



Layout do Arquivo do IMBARQ002

Data: 05/04/2023

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

Histórico de alterações

| Data de atualização | Versão | Informações |
|---------------------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 23/12/2015 | 1.0 | Divulgação dos atributos do Arquivo do IMBARQ002 (<i>intraday</i>) que substituirá dados de liquidação de ativos de relatórios COLD. |
| 18/07/2016 | 1.1 | <p>Alteração do conteúdo dos campos abaixo relacionados:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Tipo Liquidação • Natureza da Operação • Tipo de restrição • Situação do resultado • Delivery Restricted on Position Account level • Delivery Restricted on TP/DP level true or false • Delivery Restricted on CM level <p>Alteração dos tamanhos dos campos abaixo relacionados de N(19) para N(13)V06:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Quantidade Total da Instrução de Liquidação • Quantidade Liquidada • Quantidade Não Liquidada • Quantidade para ser liquidada • Quantidade aceita pelo Custodiante • Quantidade Restringível • Quantidade da falha |
| 24/10/2020 | 1.2 | <p>Registro 50:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Alteração do campo "Informação adicional" de X(05) para X(35); • Inclusão dos campos "Conta Selic", "Vencimento do Título", "Código Identificador do Título na Selic"; • Alteração do campo "Reserva" de X(434) para X(379) |
| 17/03/2021 | 1.3 | <p>Registro 50:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Inclusão do campo "Prazo de liquidação" e alteração do campo reserva de "Reserva" de X(379) para X(378); • Criação do ExternalCodeList SettlementGroup; |
| 21/07/2021 | 1.4 | <p>Registro 50:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Inclusão do campo "Tipo de Resultado Líquido" e alteração do campo reserva de "Reserva" de X(378) para X(377); |
| 05/04/2023 | 1.4.1 | Alteração na definição do campo "Prazo de Liquidação" para associá-lo ao SettlementTime. |



Sumário

| | |
|----------------------------------------------------------------------------------|---|
| Histórico de alterações..... | 2 |
| Sobre o documento..... | 4 |
| Proposta do Arquivo do IMBARQ002..... | 4 |
| Tabela resumo das informações a serem alteradas nos registros do IMBARQ002 | 5 |
| <i>Layout</i> dos registros do arquivo do IMBARQ002 – Liquidação de Ativos..... | 6 |
| Header | 6 |
| Trailer | 6 |
| Liquidação de Ativos | 7 |
| Registro 50 – Detalhes das instruções de liquidadas..... | 7 |

Sobre o documento

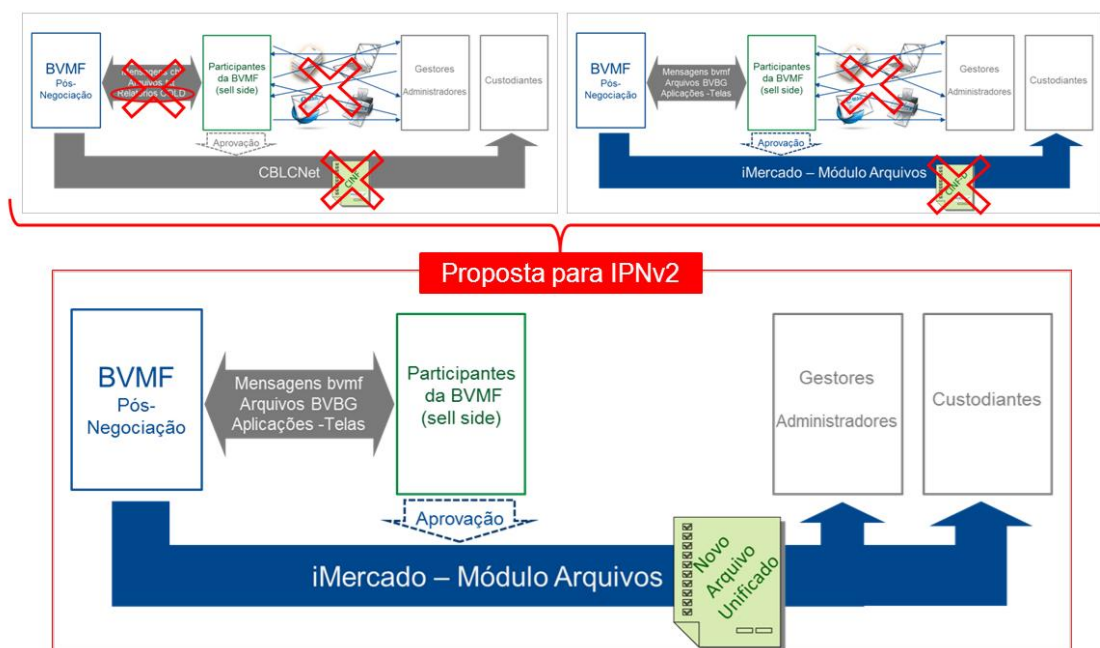
Este documento tem a proposta de (i) apresentar, de uma maneira objetiva, o layout do Arquivo do IMBARQ002 que substituirá informações de relatórios COLD (câmara CBLC) para liquidação de ativos intradiários.

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

Proposta do Arquivo do IMBARQ002

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

Nota-se que participantes *Buy-Side* recebem informações de diferentes segmentos de diversas maneiras e formatos. A proposta do arquivo é unificar as informações dos participantes do iMercado e disponibilizar diretamente os dados da Câmara, como se pode observar no fluxo abaixo:



O documento contém detalhes dos seguintes processos:

- Liquidação de ativos.



Tabela resumo das informações a serem alteradas nos registros do IMBARQ002

| Bloco de Informação | Registros | Tipo de Informação | Conteúdo |
|----------------------|-----------|--------------------------------|-------------------------------------------------------|
| Liquidação de Ativos | 50 | Resultados líquidos liquidados | Contêm dados dos resultados das liquidações em ativos |



Layout dos registros do arquivo do IMBARQ002 – Liquidação de Ativos

Abaixo apresentamos os campos por registro:

Header

| Descrição do Campo | Conteúdo | Tamanho | Posição inicial | Posição final |
|--------------------------------|--------------------------------------------------------------------|---------|-----------------|---------------|
| TIPO DE REGISTRO | FIXO "00" | N(02) | 1 | 2 |
| NOME DO ARQUIVO | VER REDEFINIÇÃO ABAIXO | X(17) | | |
| CÓDIGO DO ARQUIVO | FIXO "IMBARQ002" | X(09) | 3 | 11 |
| CÓDIGO DA CATEGORIA DO USUÁRIO | | N(03) | 12 | 14 |
| CÓDIGO DO USUÁRIO | CÓDIGO DO USUÁRIO NA BVMF | N(05) | 15 | 19 |
| CÓDIGO DA ORIGEM | FIXO "BVMF" | X(08) | 20 | 27 |
| CÓDIGO DO DESTINO | CÓDIGO DO USUÁRIO NA BVMF | N(15) | 28 | 42 |
| NÚMERO DO MOVIMENTO | SEQUENCIAL POR USUÁRIO, ATRIBUÍDO P/ CONTROLE DOS ARQUIVOS GERADOS | N(09) | 43 | 51 |
| DATA DA GERAÇÃO DO ARQUIVO | FORMATO = "AAAAMMDD" | N(08) | 52 | 59 |
| DATA DO MOVIMENTO | FORMATO = "AAAAMMDD" | N(08) | 60 | 67 |
| RESERVA | PREENCHIDO COM BRANCOS | X(933) | 68 | 1000 |

Trailer

| Descrição do Campo | Conteúdo | Tamanho | Posição Inicial | Posição Final |
|--------------------------------|---------------------------|---------|-----------------|---------------|
| TIPO DE REGISTRO | FIXO "99" | N(02) | 1 | 2 |
| NOME DO ARQUIVO | VER REDEFINIÇÃO ABAIXO | X(17) | | |
| CÓDIGO DO ARQUIVO | FIXO "IMBARQ002" | X(09) | 3 | 11 |
| CÓDIGO DA CATEGORIA DO USUÁRIO | | N(03) | 12 | 14 |
| CÓDIGO DO USUÁRIO | CÓDIGO DO USUÁRIO NA BVMF | N(05) | 15 | 19 |
| CÓDIGO DA ORIGEM | FIXO "BVMF" | X(08) | 20 | 27 |
| CÓDIGO DO DESTINO | CÓDIGO DO USUÁRIO NA BVMF | N(15) | 28 | 42 |
| NÚMERO DO MOVIMENTO | | N(09) | 43 | 51 |
| DATA DA GERAÇÃO DO ARQUIVO | FORMATO = "AAAAMMDD" | N(08) | 52 | 59 |
| TOTAL DE REGISTROS GERADOS | | N(09) | 60 | 68 |
| DATA DO MOVIMENTO | FORMATO = "AAAAMMDD" | N(08) | 69 | 70 |
| RESERVA | PREENCHIDO COM BRANCOS | X(930) | 71 | 1000 |



Liquidação de Ativos

Registro 50 – Detalhes das instruções de liquidadas

| Descrição do Campo | Conteúdo | Tamanho | Posição Inicial | Posição Final |
|---------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------|---------------|
| Tipo de Registro | Fixo "50" | N(02) | 1 | 2 |
| Código do Participante Solicitante | | X(15) | 3 | 17 |
| Código do Investidor Solicitante | | X(15) | 18 | 32 |
| Código do Participante Solicitado | | X(15) | 33 | 47 |
| Código do Investidor Solicitado | | X(15) | 48 | 62 |
| Data do Pregão | FORMATO = "AAAA-MM-DD" | X(10) | 63 | 72 |
| Data de Liquidação | FORMATO = "AAAA-MM-DD" | X(10) | 73 | 82 |
| Tipo Liquidação | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: SettlementType | N(10) | 83 | 92 |
| Número de Instrução de Liquidação | | X(64) | 93 | 156 |
| Número de Instrução Liquidação Original | | X(64) | 157 | 220 |
| Carteira | | N(10) | 221 | 230 |
| ISIN | | X(12) | 231 | 242 |
| Distribuição do ISIN | | N(10) | 243 | 252 |
| Natureza da Operação | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: LaunchType | X(01) | 253 | 253 |
| Preço Médio de Referência | | N(23)V07 | 254 | 283 |
| Quantidade Total da Instrução de Liquidação | | N(13)V06 | 284 | 302 |
| Volume Total da Instrução de Liquidação | | N(23)V07 | 303 | 332 |
| Tipo de restrição | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: RestrictionType | X(02) | 333 | 334 |
| Situação do resultado | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: NetSettlementResultStatus | X(05) | 335 | 339 |
| Quantidade Liquidada | | N(13)V06 | 340 | 358 |
| Volume financeiro liquidado | | N(23)V07 | 359 | 388 |
| Quantidade Não Liquidada | | N(13)V06 | 389 | 407 |
| Volume financeiro não liquidado | | N(23)V07 | 408 | 437 |
| Quantidade para ser liquidada | | N(13)V06 | 438 | 456 |
| Volume financeiro para ser liquidado | | N(23)V07 | 457 | 486 |
| Quantidade aceita pelo Custodiante | | N(13)V06 | 487 | 505 |

| | | | | |
|--------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----|------|
| Quantidade Restringível | | N(13)V06 | 506 | 524 |
| Delivery Restricted on Position Account level | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator | X(01) | 525 | 525 |
| Delivery Restricted on TP/DP level true or false | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator | X(01) | 526 | 526 |
| Delivery Restricted on CM level | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: YesOrNoIndicator | X(01) | 527 | 527 |
| Quantidade da falha | | N(13)V06 | 528 | 546 |
| Fallback Settlement Account | | X(15) | 547 | 561 |
| Informação adicional | Informa o Lote do ETF ou o número de contrato do Empréstimo de Títulos Públicos Federais | X(35) | 562 | 596 |
| Conta Selic | | X(09) | 597 | 605 |
| Vencimento do Título | Formato = "AAAA-MM-DD" | X(10) | 606 | 615 |
| Código Identificador do Título na Selic | | X(06) | 616 | 621 |
| Prazo de liquidação | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: SettlementTime | X(01) | 622 | 622 |
| Tipo de Resultado Líquido | Os domínios deste campo estão no documento no documento ExternalCodeList_iMercado_MóduloArquivos.xls - Tabela: NettingType | X(01) | 623 | 623 |
| Reservado | PREENCHIDO COM BRANCOS | X(377) | 624 | 1000 |