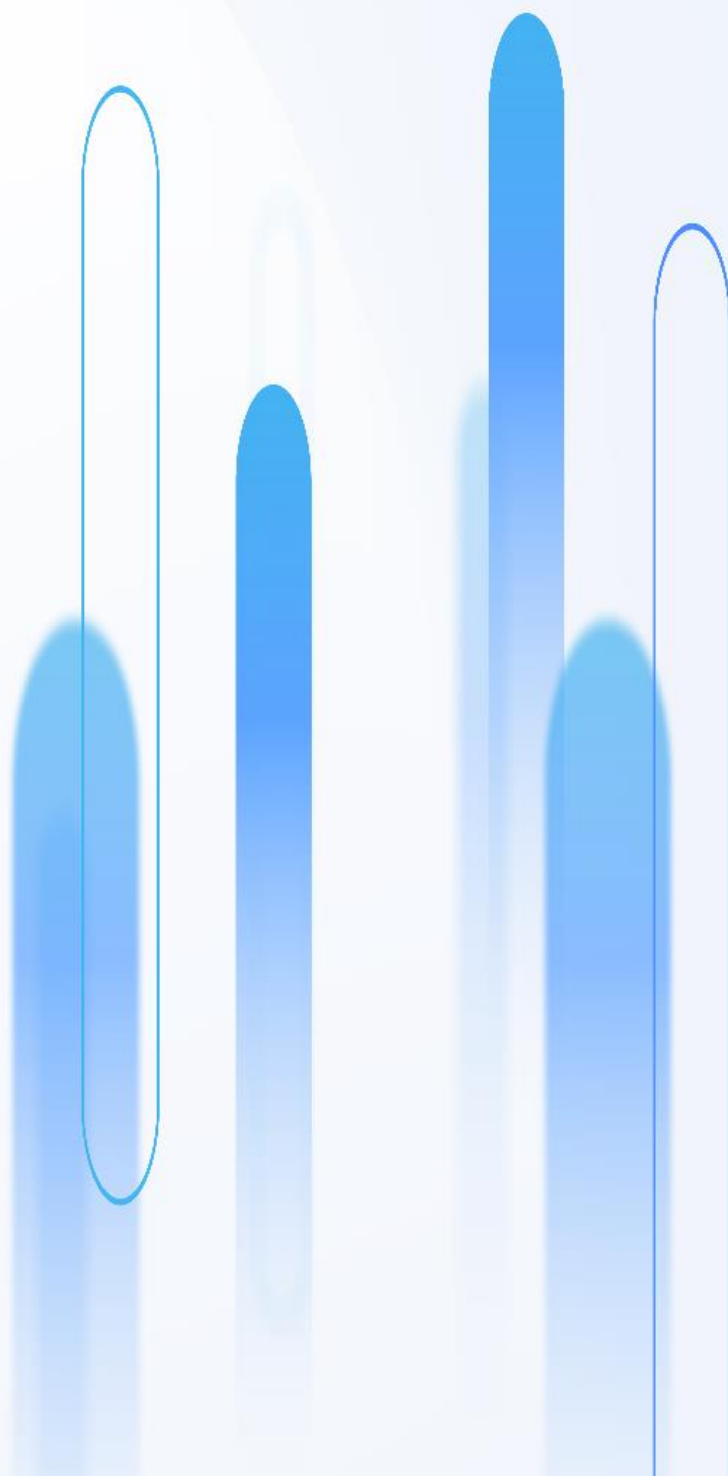


Serviço iMercado
Layout do Relatório IMBARQ014
Informações de Garantias



Histórico de alterações

| Data de atualização | Versão | Informações |
|---------------------|--------|--|
| 08/04/2022 | 1.0 | Divulgação dos atributos do Arquivo do IMBARQ014 que substituirá a necessidade de consumo dos registros de administração de colaterais 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 IMBARQ014..... | 5 |
| <i>Layout</i> dos registros do arquivo do IMBARQ..... | 6 |
| Header..... | 6 |
| Trailer..... | 6 |
| Administração de Colaterais..... | 6 |
| Registro 18 - Garantias aportadas..... | 7 |
| Registro 31 - Detalhes das Informações de Ações e Ouro da Carteira de Garantias nos Custodiantes..... | 8 |
| Registro 19 - Margem Requerida..... | 9 |

Sobre o documento

Este documento tem a proposta de (i) apresentar, de uma maneira objetiva, o layout do relatório **IMBARQ014 – Informações de Garantias** que substituirá a necessidade de consumo dos registros de administração de colaterais do IMBARQ001. Esse documento contém detalhes dos seguintes processos:

- Garantias depositadas; e
- Chamada de margem.

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:

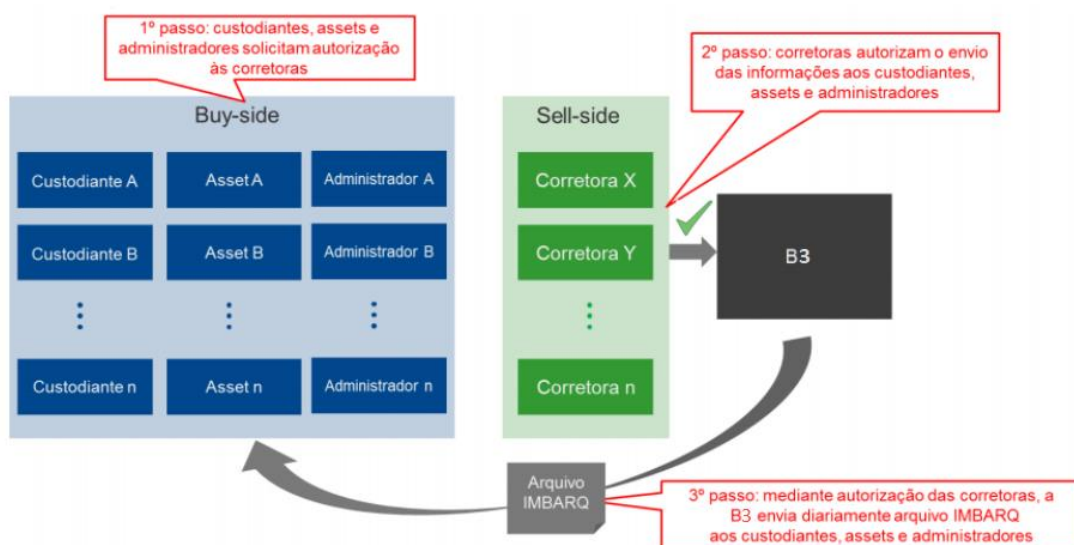


Tabela resumo das informações dos registros do IMBARQ014

| Bloco de Informação | Registros | Tipo de Informação | Conteúdo |
|-----------------------------|-----------|--|---|
| Administração de Colaterais | 18 | Garantias aportadas | Contêm os dados das garantias depositadas em um PNP/PL |
| | 31 | Detalhes das Informações de Ações e Ouro da Carteira de Garantias nos Custodiantes | Contêm os detalhes dos ativos da carteira de garantias dos Custodiantes |
| | 19 | Margem requerida | Fornece o saldo de garantias em um PNP/PL |

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 "IMBARQ014" | 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 | Sequencial por usuário, atribuído p/ controle dos arquivos gerados | Numero | N(09) | 45 | 53 |
| Data da geração do arquivo | Formato = "AAAAMDD" | Numero | N(08) | 54 | 61 |
| Data do movimento | Formato = "AAAAMDD" | 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 "IMBARQ014" | 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 = "AAAAMDD" | Numero | N(08) | 54 | 61 |
| Total de registros gerados | | Numero | N(09) | 62 | 70 |
| Data do movimento | Formato = "AAAAMDD" | Numero | N(08) | 71 | 78 |
| Reserva | Preenchido com brancos | Texto | X(922) | 79 | 1000 |

Administração de Colaterais

Registro 18 - Garantias aportadas

| Garantias aportadas | Observação | Tamanho | Posição Inicial | Posição Final |
|---|--|----------|-----------------|---------------|
| Tipo de Registro | Fixo "18" | N(02) | 1 | 2 |
| Código do Participante Solicitante | | X(15) | 3 | 17 |
| Código do Investidor Solicitante | | X(15) | 18 | 32 |
| Código do Participante Solicitado | Este campo conterá informações do Código do Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação | X(15) | 33 | 47 |
| Código do Investidor Solicitado | Este campo conterá informações do Código do Investidor no Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação | X(15) | 48 | 62 |
| Data Referência | Formato = "AAAA-MM-DD" | X(10) | 63 | 72 |
| Código do tipo da garantia | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: CollateralType | X(04) | 73 | 76 |
| Código Instrumento | Security ID | X(35) | 77 | 111 |
| Código Origem Identificação Instrumento | Security Source | X(35) | 112 | 146 |
| Código Bolsa Valor | Security Exchange | X(04) | 147 | 150 |
| Finalidade de Cobertura | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: CollateralCoverageType | N(04) | 151 | 154 |
| Código Categoria Titular (MC, PNP, PL e CL) | | X(04) | 155 | 158 |
| Identificador de garantias | | X(20) | 159 | 178 |
| Número Garantia | | N(19) | 179 | 197 |
| Identificador de cobertura S/N* | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator | X(01) | 198 | 198 |
| Indicador Titularidade (S/N)* | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator | X(01) | 199 | 199 |
| Data de vencimento | Formato = "AAAA-MM-DD" | X(10) | 200 | 209 |
| Quantidade Depositada | | N(18)V10 | 210 | 237 |
| Quantidade Aceita | | N(18)V10 | 238 | 265 |
| Quantidade Valorizada | | N(09)V10 | 266 | 284 |
| Quantidade Distribuída | | N(09)V10 | 285 | 303 |
| Quantidade Bloqueada | | N(09)V10 | 304 | 322 |
| ISIN | | X(12) | 323 | 334 |
| Carteira | | X(10) | 335 | 344 |
| Valor Garantias | | N(19)V02 | 345 | 365 |
| Valor Bloqueado para Retirada | | N(11)V10 | 366 | 386 |
| Código do Custodiante | | X(15) | 387 | 401 |
| Código do Investidor no Custodiante | | X(15) | 402 | 416 |
| Reserva | Preenchido com brancos | X(584) | 417 | 1000 |

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

Registro 31 - Detalhes das Informações de Ações e Ouro da Carteira de Garantias nos Custodiantes

| Detalhes da Carteira de Garantias | Observação | Tamanho | Posição Inicial | Posição Final |
|--|--|----------|-----------------|---------------|
| Tipo de Registro | Fixo "31" | N(02) | 1 | 2 |
| Código do Participante Solicitante | | X(15) | 3 | 17 |
| Código do Investidor Solicitante | | X(15) | 18 | 32 |
| Código do Participante Solicitado | Este campo conterá informações do Código do Custodiante | X(15) | 33 | 47 |
| Código do Investidor Solicitado | Este campo conterá informações do Código do Investidor no Custodiante | X(15) | 48 | 62 |
| Data Referência | Formato = "AAAA-MM-DD" | X(10) | 63 | 72 |
| Código do tipo da garantia | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: CollateralType | X(04) | 73 | 76 |
| Código Instrumento | Security ID | X(35) | 77 | 111 |
| Código Origem Identificação Instrumento | Security Source | X(35) | 112 | 146 |
| Código Bolsa Valor | Security Exchange | X(04) | 147 | 150 |
| Finalidade de Cobertura | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: CollateralCoverageType | N(04) | 151 | 154 |
| Código Categoria Titular (MC, PNP, PL e CL) | | X(04) | 155 | 158 |
| Identificador de garantias | | X(20) | 159 | 178 |
| Número Garantia | | N(19) | 179 | 197 |
| Identificador de cobertura S/N* | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator | X(01) | 198 | 198 |
| Indicador Titularidade (S/N)* | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator | X(01) | 199 | 199 |
| Data de vencimento | Formato = "AAAA-MM-DD" | X(10) | 200 | 209 |
| Quantidade Depositada | | N(18)V10 | 210 | 237 |
| Quantidade Aceita | | N(18)V10 | 238 | 265 |
| Quantidade Valorizada | | N(09)V10 | 266 | 284 |
| Quantidade Distribuída | | N(09)V10 | 285 | 303 |
| Quantidade Bloqueada | | N(09)V10 | 304 | 322 |
| ISIN | | X(12) | 323 | 334 |
| Carteira | | X(10) | 335 | 344 |
| Valor Garantias | | N(19)V02 | 345 | 365 |
| Valor Bloqueado para Retirada | | N(11)V10 | 366 | 386 |
| Código do Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação | | X(15) | 387 | 401 |
| Código do Investidor no Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação | | X(15) | 402 | 416 |
| Reserva | Preenchido com brancos | X(584) | 417 | 1000 |

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

Registro 19 - Margem Requerida

| Margem Requerida | Observação | Tamanho | Posição Inicial | Posição Final |
|------------------------------------|--|----------|-----------------|---------------|
| Tipo de Registro | Fixo "19" | N(02) | 1 | 2 |
| Código do Participante Solicitante | | X(15) | 3 | 17 |
| Código do Investidor Solicitante | | X(15) | 18 | 32 |
| Código do Participante Solicitado | | X(15) | 33 | 47 |
| Código do Investidor Solicitado | | X(15) | 48 | 62 |
| Data de Movimento | Formato = "AAAA-MM-DD" | X(10) | 63 | 72 |
| Finalidade de Cobertura | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: CollateralCoverageType | N(04) | 73 | 76 |
| Sinal | +/- | X(01) | 77 | 77 |
| Risco sem garantias | | N(17)V02 | 78 | 96 |
| Chamada de Margem Inicial | | N(17)V02 | 97 | 115 |
| Valor da Margem Adicional | | N(19)V07 | 116 | 141 |
| Valor Total das Garantias | | N(17)V02 | 142 | 160 |
| Perdas Permanentes | | N(19)V07 | 161 | 186 |
| Perdas Transitórias | | N(19)V07 | 187 | 212 |
| Sinal | +/- | X(01) | 213 | 213 |
| Saldo de Garantias | | N(17)V02 | 214 | 232 |
| Reserva | Preenchido com brancos | X(768) | 233 | 1000 |



Fale conosco

✉ Dúvidas podem ser enviadas para produtoimercado@b3.com.br ou liquidacao.imercado@b3.com.br