data da operação quando a mesma for pactuada a termo, com cliente1 e registrada em D+1. Formato: AAAAMMDD.
20	Índice Termo	9(02)	233 - 234	Código do indexador de correção da operação a termo. Possíveis valores: 00 (VCP), 01 (SELIC), 03 (DI), 04 (OURO), 15 (DOLAR), 20 (TR), 23 (TJLP), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 38 (FRANCO SUICO), 53 (EURO-BCE), 78 (FRANCO SUIÇO BCE), 88 (PESO MEXICANO),
21	Percentual Termo	9(03)v9(02)	235 - 239	Percentual a ser aplicado sobre o indexador que o Participante quer que corrija o Valor Base Inicial da operação a termo.

**Se Índice Termo e “VCP” ou “DOLAR”**

Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
22	PU Inicial	9(14)v9(08)	240 - 261	PU Inicial para operação a termo = VCP
23	Tipo/Classe	9(05)	262 - 266	Tipo Classe. Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
24	Descrição	X(320)	267 - 586	Denominação para operação a termo = VCP

**Fluxo de Juros e Amortização**

Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
25	BRANCO	X(42)	587 - 628	BRANCO

**Curva para Atualização**

Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
26	Percentual	9(03)v9(02)	629 - 633	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato da Parte.
27	Curva	X(03)	634 - 636	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
28	TR Escolhida	9(08)	637 - 644	Data TR parte
29	Sinal Taxa	9(02)	645 - 646	"+" ou "-" da Parte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
30	Juros	9(03)v9(04)	647 - 653	Taxa de juros atualizada da Parte.
31	Lim. Inferior (Floor)	9(08)v9(08)	654 - 669	Limite Inferior
32	Lim. Superior (Cap)	9(08)v9(08)	670 - 685	Limite Superior
33	Percentual	9(03)v9(02)	686 - 690	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato da ContraParte.
34	Curva	X(03))	691 - 693	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
35	TR Escolhida	9(08)	694 - 701	Data TR Contraparte
36	Sinal Taxa	9(02)	702 - 703	"+" ou "-" da Contraparte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
37	Juros	9(03)v9(04)	704 - 710	Taxa de juros atualizada da Contraparte.
38	Lim. Inferior (Floor)	9(08)v9(08)	711 - 726	Limite Inferior
39	Lim. Superior (Cap)	9(08)v9(08)	727 - 742	Limite Superior

### Terceira Curva

Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
40	Parte/Contraparte	9(02)	743 - 744	Terceira Curva: 00 (PARTE), 01 (CONTRAPARTE)
41	Cupom Limpo	9(08)v9(07)	745 - 759	Cupom limpo Terceira Curva
42	Percentual	9(03)v9(02)	760 - 764	Percentual Terceira Curva
43	Curva	9(02)	765 - 766	Tipo de Curva da Terceira Curva. Possíveis valores: 03 (DI), 01 (SELIC), 15 (DOLAR), 04 (OURO), 09 (IGP-M), 10 (IGP-DI), 16 (INPC), 20 (TR), 23 (TJLP), 33 (EURO), 35 (IENE) e 65 (DOLAR COM. EXP).
44	Sinal Taxa	9(02)	767 - 768	Sinal da Terceira Curva: 00 ("+") e 01 ("-").
45	Taxa de Juros	9(03)v9(04)	769 - 775	Taxa de Juros Terceira Curva
46	Limitador	9(02)	776 - 777	Tipo do Limitador Terceira Curva: 00 (LIM. INFERIOR) 01 (LIM. SUPERIOR)

### Se curva(s) = "VCP"

Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
47	Pu inicial	9(14)v9(08)	778 - 799	Preço unitário do índice na data de início, no caso de código =00 para Parte.
48	Tipo/Classe	9(05)	800 - 804	Tipo Classe. Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas

				_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
49	Descrição	X(320)	805 - 1124	Denominação para Parte.
50	Pu inicial	9(14)v9(08)	1125 - 1146	Preço unitário do índice na data de início, no caso de código =00 para ContraParte.
51	Tipo/Classe	9(05)	1147 - 1151	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas _Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
52	Descrição	X(320)	1152 - 1471	Denominação para Contraparte.

Cupom Limpo/ Data Cotação				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
53	Cupom Limpo	9(08)v9(07)	1472 - 1486	Cotação Cupom Limpo Curva IPCA, Moeda Parte ou VCP (exceto 73)
54	Data de Cotação	9(02)	1487 - 1488	Possíveis valores: 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
55	Cupom Limpo	9(08)v9(07)	1489 - 1503	Cotação Cupom Limpo Curva IPCA, Moeda ContraParte ou VCP (exceto 73)
56	Data de Cotação	9(02)	1504 - 1505	Possíveis valores: 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).

Exclusivo para curva “Libor”				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
57	BRANCO	9(02)	1506 - 1507	BRANCO
58	BRANCO	9(02)	1508 - 1509	BRANCO
59	Data da Cotação	9(02)	1510 - 1511	Possíveis valores da Parte: 00 (D), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
60	Varição Cambial	9(02)	1512 - 1513	Varição Cambial da Parte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
61	Tipo Classe	9(05)	1514 - 1518	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas _Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
62	Data da Cotação - Varição Cambial - Parte	9(02)	1519 - 1520	Data da Cotação - Varição Cambial da Parte. Possíveis Valores: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
63	Cupom Limpo / Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1521 - 1530	Outros - Cotação da Parte.
64	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1531 - 1538	Alíquota - IR da Parte.
65	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1539 - 1546	Taxa, fator ou valor limite inferior da Parte.
66	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1547 - 1554	Taxa, fator ou limite superior da Parte.
67	BRANCO	9(02)	1555 - 1556	BRANCO
68	BRANCO	9(02)	1557 - 1558	BRANCO
69	Data de Cotação	9(02)	1559 - 1560	Possíveis valores da Contraparte: 00 (D), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
70	Varição Cambial	9(02)	1561 - 1562	Varição Cambial da Contraparte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
71	Tipo Classe	9(05)	1563 - 1567	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas _Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.

72	Data da Cotação - Variação Cambial - Ctparte	9(02)	1568 - 1569	Data da Cotação - Variação Cambial da Contraparte. Possíveis Valores: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
73	Cupom Limpo/Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1570 - 1579	Outros - Cotação da ContraParte.
74	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1580 - 1587	Alíquota - IR da ContraParte.
75	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1588 - 1595	Taxa, fator ou valor limite inferior da ContraParte.
76	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1596 - 1603	Taxa, fator ou limite superior da ContraParte.

<b>Exclusivo para curva “Taxa de Juros Mercado Internacional”</b>				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
77	Taxa Juros	9(03)v9(04)	1604 - 1610	Taxa Juros Parte.
78	BRANCO	9(02)	1611 - 1612	BRANCO
79	Variação Cambial	9(02)	1613 - 1614	Variação Cambial da Parte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
80	Tipo Classe	9(05)	1615 - 1619	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
81	Cupom Limpo/Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1620 - 1629	Outros - Cotação Parte.
82	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1630 - 1637	Alíquota - IR Parte.
83	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1638 - 1645	Limite inferior (FLOOR) - Perc. Parte.
84	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1646 - 1653	Limite superior (CAP) - Perc. Parte.
85	Taxa Juros	9(03)v9(04)	1654 - 1660	Taxa Juros ContraParte.
86	BRANCO	9(02)	1661 - 1662	BRANCO
87	Variação Cambial	9(02)	1663 - 1664	Variação Cambial da Contraparte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
88	Tipo Classe	9(05)	1665 - 1669	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
89	Cupom Limpo/Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1670 - 1679	Outros - Cotação ContraParte.
90	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1680 - 1687	Alíquota - IR ContraParte.
91	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1688 - 1695	Limite inferior (FLOOR) - Perc. ContraParte.
92	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1696 - 1703	Limite superior (CAP) - Perc. ContraParte.
<b>Exclusivo para Commodity</b>				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
93	Cotação Inicial	9(06)v9(04)	1704 - 1713	Cotação Inicial da Parte
94	Código da Commodity	X(15)	1714 - 1728	Código RIC da Mercadoria. Verifique arquivo AAAAMMDD_Mercadorias.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de



				Arquivos. Campo exclusivo para swap de commodity.
95	Média Asiática Verificação	9(02)	1729 - 1730	Média Asiática para Verificação da Parte Domínio: (00) SIMPLES, (01) PONDERADO
96	Data da Cotação da Commodity	9(02)	1731 - 1732	Data de Cotação para Ajuste da Parte Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
97	Cotação Inicial	9(06)v9(04)	1733 - 1742	Cotação Inicial da Contraparte
98	Código da Commodity	X(15)	1743 - 1757	Código RIC da Mercadoria. Verifique arquivo AAAAMMDD_Mercadorias.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos. Campo exclusivo para swap de commodity.
99	Média Asiática Verificação	9(02)	1758 - 1759	Média Asiática para Verificação da Contraparte Domínio: (00) SIMPLES, (01) PONDERADO
100	Data da Cotação da Commodity	9(02)	1760 - 1761	Data de Cotação para Ajuste da Contraparte Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).

Funcionalidade				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
101	Parte/Contraparte	9(02)	1762 - 1763	Ponta do Trigger In: 00 (PARTE), 01 (CONTRAPARTE)
102	Fator/Valor/Taxa	9(08)v9(08)	1764 - 1779	Fator do Trigger In
103	Verificação	9(02)	1780 - 1781	Verificação do Trigger In: 00(DIÁRIO), 01(FINAL)
104	Parte/Contraparte	9(02)	1782 - 1783	Ponta do Trigger Out: 00 (PARTE), 01 (CONTRAPARTE)
105	Fator/Valor/Taxa	9(08)v9(08)	1784 - 1799	Fator do Trigger Out
106	Verificação	9(02)	1800 - 1801	Verificação do Trigger Out: 00 (DIÁRIO), 01 (FINAL)

Titular da Funcionalidade				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
107	Titular	9(02)	1802 - 1803	Titular do Prêmio 1: 00 (PARTE), 01 (CONTRAPARTE)

Prêmio (1) de Funcionalidade				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
108	Valor	9(14)v9(02)	1804 - 1819	Valor do Prêmio 1
109	Rebate	9(14)v9(02)	1820 - 1835	Valor do Rebate
110	Liquidação do Rebate	9(02)	1836 - 1837	Liquidação do Rebate: 00 (VENCIMENTO), 01 (TRIGGER OUT), 02 (APÓS NUMERO DIAS UTEIS)
111	Dias Úteis após o Trigger Out	9(10)	1838 - 1847	Dias úteis para liquidação do rebate após o trigger out

Prêmio (2) de Funcionalidade				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
112	Valor	9(14)v9(02)	1848 - 1863	Valor do prêmio 2
113	Data Exercício	9(08)	1864 - 1871	Data do Prêmio 2

Características				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
114	Código da Estratégia	X(11)	1872 - 1882	Código da Estratégia
115	Amortiza sem Troca de Diferencial	X(1)	1883 - 1883	Exclusivo para contratos VCP. Deve ser informado S caso afirmativo, vazio caso contrário.
116	Código Identificador	X(14)	1884 - 1897	Código de controle interno do participante. Preenchimento não obrigatório.
117	Data de Cotação Final – Termo	9(02)	1898 – 1899	Possíveis valores: 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5). Para Índice Termo referente à moedas.
118	Data de Fixing IPCA (Parte)	9(02)	1900-1901	Indica o <i>fixing</i> que será utilizado na apuração da cotação final de contratos com IPCA da Parte Campo com as opções: 01 = M-1 ; 02 = M-2
119	Data de Fixing IPCA (Contraparte)	9(02)	1902– 1903	Indica o <i>fixing</i> que será utilizado na apuração da cotação final de contratos com IPCA da Contraparte Campo com as opções: 01 = M-1 ; 02 = M-2
120	Sinal Spread (Parte)	9(02)	1904 - 1905	"+" ou "-" da Parte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
121	Spread (Parte)	9(6)v9(4)	1906-1915	Campo de Preenchimento Opcional Exclusivo para Swap de Commodities na Parte
122	Sinal Spread (Contraparte)	9(02)	1916 - 1917	"+" ou "-" da Parte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
123	Spread (Contraparte)	9(6)v9(4)	1918-1927	Campo de Preenchimento Opcional Exclusivo para Swap de Commodities na Contraparte

### 3.2 SWAP – REGISTRO DE CONTRATO FLUXO CONSTANTE

<b>SWAP</b>
Nome do Arquivo
Registro de Contrato de Fluxo Constante
Descrição: Através deste layout, o Participante pode registrar um contrato de fluxo de pagamentos periódicos.

Header				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
1	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	SWAP
2	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Linha de Header = 0
3	Código da Operação	9(04)	7 - 10	Código identificador da operação. 0001 e 0301
4	Participante que gerou o arquivo	X(20)	11 - 30	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
5	Data	9(08)	31 - 38	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

Dados Iniciais				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
1	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	SWAP
2	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Linha de Dados = 1
3	Código operação	9(04)	7 - 10	Código identificador da operação. 0001 e 0301
4	Meu Número	9(10)	11 - 20	Código de controle atribuído pelo participante
5	Parte	9(08)	21 - 28	Código da Instituição lançadora da operação.
6	CPF/CNPJ Cliente Parte	X(14)	29 - 42	CNPJ ou CPF da Parte. Informar quando a Parte for uma conta cliente (10 ou 20)
7	BRANCO	x(10)	43 - 52	BRANCO
8	Contraparte	9(08)	53 - 60	Código da contraparte na operação.
9	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	X (14)	61 - 74	CNPJ ou CPF da Contraparte. Informar quando a Contraparte for uma conta cliente (10 ou 20)
10	BRANCO	x(10)	75 - 84	BRANCO

Características				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
11	Data início	9(08)	85 - 92	Data de início do contrato. Formato: AAAAMMDD.
12	Data vencimento	9(08)	93 - 100	Data de vencimento do contrato. Formato: AAAAMMDD.
13	Adesão a contrato	9(02)	101 - 102	Tipo de adesão: 0 (SEM ADESAO), 1 (CGD), 2(CSA), 3(CGD/CSA)
14	Valor base	9(14)v9(02)	103 - 118	Valor base do contrato.
15	BRANCO	X(02)	119 - 120	BRANCO
16	Agenda de Prêmio	9(02)	121 - 122	Paga prêmio. Possíveis valores: 00(sim) e 01(não)
17	BRANCO	X(02)	123 - 124	BRANCO

18	Observação	X(100)	125 - 224	Campo de preenchimento opcional pelo participante.
----	------------	--------	-----------	--

Exclusivo para contrato a Termo				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
19	Data operação termo	9(08)	225 - 232	Data da operação quando a mesma for pactuada a termo, com cliente <sup>1</sup> e registrada em D+1. Formato: AAAAMMDD.
20	Índice Termo	9(02)	233 - 234	Código do indexador de correção da operação a termo. Possíveis valores: 00 (VCP), 01 (SELIC), 03 (DI), 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 53 (EURO-BCE), 78 (FRANCO SUIÇO BCE).
21	Percentual Termo	9(03)v9(02)	235 - 239	Percentual a ser aplicado sobre o indexador que o Participante quer que corrija o Valor Base Inicial da operação a termo.

Se Índice Termo e “VCP” ou “DOLAR”				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
22	PU Inicial	9(14)v9(08)	240 - 261	PU Inicial para operação a termo = VCP
23	Tipo/Classe	9(05)	262 - 266	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
24	Descrição	X(320)	267 - 586	Denominação para operação a termo = VCP

Fluxo de Juros e Amortização				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
25	Juros a cada	9(10)	587 - 596	Campo de preenchimento obrigatório, quando a “Periodicidade de juros” for “Constante”, caso contrário não deve ser preenchido. Indica a periodicidade de pagamento de juros.
26	Período	9(02)	597 - 598	Possíveis valores: 00 (Dias Úteis), 01 (Dias Corridos), 02 (Meses)
27	Data início pagamento juros	9(08)	599 - 606	Data de início de pagamento de juros. Formato: AAAAMMDD.
28	Amortização a cada	9(10)	607 - 616	Campo de preenchimento obrigatório, quando o tipo de amortização for “períodos uniformes..”, caso contrário não deve ser preenchido. Indica a periodicidade de pagamento das amortizações.
29	Período	9(02)	617 - 618	Possíveis valores: 00 (Dias Úteis), 01 (Dias Corridos), 02 (Meses), 03 (Na Data de Vencimento), 04 (Sem Troca Amortização)
30	Data início pagamento amortização	9(08)	619 - 626	Data de início de pagamento de amortização. Formato: AAAAMMDD.

31	Tipo de amortização	9(02)	627 - 628	Possíveis valores: 00 (Sobre Valor Base Original), 01 (Sobre Valor Base Remanescente)
----	---------------------	-------	-----------	---

(continua)

Curva para Atualização				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
32	Percentual	9(03)v9(02)	629 - 633	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato da Parte.
33	Curva	X(03)	634 - 636	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
34	BRANCO	9(08)	637 - 644	BRANCO
35	Sinal Taxa	9(02)	645 - 646	"+" ou "-" da Parte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
36	Juros	9(03)v9(04)	647 - 653	Taxa de juros atualizada da Parte.
37	Lim. Inferior (Floor)	9(08)v9(08)	654 - 669	Limite Inferior
38	Lim. Superior (Cap)	9(08)v9(08)	670 - 685	Limite Superior
39	Percentual	9(03)v9(02)	686 - 690	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato do ContraParte.
40	Curva	X(03)	691 - 693	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
41	BRANCO	9(08)	694 - 701	BRANCO
42	Sinal Taxa	9(02)	702 - 703	"+" ou "-" da Contraparte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
43	Juros	9(03)v9(04)	704 - 710	Taxa de juros atualizada do Contraparte.
44	Lim. Inferior (Floor)	9(08)v9(08)	711 - 726	Limite Inferior
45	Lim. Superior (Cap)	9(08)v9(08)	727 - 742	Limite Superior

Terceira Curva				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
46	BRANCO	9(35)	743 - 777	BRANCO

Se curva(s) = "VCP"				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
47	Pu inicial	9(14)v9(08)	778 - 799	Preço unitário do índice na data de início, no caso de código =00 para Parte.
48	Tipo/Classe	9(05)	800 - 804	Tipo Classe. Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
49	Denominação	X(320)	805 - 1124	Denominação para Parte.

50	Pu inicial	9(14)v9(08)	1125 - 1146	Preço unitário do índice na data de início, no caso de código =00 para ContraParte.
51	Tipo/Classe	9(05)	1147 - 1151	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
52	Denominação	X(320)	1152 - 1471	Denominação para Contraparte.

(continua)

Cupom Limpo/Data Cotação				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
53	Cupom Limpo Parte	9(08)v9(07)	1472 - 1486	Cotação Cupom Limpo Curva Moeda ou VCP (exceto 73)
54	Data de Cotação Parte	9(02)	1487 - 1488	Possíveis valores: :00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
55	Cupom Limpo ContraParte	9(08)v9(07)	1489 - 1503	Cotação Cupom Limpo Curva Moeda ou VCP (exceto 73)
56	Data de Cotação ContraParte	9(02)	1504 - 1505	Possíveis valores: :00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).

Exclusivo para curva "Libor"				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
57	BRANCO	9(02)	1506 - 1507	BRANCO
58	BRANCO	9(02)	1508 - 1509	BRANCO
59	Data de Cotação	9(02)	1510 - 1511	Possíveis valores da Parte: 00 (D), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
60	Variação Cambial	9(02)	1512 - 1513	Variação Cambial da Parte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
61	Tipo Classe	9(05)	1514 - 1518	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
62	Data da Cotação - Variação Cambial - Parte	9(02)	1519 - 1520	Data da Cotação - Variação Cambial da Parte. Possíveis Valores: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
63	Cupom Limpo/Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1521 - 1530	Outros - Cotação da Parte.
64	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1531 - 1538	Alíquota - IR da Parte.
65	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1539 - 1546	Taxa, fator ou valor limite inferior da Parte.
66	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1547 - 1554	Taxa, fator ou limite superior da Parte.
67	BRANCO	9(02)	1555 - 1556	BRANCO
68	BRANCO	9(02)	1557 - 1558	BRANCO

69	Data de Cotação	9(02)	1559 - 1560	Possíveis valores da Contraparte: 00 (D), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
70	Variação Cambial	9(02)	1561 - 1562	Variação Cambial da Contraparte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
71	Tipo Classe	9(05)	1563 - 1567	Tipo Classe. Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
72	Data da Cotação - Variação Cambial - Ctparte	9(02)	1568 - 1569	Data da Cotação - Variação Cambial da Contraparte. Possíveis Valores: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
73	Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1570 - 1579	Outros - Cotação da ContraParte.
74	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1580 - 1587	Alíquota - IR da ContraParte.
75	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1588 - 1595	Taxa, fator ou valor limite inferior da ContraParte.

(continua)

Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
76	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1596 - 1603	Taxa, fator ou limite superior da ContraParte.

Exclusivo para curva "Taxa de Juros Mercado Internacional"				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
77	Taxa Juros	9(03)v9(04)	1604 - 1610	Taxa Juros Parte.
78	Troca de Fluxo	9(02)	1611 - 1612	Troca de Fluxo Parte. Possíveis valores: 00 (Todas as Trocas de Fluxo), 01 (Só Para Primeira Troca de Fluxo).
79	Variação Cambial	9(02)	1613 - 1614	Variação Cambial da Parte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
80	Tipo Classe	9(05)	1615 - 1619	Tipo Classe. Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
81	Cupom Limpo / Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1620 - 1629	Cupom Limpo / Outros - Cotação
82	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1630 - 1637	Alíquota - IR Parte.
83	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1638 - 1645	Limite inferior (FLOOR) - Perc. Parte.
84	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1646 - 1653	Limite superior (CAP) - Perc. Parte.
85	Taxa Juros	9(03)v9(04)	1654 - 1660	Taxa Juros ContraParte.
86	Troca de Fluxo	9(02)	1661 - 1662	Troca de Fluxo Contraparte. Possíveis valores: 00 (Todas as Trocas de Fluxo), 01 (Só Para Primeira Troca de Fluxo).

87	Variação Cambial	9(02)	1663 - 1664	Variação Cambial da Contraparte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
88	Tipo Classe	9(05)	1665 - 1669	Tipo Classe. Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
89	Cupom Limpo / Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1670 - 1679	Cupom Limpo / Outros - Cotação
90	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1680 - 1687	Alíquota - IR ContraParte.
91	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1688 - 1695	Limite inferior (FLOOR) - Perc. ContraParte.
92	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1696 - 1703	Limite superior (CAP) - Perc. ContraParte.

Exclusivo para Commodity				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
93	Cotação Inicial	9(06)v9(04)	1704 - 1713	Cotação Inicial da Parte
94	Código da Commodity	X(15)	1714 - 1728	Código RIC da Mercadoria. Verifique arquivo AAAAMMDD_Mercadorias.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos. Campo exclusivo para swap de commodity.

(continua)

Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
95	BRANCO	X(02)	1729 - 1730	BRANCO
96	Data da Cotação da Commodity	9(02)	1731 - 1732	Data de Cotação para Ajuste da Parte Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
97	Cotação Inicial	9(06)v9(04)	1733 - 1742	Cotação Inicial da Contraparte
98	Código da Commodity	X(15)	1743 - 1757	Código RIC da Mercadoria. Verifique arquivo AAAAMMDD_Mercadorias.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos. Campo exclusivo para swap de commodity.
99	BRANCO	X(02)	1758 - 1759	BRANCO
100	Data da Cotação da Commodity	9(02)	1760 - 1761	Data de Cotação para Ajuste da Contraparte Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).

Funcionalidade/Titular da Funcionalidade/ Prêmio (1) de Funcionalidade/ Prêmio (2) de Funcionalidade				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
101	BRANCO	9(110)	1762 - 1871	BRANCO

Características				
-----------------	--	--	--	--



Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
102	Estratégia	X(11)	1872 - 1882	Código da Estratégia
103	Amortiza sem correção	X(01)	1883 - 1883	Exclusivo para contratos VCP. Deve ser informado S caso afirmativo, vazio caso contrário.
104	Código Identificador	X(14)	1884 - 1897	Código de controle interno do participante. Preenchimento não obrigatório
105	Data de Cotação Final – Termo	9(02)	1898 – 1899	Possíveis valores: 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5). Para Índice Termo referente à moedas.

(fim)

### 3.3 SWAP – REGISTRO DE CONTRATO FLUXO NÃO CONSTANTE

SWAP
Nome do Arquivo
Registro de Contrato Fluxo Não Constante
Descrição: Este layout permite o registro de um contrato de fluxo de pagamentos não periódicos.

Header				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
1	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	SWAP
2	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Linha de Header = 0
3	Código da Operação	9(04)	7 - 10	Código identificador da operação. 0001 e 0301
4	Participante que gerou o arquivo	X(20)	11 - 30	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
5	Data	9(08)	31 - 38	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
6	Controle de Versão	9(05)	39 – 43	Versão do Layouts. Conteúdo: 00003
Dados Iniciais				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
1	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	SWAP
2	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Linha de Dados = 1
3	Código operação	9(04)	7 - 10	Código identificador da operação. 0001 e 0301
4	Meu Número	9(10)	11 - 20	Código de controle atribuído pelo participante
5	Parte	9(08)	21 - 28	Código da Instituição lançadora da operação.
6	CPF/CNPJ Cliente Parte	X(14)	29 - 42	CNPJ ou CPF da Parte. Informar quando a Parte for uma conta cliente (10 ou 20)
7	BRANCO	X(10)	43 - 52	BRANCO
8	Contraparte	9(08)	53 - 60	Código da contraparte na operação.
9	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	X (14)	61 - 74	CNPJ ou CPF da Contraparte. Informar quando a Contraparte for uma conta cliente (10 ou 20)

10	BRANCO	X(10)	75 - 84	BRANCO
Características				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
11	Data início	9(08)	85 - 92	Data de início do contrato. Formato: AAAAMMDD.
12	Data vencimento	9(08)	93 - 100	Data de vencimento do contrato. Formato: AAAAMMDD.
13	Adesão a contrato	9(02)	101 - 102	Tipo de adesão: 0 (SEM ADESAO), 1 (CGD), 2(CSA), 3(CGD/CSA)
14	Valor base	9(14)v9(02)	103 - 118	Valor base do contrato.
15	BRANCO	X(02)	119 - 120	BRANCO
16	Agenda de Prêmio	9(02)	121 - 122	Paga prêmio. Possíveis valores: 00 (sim) e 01 (não)
17	BRANCO	X(02)	123 - 124	BRANCO
18	Observação	X(100)	125 - 224	Campo de preenchimento opcional pelo participante.

(continua)

Exclusivo para Contrato a Termo				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
19	Data operação	9(08)	225 - 232	Data da operação quando a mesma for pactuada a termo, com cliente1 e registrada em D+1. Formato: AAAAMMDD.
20	Índice Termo	9(02)	233 - 234	Código do indexador de correção da operação a termo. Possíveis valores: 00 (VCP), 01 (SELIC), 03 (DI), 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 53 (EURO-BCE), 78 (FRANCO SUIÇO BCE).
21	Percentual Termo	9(03)v9(02)	235 - 239	Percentual a ser aplicado sobre o indexador que o Participante quer que corrija o Valor Base Inicial da operação a termo.
Se Índice Termo e "VCP" ou "DOLAR"				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
22	PU Inicial	9(14)v9(08)	240 - 261	PU Inicial para operação a termo = VCP
23	Tipo/Classe	9(05)	262 - 266	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
24	Denominação	X(320)	267 - 586	Denominação para operação a termo = VCP
Fluxo de Juros e Amortização				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
25	BRANCO	X(42)	587 - 628	BRANCO
Curva para Atualização				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo

26	Percentual	9(03)v9(02)	629 - 633	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato da Parte. Para curva SOFR é obrigatório o preenchimento = 100%
27	Curva	X(03)	634 - 636	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
28	BRANCO	9(08)	637 - 644	BRANCO
29	Sinal Taxa	9(02)	645 - 646	"+" ou "-" da Parte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
30	Juros	9(03)v9(04)	647 - 653	Taxa de juros atualizada da Parte.
31	Lim. Inferior (Floor)	9(08)v9(08)	654 - 669	Limite Inferior
32	Lim. Superior (Cap)	9(08)v9(08)	670 - 685	Limite Superior
33	Percentual	9(03)v9(02)	686 - 690	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato do ContraParte.
34	Curva	X(03)	691 - 693	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
35	BRANCO	9(08)	694 - 701	BRANCO
36	Sinal Taxa	9(02)	702 - 703	"+" ou "-" da Contraparte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").

(continua)

Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
37	Juros	9(03)v9(04)	704 - 710	Taxa de juros atualizada do Contraparte.
38	Lim. Inferior (Floor)	9(08)v9(08)	711 - 726	Limite Inferior
39	Lim. Superior (Cap)	9(08)v9(08)	727 - 742	Limite Superior
Terceira Curva				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
40	BRANCO	9(35)	743 - 777	BRANCO
Se curva(s) = "VCP"				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
41	Pu inicial	9(14)v9(08)	778 - 799	Preço unitário do índice na data de início, no caso de código =00 para Parte.
42	Tipo/Classe	9(05)	800 - 804	Tipo Classe. Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
43	Denominação	X(320)	805 - 1124	Denominação para Parte.
44	Pu inicial	9(14)v9(08)	1125 - 1146	Preço unitário do índice na data de início, no caso de código =00 para ContraParte.

45	Tipo/Classe	9(05)	1147 - 1151	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas _Moedas_ Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
46	Denominação	X(320)	1152 - 1471	Denominação para Contraparte.
Cupom Limpo/Data Cotação				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
47	Cupom Limpo Parte	9(08)v9(07)	1472 - 1486	Cotação Cupom Limpo Curva Moeda ou VCP (exceto 73)
48	Data de Cotação Parte	9(02)	1487 - 1488	Possíveis valores: 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
49	Cupom Limpo ContraParte	9(08)v9(07)	1489 - 1503	Cotação Cupom Limpo Curva Moeda ou VCP (exceto 73)
50	Data de Cotação ContraParte	9(02)	1504 - 1505	Possíveis valores: 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).

Exclusivo para curva "Libor"				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
51	BRANCO	9(02)	1506 - 1507	BRANCO
52	BRANCO	9(02)	1508 - 1509	BRANCO
53	Data de Cotação	9(02)	1510 - 1511	Possíveis valores da Parte: 00 (D), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
54	Varição Cambial	9(02)	1512 - 1513	Varição Cambial da Parte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).

(continua)

Exclusivo para curva "Libor"				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
55	Tipo Classe	9(05)	1514 - 1518	Tipo Classe.Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas _Moedas_ Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
56	Data da Cotação - Varição Cambial - Parte	9(02)	1519 - 1520	Data da Cotação - Varição Cambial da Parte. Possíveis Valores: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
57	Cupom Limpo/Outros Cotação	9(03)v9(07)	1521 - 1530	Outros - Cotação da Parte.
58	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1531 - 1538	Alíquota - IR da Parte.
59	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1539 - 1546	Taxa, fator ou valor limite inferior da Parte.
60	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1547 - 1554	Taxa, fator ou limite superior da Parte.
61	BRANCO	9(02)	1555 - 1556	BRANCO

62	BRANCO	9(02)	1557 - 1558	BRANCO
63	Data de Cotação	9(02)	1559 - 1560	Possíveis valores da Contraparte: 00 (D), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
64	Variação Cambial	9(02)	1561 - 1562	Variação Cambial da Contraparte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
65	Tipo Classe	9(05)	1563 - 1567	Tipo Classe. Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
66	Data da Cotação - Variação Cambial - Ctparte	9(02)	1568 - 1569	Data da Cotação - Variação Cambial da Contraparte. Possíveis Valores: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
67	Cupom Limpo/Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1570 - 1579	Outros - Cotação da ContraParte.
68	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1580 - 1587	Alíquota - IR da ContraParte.
69	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1588 - 1595	Taxa, fator ou valor limite inferior da ContraParte.
70	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1596 - 1603	Taxa, fator ou limite superior da ContraParte.

Exclusivo para curva "Taxa de Juros Mercado Internacional"				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
71	Taxa Juros	9(03)v9(04)	1604 - 1610	Taxa Juros Parte.
72	Troca de Fluxo	9(02)	1611 - 1612	Troca de Fluxo Parte. Possíveis valores: 00 (Todas as Trocas de Fluxo), 01 (Só Para Primeira Troca de Fluxo).
73	Variação Cambial	9(02)	1613 - 1614	Variação Cambial da Parte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).

(continua)

Exclusivo para curva "Taxa de Juros Mercado Internacional"				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
74	Tipo Classe	9(05)	1615 - 1619	Tipo Classe. Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
75	Cupom Limpo / Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1620 - 1629	Cupom Limpo / Outros - Cotação
76	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1630 - 1637	Alíquota - IR Parte.
77	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1638 - 1645	Limite inferior (FLOOR) - Perc. Parte.
78	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1646 - 1653	Limite superior (CAP) - Perc. Parte.
79	Taxa Juros	9(03)v9(04)	1654 - 1660	Taxa Juros ContraParte.

80	Troca de Fluxo	9(02)	1661 - 1662	Troca de Fluxo Contraparte. Possíveis valores: 00 (Todas as Trocas de Fluxo), 01 (Só Para Primeira Troca de Fluxo).
81	Variação Cambial	9(02)	1663 - 1664	Variação Cambial da Contraparte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
82	Tipo Classe	9(05)	1665 - 1669	Tipo Classe. Verifique arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
83	Cupom Limpo / Outros - Cotação	9(03)v9(07)	1670 - 1679	Cupom Limpo / Outros - Cotação
84	Alíquota - IR	9(03)v9(05)	1680 - 1687	Alíquota - IR ContraParte.
85	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	9(03)v9(05)	1688 - 1695	Limite inferior (FLOOR) - Perc. ContraParte.
86	Limite superior (CAP) - Perc.	9(03)v9(05)	1696 - 1703	Limite superior (CAP) - Perc. ContraParte.
Exclusivo para Commodity				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
87	Cotação Inicial	9(06)v9(04)	1704 - 1713	Cotação Inicial da Parte
88	Código da Commodity	X(15)	1714 - 1728	Código RIC da Mercadoria. Verifique arquivo AAAAMMDD_Mercadorias.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos. Campo exclusivo para swap de commodity.
89	BRANCO	X(02)	1729 - 1730	BRANCO
90	Data da Cotação da Commodity	9(02)	1731 - 1732	Data de Cotação para Ajuste da Parte Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
91	Cotação Inicial	9(06)v9(04)	1733 - 1742	Cotação Inicial da Contraparte
92	Código da Commodity	X(15)	1743 - 1757	Código RIC da Mercadoria. Verifique arquivo AAAAMMDD_Mercadorias.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos. Campo exclusivo para swap de commodity.

(continua)

Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
93	BRANCO	X(02)	1758 - 1759	BRANCO
94	Data da Cotação da Commodity	9(02)	1760 - 1761	Data de Cotação para Ajuste da Contraparte Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).

Funcionalidade/Titular da Funcionalidade/ Prêmio (1) de Funcionalidade/ Prêmio (2) de Funcionalidade				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
95	BRANCO	9(110)	1762 - 1871	BRANCO
<b>Características</b>				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
96	Estratégia	X(11)	1872 - 1882	Código da Estratégia
97	Amortiza sem correção	X(01)	1883 - 1883	Exclusivo para contratos VCP. Deve ser informado S caso afirmativo, vazio caso contrário.
98	Código Identificador	X(14)	1884 - 1897	Código de controle interno do participante. Preenchimento não obrigatório.
99	Data de Cotação Final – Termo	9(02)	1898 – 1899	Possíveis valores: 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5). Para Índice Termo referente à moedas.
100	Data de Fixing IPCA (Parte)	9(02)	1901-1902	Indica o fixing que será utilizado na apuração da cotação final de contratos com IPCA da Contraparte Campo com as opções: 01 = M-1 e 02 = M-2
101	Data de Fixing IPCA (Contraparte)	9(02)	1902-1903	Indica o fixing que será utilizado na apuração da cotação final de contratos com IPCA da Contraparte Campo com as opções: 01 = M-1 e 02 = M-2
<b>102</b>	<b>BRANCO</b>	<b>X(24)</b>	<b>1904-1927</b>	<b>BRANCO</b>

Exclusivo para curva Exclusivo para curva “Juros Internacionais Overnight”				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
103	Data Liquidação	9(02)	1928-1929	Parte e Contraparte. Possíveis valores: 00 (D+0), 01 (D+1), 02 (D+2), 03 (D+3), 04 (D+4) e 05 (D+5).
104	Cotação Inicial Moeda Parte	9(08)v9(07)	1930-1944	Cotação Inicial Moeda Parte Campo tipo numérico Formato: 8 inteiros e 7 casas decimais
105	Metodologia de composição da taxa Parte	9(02)	1945-1946	Metodologia de composição da taxa da Parte. Possíveis valores: 01 (Compounding act/360).
106	Deslocamento da taxa Parte	9(02)	1947-1948	Deslocamento da taxa da Parte. Possíveis valores: 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5), 06 (D-6), 07 (D-7), 08 (D-8), 09 (D-9) e 10 (D-10) da Parte.

107	Expressão Juros Parte	9(02)	1949-1950	Expressão Juros da Parte. Possíveis valores: 01 (Linear act/360).
108	Alíquota IR (em %) Parte	9(03)v9(05)	1951-1958	Alíquota IR (em %) da Parte. Campo atualmente desabilitado (não permitido o preenchimento)
109	Cotação Inicial Moeda Contraparte	9(08)v9(07)	1959-1973	Cotação Inicial Moeda Contraparte Campo tipo numérico Formato: 8 inteiros e 7 casas decimais
110	Metodologia de composição da taxa Contraparte	9(02)	1974-1975	Metodologia de composição da taxa da Contraparte. Possíveis valores: 01 (Compounding act/360) da Contraparte
111	Deslocamento da taxa Contraparte	9(02)	1976-1977	Deslocamento da taxa da Contraparte. Possíveis valores: : 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5), 06 (D-6), 07 (D-7), 08 (D-8), 09 (D-9) e 10 (D-10) da Contraparte.
112	Expressão Juros Contraparte	9(02)	1978-1979	Expressão Juros da Contraparte. Possíveis valores: 01 (Linear act/360).
113	Alíquota IR (em %) Contraparte	9(03)v9(05)	1980-1987	Alíquota IR (em %) da Contraparte

Exclusivo para curva Exclusivo para curva "TERM SOFR"				
Id	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
114	Variação Cambial - Parte	9(02)	1988-1989	Variação Cambial. Possíveis valores: 15 (DOLAR) Campo obrigatório sempre que for indicado a curva TERM SOFR
115	Cotação Inicial Moeda - Parte	9(08)v9(07)	1990-2004	Cotação Inicial Moeda Campo tipo numérico Formato: 8 inteiros e 7 casas decimais
116	Variação Cambial - Contraparte	9(02)	2005-2006	Variação Cambial. Possíveis valores: 15 (DOLAR) Campo obrigatório sempre que for indicado a curva TERM SOFR
117	Cotação Inicial Moeda - Contraparte	9(08)v9(07)	2007-2021	Cotação Inicial Moeda Campo opcional Campo tipo numérico Formato: 8 inteiros e 7 casas decimais

(fim)



## 4 RECEBER ARQUIVOS

### 4.1 SWAP – DPOSIÇÃO

<b>Módulo: Swap Sem CCP</b>
<b>Nome do Arquivo: DPOSIÇÃO</b>
<b>Descrição:</b> Contém informações sobre a posição dos contratos de Swap Sem CCP que estão em contas de custódia sob sua responsabilidade.

Seq.	Campo	Descrição
01	Tipo de Contrato	Tipo do contrato. Possíveis valores: 00 (CONSTANTE), 01 (NÃO CONSTANTE) ou 02 (PAGAMENTO FINAL)
02	Separador	Ponto e vírgula (;).
03	Data	Data
04	Separador	Ponto e vírgula (;).
05	Contrato	Código identificador do contrato
06	Separador	Ponto e vírgula (;).
07	Participante	Código da Instituição lançadora da operação.
08	Separador	Ponto e vírgula (;).
09	CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF ou CNPJ da parte quando for cliente 1.
10	Separador	Ponto e vírgula (;).
11	Cesta Garantias Parte	Código identificador da Cesta de Garantias da Parte (caso haja)
12	Separador	Ponto e vírgula (;).
13	Comissão Parte	Comissão da Parte
14	Separador	Ponto e vírgula (;).
15	Contraparte	Código da contraparte na operação.
16	Separador	Ponto e vírgula (;).
17	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	CPF ou CNPJ da contraparte quando for cliente 1.
18	Separador	Ponto e vírgula (;).
19	Cesta Garantias Contraparte	Código identificador da Cesta de Garantias da Contraparte (caso haja)
20	Separador	Ponto e vírgula (;).
21	Comissão Contraparte	Comissão da Contraparte
22	Separador	Ponto e vírgula (;).
23	Data início	Data de início do contrato. Formato: AAAAMMDD.
24	Separador	Ponto e vírgula (;).
25	Data vencimento	Data de vencimento do contrato. Formato: AAAAMMDD.
26	Separador	Ponto e vírgula (;).
27	Tipo de Adesão	Informação sobre o tipo de adesão do contrato. Possíveis valores: 0- SEM ADESAO, 1-CGD, 2-CSA, 3-CGD/CSA
28	Separador	Ponto e vírgula (;).

29	Valor base	Valor base do contrato (2 casas decimais).
30	Separador	Ponto e vírgula (;).
31	Valor Base Remanescente	Valor base remanescente (2 casas decimais)
32	Separador	Ponto e vírgula (;).
33	Valor Antecipado	Valor Antecipado (2 casas decimais)
34	Separador	Ponto e vírgula (;).
35	Saldo	Saldo (2 casas decimais)
36	Separador	Ponto e vírgula (;).
37	Sinal Saldo	Sinal do Saldo. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
38	Separador	Ponto e vírgula (;).
39	Data do Saldo	Data do Saldo
40	Separador	Ponto e vírgula (;).
41	Funcionalidade	Funcionalidade do Contrato: 00 (SEM_FUNCIONALIDADE), 01 (KNOCK_IN), 02 (KNOCK_OUT), 03 (KNOCK_INOUT), 04 (SWAPTION), 05 (COMPOUND), 06 (OPCAO_ARREPEND), 07 (KNOCK_IN_COM_OPCAO), 08 (KNOCK_OUT_COM_OPCAO).
42	Separador	Ponto e vírgula (;).
43	Agenda de Prêmio	Paga prêmio. Possíveis valores: 00 (sim) e 01 (não)
44	Separador	Ponto e vírgula (;).
45	Reset	Com Reset. Possíveis valores: 00 (sim) e 01 (não)
46	Separador	Ponto e vírgula (;).
47	Observação	Observação quanto às características do contrato.
48	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Contrato a termo</b>		
49	Valor base inicial	Valor base do contrato se operação a termo. (2 casas decimais)
50	Separador	Ponto e vírgula (;).
51	Data operação termo	Data da operação quando a mesma for pactuada a termo, com cliente1 e registrada em D+1. Formato: AAAAMMDD.
52	Separador	Ponto e vírgula (;).
53	Índice Termo	Código do indexador de correção da operação a termo. Possíveis valores: 03 (DI), 01 (SELIC), 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (OUTROS), 53 (EURO BCE)
54	Separador	Ponto e vírgula (;).
55	Percentual Termo	Percentual a ser aplicado sobre o indexador que o Participante quer que corrija o Valor Base Inicial da operação a termo. Contém duas casas decimais
56	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Contrato a termo índice "VCP"</b>		
57	PU Inicial	14 inteiros e 8 fracionários
58	Separador	Ponto e vírgula (;).
59	Tipo/Classe	Consultar código no sistema
60	Separador	Ponto e vírgula (;).
61	Nome Tipo/Classe	Nome tipo classe
62	Separador	Ponto e vírgula (;).

63	Denominação	Denominação VCP
64	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Fluxo de Juros e Amortizações</b>		
65	Juros a cada	Número
66	Separador	Ponto e vírgula (;).
67	Expresso em	Possíveis valores: 00 (Dias Úteis), 01 (Dias Corridos), 02 (Meses)
68	Separador	Ponto e vírgula (;).
69	Data inicio pagamento juros	Data de inicio de pagamento de juros. Formato: AAAAMMDD.
70	Separador	Ponto e vírgula (;).
71	Amortização a cada	Número
72	Separador	Ponto e vírgula (;).
73	Expresso em	Possíveis valores: 00 (Dias Úteis), 01 (Dias Corridos), 02 (Meses)
74	Separador	Ponto e vírgula (;).
75	Data inicio pagamento amortização	Data de inicio de pagamento de amortização. Formato: AAAAMMDD.
76	Separador	Ponto e vírgula (;).
77	Tipo de amortização	Possíveis valores: 00 (Sobre Valor Base Original), 01 (Sobre Valor Base Remanescente), 02 (Sem Troca de Amortização), 03 (Na Data de Vencimento)
78	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Curva para Atualização Participante</b>		
79	Percentual	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato (3 inteiros e 2 fracionários).
80	Separador	Ponto e vírgula (;).
81	Código índice	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
82	Separador	Ponto e vírgula (;).
83	TR Escolhida	DataTR
84	Separador	Ponto e vírgula (;).
85	Sinal Taxa	"+" ou "-" da Parte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
86	Separador	Ponto e vírgula (;).
87	Taxa	Taxa de juros atualizada (3 inteiros e 4 fracionários)
88	Separador	Ponto e vírgula (;).
89	Lim. Inferior (Floor)	Limite Inferior
90	Separador	Ponto e vírgula (;).
91	Lim. Superior (Cap)	Limite Superior
92	Separador	Ponto e vírgula (;).
93	Valor Curva Atualizado	Valor Curva Atualizado (2 fracionários)
94	Separador	Ponto e vírgula (;).
95	Data Correção	Data Correção
96	Separador	Ponto e vírgula (;).
97	Fator Original de Juros	Fator (9 fracionários)
98	Separador	Ponto e vírgula (;).

Curva para Atualização Contraparte		
99	Percentual	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato. Contém três casas inteiras e duas fracionárias.
100	Separador	Ponto e vírgula (;).
101	Código índice	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos.
102	Separador	Ponto e vírgula (;).
103	TR Escolhida	DataTR
104	Separador	Ponto e vírgula (;).
105	Sinal Taxa	"+" ou "-" da Contraparte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
106	Separador	Ponto e vírgula (;).
107	Taxa	Taxa de juros atualizada
108	Separador	Ponto e vírgula (;).
109	Lim. Inferior (Floor)	Limite Inferior
110	Separador	Ponto e vírgula (;).
111	Lim. Superior (Cap)	Limite Superior
112	Separador	Ponto e vírgula (;).
113	Valor Curva Atualizado	Valor Curva Atualizado (2 fracionários)
114	Separador	Ponto e vírgula (;).

(continua)

Seq.	Campo	Descrição
115	Data Correção	Data Correção
116	Separador	Ponto e vírgula (;).
117	Fator Original de Juros	Fator (9 fracionários)
118	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Terceira Curva</b>		
119	Parte/Contraparte	Terceira Curva: 00 (PARTE), 01 (CONTRAPARTE)
120	Separador	Ponto e vírgula (;).
121	Cupom Limpo	Cupom limpo Terceira Curva (7 fracionários)
122	Separador	Ponto e vírgula (;).
123	Percentual	Percentual Terceira Curva (2 fracionários)
124	Separador	Ponto e vírgula (;).
125	Curva	Tipo de Curva da Terceira Curva. Possíveis valores: 03 (DI), 15 (DOLAR), 01 (SELIC), 04 (OURO), 09 (IGP-M), 10 (IGP-DI), 16 (INPC), 20 (TR), 23 (TJLP), 65 (DOLAR COM. EXP), 33 (EURO), 35 (IENE)
126	Separador	Ponto e vírgula (;).
127	Sinal Taxa	Sinal da Terceira Curva: 00 ("+") e 01 ("-").
128	Separador	Ponto e vírgula (;).
129	Taxa de Juros	Taxa de Juros Terceira Curva (4 fracionários)
130	Separador	Ponto e vírgula (;).
131	Limitador	Tipo do Limitador Terceira Curva: 00 (LIM. INFERIOR) 01 (LIM. SUPERIOR)
132	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para Curva "VCP" Participante</b>		
133	Pu inicial	Preço unitário do índice na data de início, no caso de código =00. (8 fracionários)
134	Separador	Ponto e vírgula (;).
135	Pu atual	Preço unitário do índice na data atual, no caso de código =00. (8 fracionários)
136	Separador	Ponto e vírgula (;).
137	Tipo/Classe	Consultar Código no Sistema
138	Separador	Ponto e vírgula (;).
139	Nome Tipo/Classe	Nome tipo classe
140	Separador	Ponto e vírgula (;).
141	Denominação	Denominação VCP
142	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para Curva "VCP" Contraparte</b>		
143	Pu inicial	Preço unitário do índice na data de início, no caso de código =00. (8 fracionários)
144	Separador	Ponto e vírgula (;).
145	Pu atual	Preço unitário do índice na data atual, no caso de código =00. (8 fracionários)
146	Separador	Ponto e vírgula (;).
147	Tipo/Classe	Consultar Código no Sistema

148	Separador	Ponto e vírgula (;).
149	Nome Tipo/Classe	Nome tipo classe
150	Separador	Ponto e vírgula (;).
151	Denominação	Denominação VCP
152	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para Curva Moeda Parte</b>		
153	Cupom Limpo	Cupom limpo (7 fracionários)
154	Separador	Ponto e vírgula (;).

(continua)

Seq.	Campo	Descrição
155	Data de Cotação	Possíveis valores: 00 (D0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
156	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para Curva Moeda Contraparte</b>		
157	Cupom Limpo	Cupom limpo (7 fracionários)
158	Separador	Ponto e vírgula (;).
159	Data de Cotação	Possíveis valores: 00 (D0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
160	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para Curva Libor Participante</b>		
161	Tipo Libor - moeda	Tipo Libor - moeda da Parte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA).
162	Separador	Ponto e vírgula (;).
163	Tipo Libor - período	Tipo Libor - período da Parte. Possíveis valores: 00 (Mensal), 01 (Trimestral), 02 (Semestral), 03 (Anual).
164	Separador	Ponto e vírgula (;).
165	Data de Cotação	Possíveis valores da Parte: 00 (D), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3).
166	Separador	Ponto e vírgula (;).
167	Variação Cambial	Variação Cambial da Parte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
168	Separador	Ponto e vírgula (;).
169	Tipo Classe	Consultar Código no Sistema
170	Separador	Ponto e vírgula (;).
171	Nome Tipo/Classe	Nome tipo classe
172	Separador	Ponto e vírgula (;).
173	Outros - Cotação	Cotação (7 fracionários)
174	Separador	Ponto e vírgula (;).
175	Alíquota - IR	Alíquota (5 fracionários)
176	Separador	Ponto e vírgula (;).
177	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	Valor limite inferior (5 fracionários)
178	Separador	Ponto e vírgula (;).
179	Limite superior (CAP) - Perc.	Valor limite superior (5 fracionários)

180	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para Curva Libor Contraparte</b>		
181	Tipo Libor - moeda	Tipo Libor - moeda da Contraparte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA).
182	Separador	Ponto e vírgula (;).
183	Tipo Libor - período	Tipo Libor - período da Contraparte. Possíveis valores: 00 (Mensal), 01 (Trimestral), 02 (Semestral), 03 (Anual).
184	Separador	Ponto e vírgula (;).
185	Data de Cotação	Possíveis valores da Contraparte: 00 (D), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3).
186	Separador	Ponto e vírgula (;).
187	Variação Cambial	Variação Cambial da Contraparte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
188	Separador	Ponto e vírgula (;).
189	Tipo Classe	Consultar Código no Sistema
190	Separador	Ponto e vírgula (;).
191	Nome Tipo/Classe	Nome tipo classe
192	Separador	Ponto e vírgula (;).
193	Outros - Cotação	Cotação (7 fracionários)
194	Separador	Ponto e vírgula (;).

(continua)

Seq.	Campo	Descrição
195	Alíquota - IR	Alíquota (5 fracionários)
196	Separador	Ponto e vírgula (;).
197	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	Valor limite inferior (5 fracionários)
198	Separador	Ponto e vírgula (;).
199	Limite superior (CAP) - Perc.	Valor limite superior (5 fracionários)
200	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para curva TJMI Participante</b>		
201	Taxa Juros	Taxa (4 fracionários)
202	Separador	Ponto e vírgula (;).
203	Troca de Fluxo	Troca de Fluxo Parte. Possíveis valores: 00 (Todas as Trocas de Fluxo), 01 (Só Para Primeira Troca de Fluxo).
204	Separador	Ponto e vírgula (;).
205	Variação Cambial	Variação Cambial da Parte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
206	Separador	Ponto e vírgula (;).
207	Tipo Classe	Consultar Código no Sistema
208	Separador	Ponto e vírgula (;).
209	Nome Tipo/Classe	Nome tipo classe
210	Separador	Ponto e vírgula (;).
211	Outros - Cotação	Cotação (7 fracionários)
212	Separador	Ponto e vírgula (;).
213	Alíquota - IR	Alíquota (5 fracionários)

214	Separador	Ponto e vírgula (;).
215	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	Valor limite inferior (5 fracionários)
216	Separador	Ponto e vírgula (;).
217	Limite superior (CAP) - Perc.	Valor limite superior (5 fracionários)
218	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para curva TJMI Contraparte</b>		
219	Taxa Juros	Taxa (4 fracionários)
220	Separador	Ponto e vírgula (;).
221	Troca de Fluxo	Troca de Fluxo Contraparte. Possíveis valores: 00 (Todas as Trocas de Fluxo), 01 (Só Para Primeira Troca de Fluxo).
222	Separador	Ponto e vírgula (;).
223	Variação Cambial	Variação Cambial da Contraparte. Possíveis valores: 15 (DOLAR), 33 (EURO), 35 (IENE), 36 (LIBRA), 00 (VCP).
224	Separador	Ponto e vírgula (;).
225	Tipo Classe	Consultar Código no Sistema
226	Separador	Ponto e vírgula (;).
227	Nome Tipo/Classe	Nome tipo classe
228	Separador	Ponto e vírgula (;).
229	Outros - Cotação	Cotação (7 fracionários)
230	Separador	Ponto e vírgula (;).
231	Alíquota - IR	Alíquota (5 fracionários)
232	Separador	Ponto e vírgula (;).
233	Limite inferior (FLOOR) - Perc.	Valor limite inferior (5 fracionários)
234	Separador	Ponto e vírgula (;).
235	Limite superior (CAP) - Perc.	Valor limite superior (5 fracionários)
236	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Funcionalidade</b>		
237	Parte/Contraparte	Ponta do Trigger In: 00 (PARTE), 01 (CONTRAPARTE)
238	Separador	Ponto e vírgula (;).
239	Fator/Valor/Taxa	Fator do Trigger In (8 fracionários)
240	Separador	Ponto e vírgula (;).
241	Verificação	Verificação do Trigger In: 00 (DIÁRIO), 01 (FINAL)
242	Separador	Ponto e vírgula (;).
243	Data Disparo	Data do Disparo
244	Separador	Ponto e vírgula (;).
245	Parte/Contraparte	Ponta do Trigger Out: 00 (PARTE), 01 (CONTRAPARTE)
246	Separador	Ponto e vírgula (;).
247	Fator/Valor/Taxa	Fator do Trigger Out (8 fracionários)
248	Separador	Ponto e vírgula (;).
249	Verificação	Verificação do Trigger Out: 00 (DIÁRIO), 01 (FINAL)
250	Separador	Ponto e vírgula (;).
251	Data Disparo	Data do Disparo
252	Separador	Ponto e vírgula (;).
253	Titular	Titular do Prêmio 1: 00 (PARTE), 01 (CONTRAPARTE)
254	Separador	Ponto e vírgula (;).



255	Prêmio 1	Valor do Prêmio 1 (2 fracionários)
256	Separador	Ponto e vírgula (;).
257	Rebate	Valor do Rebate (2 fracionários)
258	Separador	Ponto e vírgula (;).
259	Liquidação do Rebate	Liquidação do Rebate: 00 (VENCIMENTO), 01 (TRIGGER OUT), 02(APÓS NUMERO DIAS UTEIS)
260	Separador	Ponto e vírgula (;).
261	Dias Úteis após o Trigger Out	Dias úteis para liquidação do rebate após o trigger out
262	Separador	Ponto e vírgula (;).
263	Prêmio 2	Valor do prêmio 2 (2 fracionários)
264	Separador	Ponto e vírgula (;).
265	Data Exercício Prêmio 2	Data do Prêmio 2
266	Separador	Ponto e vírgula (;).
267	Estratégia	Código da Estratégia
268	Separador	Ponto e vírgula (;).
269	Amortiza sem Troca de Diferencial	Exclusivo para contratos VCP. 00 (SIM), 01 (NÃO)
270	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para Curva Libor Parte</b>		
271	Data da Cotação - Variação Cambial	Possíveis valores: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
272	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para Curva Libor Contraparte</b>		
273	Data da Cotação - Variação Cambial	Possíveis valores: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
274	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para Curva Commodity e Ação Parte</b>		
275	Cotação Inicial	Cotação inicial da ação/commodity. 6 inteiros e 4 decimais
276	Separador	Ponto e vírgula (;).
277	Código Commodity	Código RIC da Mercadoria ou Código da Ação. Verifique arquivo AAAAMMDD_Mercadorias.txt <incluir arquivo de ações> em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos. Campo exclusivo para swap de commodity ou ação.
278	Separador	Ponto e vírgula (;).

(continua)

Seq.	Campo	Descrição
279	Media Asiática Verificação	Media para verificação da commodity: 00 (SIMPLES), 01 (PONDERADO)
280	Separador	Ponto e vírgula (;).
281	Data Cotação para Ajuste	Data da Cotação da Commodity/Ação: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
282	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Para Curva Commodity e Ação Contraparte</b>		
283	Cotação Inicial	Cotação inicial da commodity/ação. 6 inteiros e 4 decimais
284	Separador	Ponto e vírgula (;).
285	Código Commodity	Código RIC da Mercadoria ou Código da Ação. Verifique arquivo AAAAMMDD_Mercadorias.txt <incluir arquivo de ações> em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos. Campo exclusivo para swap de commodity ou ação.
286	Separador	Ponto e vírgula (;).
287	Media Asiática Verificação	Media para verificação da commodity: 00 (SIMPLES), 01 (PONDERADO)
288	Separador	Ponto e vírgula (;).
289	Data Cotação para Ajuste	Data da Cotação da Commodity/Ação: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
290	Separador	Ponto e vírgula (;).
291	Código Identificador	Código para controle interno do participante.
292	Separador	Ponto e vírgula (;).
293	Data de Cotação Final – Termo	Possíveis valores: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
294	Separador	Ponto e vírgula (;).
<b>Tipo de Cotação Parte/Contraparte</b>		
295	Tipo de Cotação (Parte)	Tipo de cotação da Ação da Curva da Parte: 1 (Fechamento), 2 (Mínimo), 3 (Máximo), 4 (Média) e 5 (Ajuste)
296	Separador	Ponto e vírgula (;).
297	Tipo de Cotação (Contraparte)	Tipo de cotação da Ação da Curva da Contraparte: 1 (Fechamento), 2 (Mínimo), 3 (Máximo), 4 (Média) e 5 (Ajuste)
<b>Exclusivo para curva Exclusivo para curva “Juros Internacionais Overnight”</b>		
298	Separador	Ponto e vírgula (;).
299	Data Liquidação	Possíveis valores: 00 (D+0), 01 (D+1), 02 (D+2), 03 (D+3), 04 (D+4) e 05 (D+5).
<b>Para Curva SOFR Parte</b>		
300	Separador	Ponto e vírgula (;).
301	Cotação Inicial Moeda Parte	Cotação Inicial Moeda Parte
302	Separador	Ponto e vírgula (;).
303	Metodologia de composição da taxa Parte	Metodologia de composição da taxa da Parte. Possíveis valores: 01 (Compounding act/360).
304	Separador	Ponto e vírgula (;).
305	Deslocamento da taxa Parte	Deslocamento da taxa da Parte. Possíveis valores: 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5), 06 (D-6), 07 (D-7), 08 (D-8), 09 (D-9) e 10 (D-10) da Parte.

306	Separador	Ponto e vírgula (;).
307	Expressão Juros Parte	Expressão Juros da Parte. Possíveis valores: 01 (Linear act/360).
308	Separador	Ponto e vírgula (;).
309	Alíquota IR (em %) Parte	Alíquota IR (em %) da Parte
<b>Para Curva SOFR Contraparte</b>		
310	Separador	Ponto e vírgula (;).
311	Cotação Inicial Moeda Contraparte	Cotação Inicial Moeda Contraparte
312	Separador	Ponto e vírgula (;).
313	Metodologia de composição da taxa Contraparte	Metodologia de composição da taxa da Contraparte. Possíveis valores: 01 (Compounding act/360).
314	Separador	Ponto e vírgula (;).
315	Deslocamento da taxa Contraparte	Deslocamento da taxa da Contraparte. Possíveis valores: 00 (D-0), 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5), 06 (D-6), 07 (D-7), 08 (D-8), 09 (D-9) e 10 (D-10) da Contraparte.
316	Separador	Ponto e vírgula (;).
317	Expressão Juros Contraparte	Expressão Juros da Contraparte. Possíveis valores: 01 (Linear act/360).
318	Separador	Ponto e vírgula (;).
319	Alíquota IR (em %) Contraparte	Alíquota IR (em %) da Contraparte
320	Separador	Ponto e vírgula (;).
321	Data de Fixing IPCA (Parte)	Indica o <i>fixing</i> que será utilizado na apuração da cotação final de contratos com IPCA da Parte Campo com as opções: 01 = M-1 ; 02 = M-2
322	Separador	Ponto e vírgula (;).
323	Data de Fixing IPCA (Contraparte)	Indica o <i>fixing</i> que será utilizado na apuração da cotação final de contratos com IPCA da Contraparte Campo com as opções: 01 = M-1 ; 02 = M-2
324	Separador	Ponto e vírgula (;).
325	Sinal Spread (Parte)	Sinal do Spread da Parte: 00 ("+") e 01 ("-").
326	Separador	Ponto e vírgula (;).
327	Spread (Parte)	Indica o Spread da Parte de um Swap de Commodities, caso exista
328	Separador	Ponto e vírgula (;).
329	Sinal Spread (Contraparte)	Sinal do Spread da Contraparte: 00 ("+") e 01 ("-").
330	Separador	Ponto e vírgula (;).
331	Spread (Contraparte)	Indica o Spread da Contraparte de um Swap de Commodities, caso exista
<b>Para Curva TERM SOFR Parte</b>		

332	Separador	Ponto e vírgula (;)
333	Varição Cambial	Indica a moeda correspondente para a curva.
334	Separador	Ponto e vírgula (;)
335	Cotação Inicial Moeda	Indica a Cotação Inicial da Moeda para a curva Term Sofr
<b>Para Curva TERM SOFR Contraparte</b>		
336	Separador	Ponto e vírgula (;)
337	Varição Cambial	Indica a moeda correspondente para a curva.
338	Separador	Ponto e vírgula (;)
339	Cotação Inicial Moeda	Indica a Cotação Inicial da Moeda para a curva Term Sofr