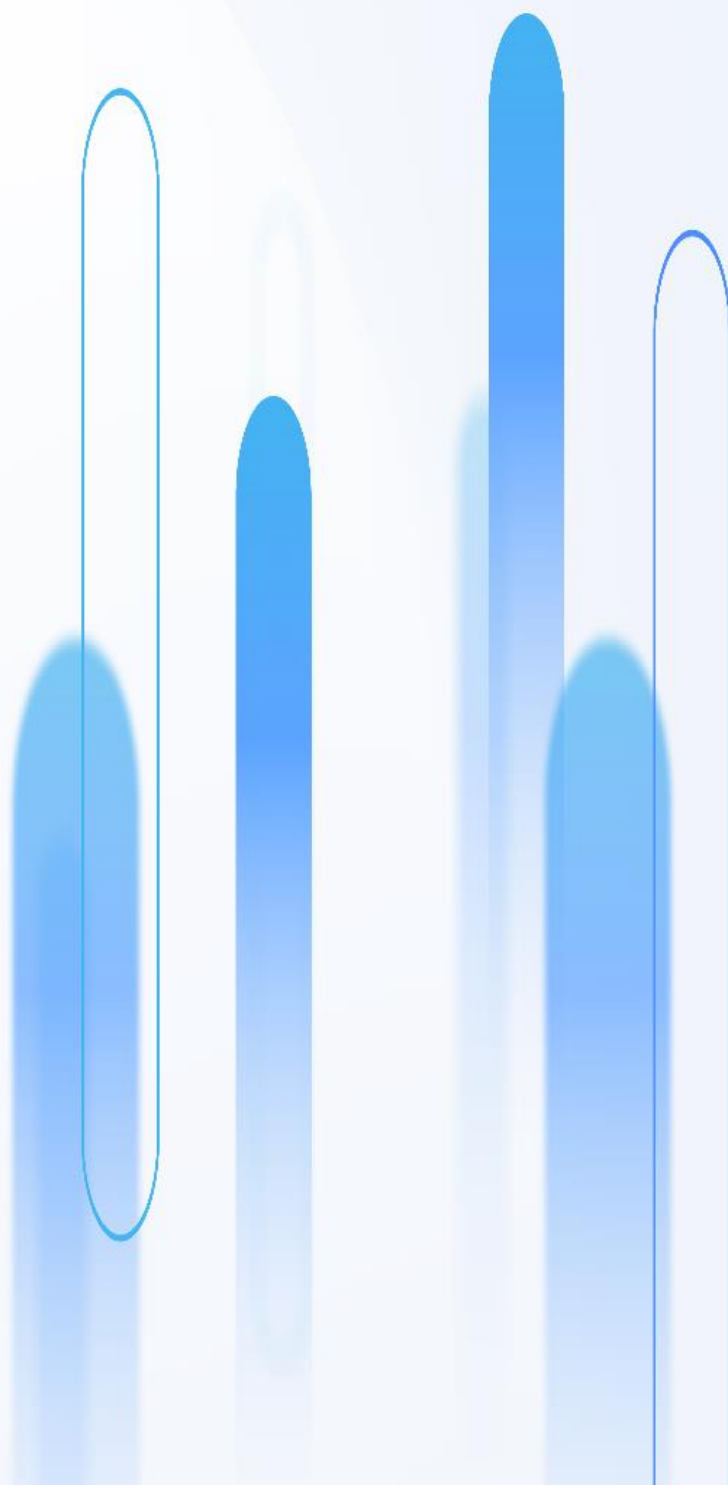




Serviço iMercado  
Layout do Relatório IMBARQ011  
Informações de Balcão



**Histórico de alterações**

Data de atualização	Versão	Informações
12/04/2022	1.0	Divulgação dos atributos do arquivo IMBARQ011 que substituirá a necessidade de consumo dos registros de Balcão do IMBARQ001.

## Sumário

Histórico de alterações.....	2
Sobre o documento.....	4
Sobre o iMercado.....	4
Difusão de Informações: Relatórios Programados.....	4
Proposta dos Relatórios do iMercado.....	4
Tabela resumo das informações dos registros do IMBARQ011.....	5
<i>Layout</i> dos registros do arquivo do IMBARQ.....	6
Header.....	6
Trailer.....	6
Balcão.....	7
Registro 07 - Termo.....	7
Registro 08 - Opções Flexíveis.....	8
Registro 09 - Barreiras Opções Flexíveis.....	9
Registro 10 - Swap.....	9
Registro 11 - Cesta de ações do Swap (SB1 E SB2) - Balcão.....	11
Registro 36 - Posições de Renda Fixa.....	11

## Sobre o documento

Este documento tem a proposta de apresentar, de uma maneira objetiva, o layout do relatório **IMBARQ011 – Informações de Balcão** que substituirá a necessidade de consumo dos registros de Balcão do IMBARQ001. Esse documento contém detalhes dos seguintes processos:

- Termo;
- Opções Flexíveis;
- Barreiras Opções Flexíveis;
- Swap;
- Cesta de ações do Swap (SB1 e SB2) – Balcão, e;
- Posições de Renda Fixa.

## Sobre o iMercado

O iMercado é a rede de troca de informações da B3 que visa disponibilizar informações de listados e balcão, aos clientes que não têm acesso direto aos sistemas core da B3.

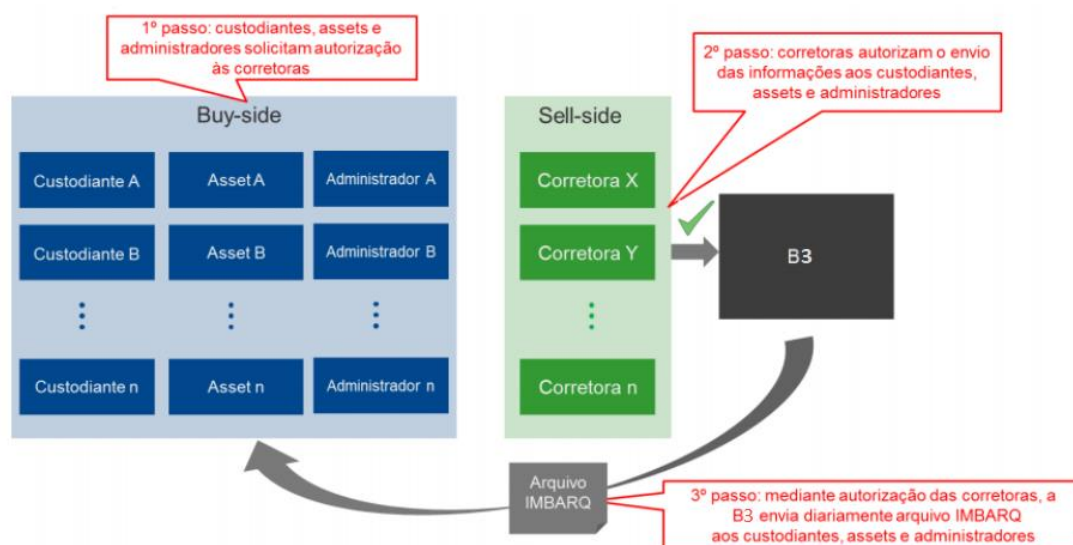
## Difusão de Informações: Relatórios Programados

Os participantes (Custodiantes, Gestores, Administradores, Fundações e Outros) que recebem informações de Corretoras (PNP/PL) podem estar na rede do iMercado para receber informações diretamente da B3, através dos relatórios programados do iMercado.

## Proposta dos Relatórios do iMercado

A fim de agilizar e padronizar a difusão de informações entre os participantes do mercado, a B3 disponibiliza, através do iMercado, relatórios que contenham informações da Câmara (*Clearing*), Depositária Listados e Balcão da B3.

**Modelo do fluxo de solicitação de difusão de informações da B3:**



## Tabela resumo das informações dos registros do IMBARQ011

Bloco de Informação	Registros	Tipo de Informação	Conteúdo
Balcão	07	Termo	Contêm dados do mercado: termo de moedas (84)
	08	Opções Flexíveis	Contêm dados dos mercados: opção flexível de compra (82) e opção flexível de venda (83)
	09	Barreiras Opções Flexíveis	Parâmetros das opções flexíveis (82 e 83)
	10	Swap	Contêm dados do mercado: Swaps negociados em ambiente de Balcão organizado (81)
	11	Cesta de ações do Swap	Parâmetros de contratos específicos de Swap (81)
	36	Renda Fixa	Contêm de posição de renda fixa de balcão de fundos de investimentos

**Layout dos registros do arquivo do IMBARQ**

Abaixo apresentamos os campos por registro:

**Header**

Descrição do Campo	Conteúdo	Tipo	Tamanho	Posição inicial	Posição final
Tipo de registro	Fixo "00"	Número	N(02)	1	2
Nome do arquivo	Ver redefinição abaixo		19		
Código do arquivo	Fixo "IMBARQ011"	Texto	X(09)	3	11
Código da categoria do usuário		Número	N(03)	12	14
Código do usuário	Código do usuário na BVMF	Número	N(07)	15	21
Código da origem	Fixo "BVMF"	Texto	X(08)	22	29
Código do destino	Código do usuário na BVMF	Número	N(15)	30	44
Número do movimento	Sequencial por usuário, atribuído p/ controle dos arquivos gerados	Número	N(09)	45	53
Data da geração do arquivo	Formato = "AAAAMMDD"	Número	N(08)	54	61
Data do movimento	Formato = "AAAAMMDD"	Número	N(08)	62	69
Reserva	Preenchido com brancos	Texto	X(931)	70	1000

**Trailer**

Descrição do Campo	Conteúdo	Tipo	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de registro	Fixo "99"	Número	N(02)	1	2
Nome do arquivo	Ver redefinição abaixo		19		
Código do arquivo	Fixo "IMBARQ011"	Texto	X(09)	3	11
Código da categoria do usuário		Número	N(03)	12	14
Código do usuário	Código do usuário na BVMF	Número	N(07)	15	21
Código da origem	Fixo "BVMF"	Texto	X(08)	22	29
Código do destino	Código do usuário na BVMF	Número	N(15)	30	44
Número do movimento		Número	N(09)	45	53
Data da geração do arquivo	Formato = "AAAAMMDD"	Número	N(08)	54	61
Total de registros gerados		Número	N(09)	62	70
Data do movimento	Formato = "AAAAMMDD"	Número	N(08)	71	78
Reserva	Preenchido com brancos	Texto	X(922)	79	1000

## Balcão

## Registro 07 - Termo

Termo – Balcão	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "07"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado		X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado		X(15)	48	62
Número do contrato		X(35)	63	97
Data da negociação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	98	107
Data do registro	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	108	117
Data de vencimento	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	118	127
Valor da cotação		N(09)V07	128	143
Código da variável	Exemplos: DOL - Dólar comercial REU - Tx. de reais/EUR YDO - JPY X USD	X(12)	144	155
Descrição do código da variável	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	156	215
Código do tipo da variável	Exemplos: T1 - PTAX800 venda T2 - PTAX800 compra	X(02)	216	217
Descrição do tipo da variável	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	218	277
Tamanho base		N(15)V02	278	294
Natureza da posição	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	295	295
Indicador de garantias	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>CollateralIndicator</b>	X(01)	296	296
Código do Negociador Contraparte		X(15)	297	311
Indicador de Garantias da Contraparte	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>CollateralIndicator</b>	X(01)	312	312
Código do Contrato	Exemplos: TMC - Termo tx.cambio TMM - Termo de metal	X(06)	313	318
Reserva	Preenchido com brancos	X(682)	319	1000

## Registro 08 - Opções Flexíveis

Opções – Balcão	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "08"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado		X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado		X(15)	48	62
Número do contrato		X(35)	63	97
Data da negociação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	98	107
Data do registro	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	108	117
Data de vencimento	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	118	127
Código da variável	Exemplos: DOL - Dólar comercial IBV - Ind. BOVESPA IDI - Ind. Taxa DI1	X(12)	128	139
Descrição do código da variável	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	140	199
Código do contrato	Exemplos: FBC - OPC FLEX CP BOV FBP - OPC FLEX VD BOV OFC - OPCAOP FLEX COMP OFV - OPCAOP FLEX VEND	X(06)	200	205
Descrição do código do contrato	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	206	265
Código do tipo da variável	Exemplos: PF - PCO Fechamento PL - PCO Liquidação PM - PCO Médio T1 - PTAX800 venda T2 - PTAX800 compra T3 - PTAX800 media	X(02)	266	267
Descrição do tipo da variável	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	268	327
Tipo da opção	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>OptionStyle</b>	X(01)	328	328
Preço de exercício		N(15)V07	329	350
Descrição do preço de exercício	Vide campo "Tipo de preço de exercício"	X(60)	351	410
Tamanho base		N(15)V02	411	427
Titular/Lançador	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	428	428
Código do Negociador Contraparte		X(15)	429	443
Prêmio unitário		N(15)V07	444	465
Indicador de barreiras	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>BarrierIndicator</b>	X(01)	466	466
Tipo de preço de exercício	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>ExercisePriceType</b>	X(01)	467	467
Indicador de garantias	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>CollateralIndicator</b>	X(01)	468	468
Rebate Unitário		N(15)V07	469	490



Opções – Balcão	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Monitoramento de barreiras	Exemplos: <b>C</b> - Contínuo <b>D</b> - Discreto	X(01)	491	491
Reserva	Preenchido com brancos	X(509)	492	1000

## Registro 09 - Barreiras Opções Flexíveis

Barreiras das Opções – Balcão	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "09"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado		X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado		X(15)	48	62
Número do contrato		X(35)	63	97
Titular/Lançador	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	98	98
Código da barreira	ID – KNOCK IN N DOWN IU – KNOCK IN AND UP OD – KNOCK OUT N DOW OU – KNOCK OUT N UP PB – Barreira limite	X(05)	99	103
Descrição da barreira	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	104	163
Preço da barreira		N(15)V07	164	185
Data de acionamento da barreira (*)	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	186	195
Reserva	Preenchido com brancos	X(805)	196	1000

(\*) Campo informado apenas no caso de o contrato ter atingido a barreira.

## Registro 10 - Swap

Swap - Balcão	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "10"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado - Parte		X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado - Parte		X(15)	48	62
Número do contrato		X(35)	63	97
Data da negociação	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	98	107
Data de registro	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	108	117
Data-base	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	118	127
Data de vencimento	Formato = "AAAA-MM-DD"	X(10)	128	137
Código do tipo da variável - Parte	Exemplos: PF - PCO Fechamento PL - PCO Liquidação PM - PCO Médio T1 - PTAX800 venda T2 - PTAX800 compra T3 - PTAX800 media	X(02)	138	139

Swap - Balcão	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Descrição do tipo da variável - Parte	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	140	199
Código da variável - Parte	Exemplos: DI1 - Taxa do CDI DOL - Dólar comercial IGM - IGP-M	X(12)	200	211
Descrição do código do tipo da variável - Parte	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	212	271
Percentual da variável		N(04)V07	272	282
Tamanho base - Parte		N(15)V02	283	299
Valor atual - Ponta ativa		N(15)V02	300	316
Valor atual - Contraparte		N(15)V02	317	333
Código do tipo da variável - Contraparte	EXEMPLOS: PF - PCO FECHAMENTO PL - PCO LIQUIDACAO PM - PCO MEDIO T1 - PTAX800 VENDA T2 - PTAX800 COMPRA T3 - PTAX800 MEDIA	X(02)	334	335
Descrição do tipo da variável - Contraparte	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	336	395
Código da variável - Contraparte	Exemplos: DI1 - Taxa do CDI DOL - Dólar comercial FGV - FGV 100	X(12)	396	407
Descrição do código da variável - Contraparte	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	408	467
Percentual da variável - Contraparte		N(04)V07	468	478
Código do participante contraparte		X(15)	479	493
Sinal	+ / -	X(01)	494	494
Valor do juros - Parte		N(06)V07	495	507
Indicador de garantias - Parte	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>CollateralIndicator</b>	X(01)	508	508
Indicador de garantias - Contraparte	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>CollateralIndicator</b>	X(01)	509	509
Sinal	+ / -	X(01)	510	510
MtM Fair Value (Diferencial das curvas)	Somente será valorizado quando for SWAP	N(15)V02	511	527
Código do contrato	EXEMPLOS: "SCP" - DOL X PRE "SDC" - DI1 X DOL "SDP" - DI1 X PRE	X(06)	528	533
Sinal	+ / -	X(01)	534	534
Valor do juros - Contraparte		N(06)V07	535	547
Cotação Inicial - Parte		N(06)V07	548	560
Cotação Inicial - Contraparte		N(06)V07	561	573
Data de Cotação - Parte	Para taxa de câmbio, o valor do campo pode ser "D-1" a depender do que foi informado pelo participante no momento do registro do contrato	X(03)	574	576
Data de Cotação - Contraparte	Para taxa de câmbio, o valor do campo pode ser "D-1" a depender do que foi informado pelo participante no momento do registro do contrato	X(03)	577	579
Reserva	Preenchido com brancos	X(421)	574	1000

## Registro 11 - Cesta de ações do Swap (SB1 E SB2) - Balcão

Cesta de ações do Swap (SB1 E SB2) - Balcão	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "11"	N(02)	1	2
Código do Participante Solicitante		X(15)	3	17
Código do Investidor Solicitante		X(15)	18	32
Código do Participante Solicitado - Ponta ativa		X(15)	33	47
Código do Investidor Solicitado - Ponta ativa		X(15)	48	62
Número do contrato		N(35)	63	97
Código da variável	Exemplos: DI1 - Taxa do CDI DOL - Dólar comercial IGM - IGP-M	X(12)	98	109
Descrição do código da variável	Vide conteúdo do campo anterior	X(60)	110	169
Código de negociação		X(12)	170	181
Percentual de participação da ação na carteira		N(10)V02	182	193
Quantidade atualizada da ação		N(22)	195	215
Reserva		X(785)	216	1000

## Registro 36 - Posições de Renda Fixa

Posições de Renda Fixa - Balcão	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "36"	N(02)	1	2
Participante Solicitante		X(15)	3	17
Informação Solicitada/ Código do Participante		X(15)	18	32
Nome Simplificado		X(20)	33	52
Sistema	Fixo "21"	X(02)	53	54
Tipo do Instrumento Financeiro		X(05)	55	59
Instrumento Financeiro		X(20)	60	79
ISIN		X(12)	80	91
Emissor/Registrador		X(40)	92	131
Data de emissão	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	132	141
Data de vencimento	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	142	151
Informação não disponível	Fixo "000000"	X(06)	152	157
FIR		X(11)	158	168
Tipo de posição em custódia	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>OTCCustodyPositionType</b>	X(03)	169	171
Quantidade		N(19)V10	172	200
Valor Nominal		N(19)V10	201	229
P.U. da Curva		N(19)V10	230	258
Data da Curva	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	259	268
Juros vencidos não pagos		N(19)V10	269	297
Juros pro-rata		N(19)V10	298	326
Data de resgate	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	327	336
Condição de Resgate Antecipa	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_ MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>EarlyRedemptionCondition</b>	X(01)	337	337
Data Início de Resgate Antecipado	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	338	347

Posições de Renda Fixa - Balcão	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Regime	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>RegimeType</b>	X(01)	348	348
Eventos Cursados pela Cetip*	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>YesOrNoIndicator</b>	X(01)	349	349
Destinação do Recurso (Lei 12.431)*	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>YesOrNoIndicator</b>	X(01)	350	350
Artigo Lei 12.431	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>TypeOfArticle</b>	X(01)	351	351
Tipo de Emissão	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>CreationType</b>	X(01)	352	352
Reserva	Preenchido com brancos	X(648)	353	1000

\*O indicador pode ser enviado vazio caso não haja a informação do referido campo nos sistemas da B3.



# Fale conosco

✉ Dúvidas podem ser enviadas para [produtoimercado@b3.com.br](mailto:produtoimercado@b3.com.br) ou [liquidacao.imercado@b3.com.br](mailto:liquidacao.imercado@b3.com.br)