

# Serviço iMercado

## Layout do Arquivo IMBARQ008

## Histórico de alterações

Data de atualização	Versão	Informações
28/08/2020	1.0	Versão inicial.

## Sumário

Histórico de alterações.....	2
Sobre o documento.....	3
Proposta do Arquivo do iMercado.....	3
Tabela resumo das informações do registro do IMBARQ008.....	5
Layout dos registros do arquivo do IMBARQ.....	5
Header.....	5
Trailer.....	5
Controle de Posição.....	6
Registro 01 - Posição de derivativos fungíveis.....	6

## Sobre o documento

Este documento tem a proposta de apresentar, de uma maneira objetiva, o layout do Arquivo IMBARQ008, que será disponibilizado no último dia de negociação de Opções sobre Ações, units e cotas de ETF's (terceiras sextas-feiras de cada mês de vencimento) e conterá informações das posições de opções alocadas passíveis de exercício automático para conciliação e tomada de decisões sobre estratégias de Contrary Exercise.

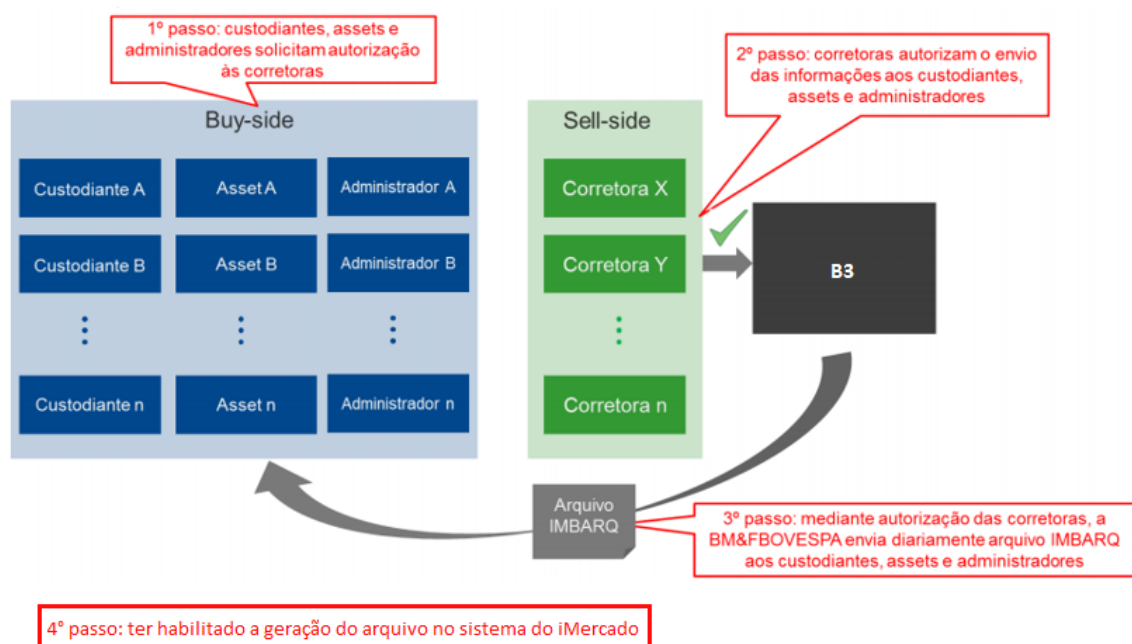
Os participantes que recebem atualmente estas informações da B3 ou de seus participantes (Corretoras, PNP/PL) poderão receber informações unificadas da Clearing Integrada através deste arquivo – para tanto os participantes interessados deverão ser participantes iMercado

## Proposta do Arquivo do iMercado

Para padronizar a troca de informações entre os participantes do mercado, será disponibilizado através do iMercado um arquivo que contém informações da *Clearing* BM&FBovespa.

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:

**Modelo Novo proposto pelo iMercado Módulo arquivos:**



O documento contém detalhes dos seguintes processos:

- Controle de Posição;

## Tabela resumo das informações do registro do IMBARQ008

Bloco de Informação	Registros	Tipo de Informação	Conteúdo
Controle de Posições	01	Derivativos Fungíveis	Contêm dados dos mercados: derivativos futuros (2), opções sobre disponível (3), opções sobre futuro (4), opções de compra ações (70), opções de venda de ações (80) e Swap Cambial com Ajuste Periódico Baseado em Operações Compromissadas de Um Dia (5)

## 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"	Numero	N(02)	1	2
Nome do arquivo	Ver redefinição abaixo		19		
Código do arquivo	Fixo "IMBARQ008"	Texto	X(09)	3	11
Código da categoria do usuário		Numero	N(03)	12	14
Código do usuário	Código do usuário na BVMF	Numero	N(07)	15	21
Código da origem	Fixo "BVMF"	Texto	X(08)	22	29
Código do destino	Código do usuário na BVMF	Numero	N(15)	30	44
Número do movimento	Seqüencial por usuário, atribuído p/ controle dos arquivos gerados	Numero	N(09)	45	53
Data da geração do arquivo	Formato = "AAAAMMDD"	Numero	N(08)	54	61
Data do movimento	Formato = "AAAAMMDD"	Numero	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"	Numero	N(02)	1	2
Nome do arquivo	Ver redefinição abaixo		19		
Código do arquivo	Fixo "IMBARQ008"	Texto	X(09)	3	11
Código da categoria do usuário		Numero	N(03)	12	14
Código do usuário	Código do usuário na BVMF	Numero	N(07)	15	21
Código da origem	Fixo "BVMF"	Texto	X(08)	22	29
Código do destino	Código do usuário na BVMF	Numero	N(15)	30	44
Número do movimento		Numero	N(09)	45	53
Data da geração do arquivo	Formato = "AAAAMMDD"	Numero	N(08)	54	61
Total de registros gerados		Numero	N(09)	62	70
Data do movimento	Formato = "AAAAMMDD"	Numero	N(08)	71	78
Reserva	Preenchido com brancos	Texto	X(922)	79	1000

## Controle de Posição

### Registro 01 - Posição de derivativos fungíveis

Posição de Derivativos Fungíveis	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Registro	Fixo "01"	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
Código Instrumento	Security ID	X(35)	63	97
Código Origem Identificação Instrumento	Security Source	X(35)	98	132
Código Bolsa Valor	Security Exchange	X(04)	133	136
Código de Negociação		X(35)	137	171
ISIN		X(12)	172	183
Mercado	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>MarketType</b>	N(03)	184	186
Lote Padrão/Tamanho do contrato		N(05)V05	187	196
Mercadoria		X(30)	197	226
Código de Vencimento		X(04)	227	230
Indicador Tipo de série	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>ExpirationIndicatorTypeCode</b>	N(10)	231	240
Distribuição da opção		N(10)	241	250
ISIN do Ativo Objeto		X(12)	251	262
Distribuição do ativo-objeto		N(10)	263	272
Preço de Exercício		N(19)V07	273	298

Posição de Derivativos Fungíveis	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Tipo de Opção	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>OptionType</b>	X(01)	299	299
Fator de cotação		N(10)	300	309
Estilo de Opção	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>OptionStyle</b>	X(01)	310	310
Data de Vencimento	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	311	320
Data da Posição	FORMATO = "AAAA-MM-DD"	X(10)	321	330
Natureza Posição Inicial	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	331	331
Valor Posição Inicial		N(15)	332	346
Natureza Posição Vencida	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	347	347
Valor Posição Vencida		N(15)	348	362
Natureza Posição Encerrada por Exercício	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	363	363
Valor Posição Encerrada por Exercício		N(15)	364	378
Quantidade Comprada no Dia		N(15)	379	393
Quantidade Vendida no Dia		N(15)	394	408
Natureza Posição Enviada por Transferência	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	409	409
Valor Posição Enviada por Transferência		N(15)	410	424
Posição Comprada Recebida por Transferência		N(15)	425	439
Posição Vendida Recebida por Transferência		N(15)	440	454
Natureza Posição Encerrada por Entrega Física	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	455	455
Valor Posição Encerrada por Entrega Física		N(15)	456	470
Natureza Posição Atual	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	471	471
Valor Posição Atual		N(15)	472	486
Posição Comprada Bloqueada por Exercício		N(15)	487	501
Natureza Posição Atual após eventos corporativos	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	502	502

Posição de Derivativos Fungíveis	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
Posição atual após eventos corporativos		N(15)	503	517
Posição Coberta Vendida		N(15)	518	532
Posição Descoberta Vendida		N(15)	533	547
Posição BOX		N(15)	548	562
Natureza Posição Encerrada	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>Side</b>	X(01)	563	563
Valor Posição Encerrada		N(15)	564	578
Valor Posição Comprada Atual		N(18)V02	579	598
Valor Posição Vendida Atual		N(18)V02	599	618
Natureza Ajuste Diário	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	619	619
Valor Ajuste Diário		N(18)V02	620	639
Natureza Ajuste Diário Relacionado à Posição Inicial	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	640	640
Valor Ajuste Diário Relacionado à Posição Inicial		N(18)V02	641	660
Natureza Ajuste Diário Referente à Posição Recebida por Transferência	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	661	661
Posição Ajuste Diário Referente à Posição Recebida por Transferência		N(18)V02	662	681
Natureza Ajuste Diário Relacionado aos Negócios do Dia	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	682	682
Valor Ajuste Diário Relacionado aos Negócios do Dia		N(18)V02	683	702
Natureza Ajuste Acumulado	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	703	703
Valor Ajuste Acumulado		N(18)V02	704	723
Natureza Ajuste Acumulado Aplicado sobre a Posição Encerrada	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	724	724
Valor Ajuste Acumulado Aplicado sobre a Posição Encerrada		N(18)V02	725	744
Natureza Prêmio de Opção	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	745	745
Valor Prêmio de Opção		N(18)V02	746	765
Código Variável Valor Final		X(06)	766	771
Natureza Valor Consolidado de Negócios do Dia - Variável Valor Final	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	772	772



Posição de Derivativos Fungíveis	Observação	Tamanho	Posição Inicial	Posição Final
	MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>			
Valor Consolidado de Negócios do Dia - Variável Valor Final		N(16)V07	773	795
Natureza Valor Recebido por Transferência no Dia - Variável Valor Final	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	796	796
Valor Recebido por Transferência no Dia - Variável Valor Final		N(16)V07	797	819
Natureza Valor Enviado por Transferência no Dia - Variável Valor Final	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	820	820
Valor Enviado por Transferência no Dia - Variável Valor Final		N(16)V07	821	843
Natureza Posição Atualizada do Dia - Variável Valor Final	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	844	844
Valor Posição Atualizada do Dia - Variável Valor Final		N(16)V07	845	867
Instrumento do Cupom		X(03)	868	870
Natureza Valor Consolidado de Negócios do Dia - Variável Cupom	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	871	871
Valor Consolidado de Negócios do Dia - Variável Cupom		N(16)V07	872	894
Natureza Valor Recebido por Transferência no Dia - Variável Cupom	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	895	895
Valor Recebido por Transferência no Dia - Variável Cupom		N(16)V07	896	918
Natureza Valor Enviado por Transferência no Dia - Variável Cupom	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	919	919
Valor Enviado por Transferência no Dia - Variável Cupom		N(16)V07	920	942
Natureza Posição Atualizada do Dia - Variável Cupom	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	943	943
Valor Posição Atualizada do Dia - Variável Cupom		N(16)V07	944	966
Natureza Valor de Liquidação	Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: <b>LaunchType</b>	X(01)	967	967
Valor de Liquidação		N(18)V02	968	987
Reserva	PREENCHIDO COM BRANCOS	X(13)	988	1000