



Definition – Message Catalogue

Date: Apr. 25, 2019

iMercado - Capture, Allocation and Give-up

iMercado – Capture, Allocation and Give-Up

Message Definitions Report

This document describes a series of message definitions developed by B3 to be used in the Capture, Allocation and Give-up flows of iMercado.



Change Log

Date	Version	Description	Responsible
Nov. 30, 2015	1.0	First Draft	
Feb. 15, 2016	1.1	1. SUPL.500.01 – Inclusion of the attribute in the message and modification of the type of ExternalStrategyTypeCode. 2. imb.509.01 – modification of the type of ExternalStrategyTypeCode.	
Apr. 15, 2016	1.2	Modification of imb.504.01 – modification of the cardinality of the attribute and relationships and English/Portuguese description change. Modification of the Data type in the imb.508.01 e imb.509.01 messages	
May 02, 2016	1.3	Exclusion of imb.500.01 in the Exclusion flow of the sub-account allocation.	
Nov. 16, 2016	1.4	Inclusion of attributes in imb.508.01.	
Apr. 10, 2017	1.5	Modification to imb.500.01, SUPL.500.01, imb.502.01, imb.503.01, imb.504.01, imb.505.01, imb.506.01, imb.507.01, imb.508.01, imb.509.01 and imb.510.01	
Jul. 13, 2018	1.6	Creation of imb.521.01, imb.522.01 messages. Modification to imb.504.	
Jul. 24, 2018	1.6	Inclusion of the Data Type Details information column in all the messages.	
Sep. 06, 2018	1.7	Modifications to the SUPL.500.01, imb.504.01, imb.507.01, imb.508.01, imb.509.01 and imb.522.01 messages	
Nov. 11, 2018	1.8	Modifications to the imb.521.01	
Feb. 14, 2019	1.9	Modifications to the imb.504.01	
Apr. 25, 2019	1.10	Modifications to the imb.504.01	

Detailed description in the “Change Log” document.



Schema Version

This catalogue version encompasses the XSD schema versions below.

Message Name	XSD Schema Version
imb.500.01	1.1
SUPL.500.01	1.3
imb.501.01	1.0
imb.502.01	1.1
imb.503.01	1.1
imb.504.01	1.6
imb.505.01	1.1
imb.506.01	1.1
SUPL.506.01	1.0
imb.507.01	1.2
imb.508.01	1.4
imb.509.01	1.4
imb.510.01	1.1
imb.521.01	1.1
imb.522.01	1.1



Content

Change Log	2
Schema Version	3
Overview	10
<i>Scope</i>	10
<i>Message List</i>	10
<i>How to Read</i>	13
Message Flows	14
<i>Sends Executed Trade</i>	14
Introduction.....	14
Scenario 1: Full Trading Participant Sends Executed Trade	14
<i>Sends Cancelled Trade</i>	16
Introduction.....	16
Scenario 1: Full Trading Participant or Settlement Participant Sends Cancelled Trade	16
<i>Trade Acceptance or Rejection</i>	17
Introduction.....	17
Scenario 1: Manager accepts notification of executed trade.....	17
Scenario 2: Manager rejects notification of executed trade	18
<i>Allocation Entry by Trade</i>	19
Introduction.....	19
Scenario1: Manager requests Allocation Entry by Trade – successful	19



Scenario 2: Manager requests Allocation Entry by Trade – with error at the Clearinghouse 21

Scenario 3: Manager requests allocation entry by trade – with error in the Participant’s system..... 22

Allocation Entry by Lot..... 23

 Introduction..... 23

 Scenario 1: Manager requests Allocation Entry by Lot – successful 23

 Scenario 2: Manager requests allocation entry by lot – with error at the Clearinghouse 25

 Scenario 3: Manager requests allocation entry by lot – with error in the Participant’s system 26

Allocation Exclusion 27

 Introduction..... 27

 Scenario 1: Manager requests allocation exclusion of Master account – successful..... 27

 Scenario 2: Manager requests Sub-account allocation exclusion – successful 29

 Scenario 3: Manager requests allocation exclusion – with error at the Clearinghouse..... 31

 Scenario 4: Manager requests allocation exclusion – with error in the Participant’s system 32

Sends Brokerage Bill 33

 Introduction..... 33

 Scenario 1: Sends Brokerage Bill 33

Sends Net Settlement by Trade..... 34

 Introduction..... 34

 Scenario 1: Sends net settlement..... 34

Sends Gross Settlement 36

 Introduction..... 36

 Scenario 1: Sends gross settlement..... 36

Sends Allocation Entry Preview..... 37

 Introduction..... 38

 Scenario 1: Manager requests allocation preview validation – successful 38



Scenario 2: Manager requests allocation preview validation – with error 39

Message Flow – Give-up.....40

Trade give-up..... 40

 Introduction..... 40

 Scenario1: Sends trade give-up executed, pending acceptance or rejection by the Manager 40

Give-up Accepted or Rejected..... 41

 Introduction..... 41

 Scenario 1: Give-up actively accepted..... 41

Sending a give-up in the allocation entry 44

 Scenario 1: Manager requests allocation entry with give-up - accepted 44

 Scenario 2: Manager requests allocation entry with give-up - rejected 46

Message Flow - Primary ETF.....48

Sends executed Payment/Redemption of (Primary EFT) shares 48

 Introduction..... 48

 Scenario1: Full Trading Participant or Settlement Participant sends ETF trade executed in the Primary Market..... 48

Primary ETF trade give-up 50

 Introduction..... 50

 Scenario1: Sends Primary ETF trade give-up - (pending acceptance or rejection by the Manager) 50

Give-up acceptance or rejection 52

 Introduction..... 52

ETF Price/Settlement update Executed in the Primary Market 55

 Introduction..... 55

 Scenario1: Full Trading Participant or Settlement Participant sends ETF Price/Settlement update Executed in the Primary Market..... 55



Message Flow - Off-Hour Allocation 56

Off-hour trade allocation entry..... 56

 Introduction..... 56

 Scenario 1: Manager requests off-hour allocation entry - accepted by the Clearinghouse..... 56

 Scenario 2: Manager requests off-hour allocation entry - rejected by the Clearinghouse 58

Give-up cancellation 60

 Introduction..... 60

 Scenario 1: Request for off-hour allocation rejection - accepted by the Give-up Participant 60

 Scenario 2: Rejection of off-hour give-up request - rejected by the Give-up Participant 62

imb.500.01 – TradeLegNotification 64

 Message functionality 64

 Rules 64

 Message Structure – TradeLegNotification (imb.500.01) 64

 Supplementary Data - SUPL.500.01 – TradeLegNotificationSD 72

imb.501.01 – TradeNotificationResponse 87

 Message functionality 87

 Rules 87

 Message Structure – TradeNotificationResponse (imb.501.01) 87

imb.502.01 – SecuritiesAllocationInstruction 90

 Message functionality 90

 Rules 90

 Message Structure – SecuritiesAllocationInstruction (imb.502.01) 90



imb.503.01 – SecuritiesLotAllocationInstruction	99
Message functionality	99
Rules	99
Message Structure – SecuritiesLotAllocationInstruction (imb.503.01).....	99
imb.504.01 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice	112
Message functionality	112
Rules	112
Message Structure – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (imb.504.01)	112
imb.505.01 – SecuritiesAllocationInstructionCancellation	123
Message functionality	123
Rules	123
Message Structure – SecuritiesAllocationInstructionCancellation (imb.505.01)	123
imb.506.01 TradeLegNotificationCancellation.....	130
Message functionality	130
Rules	130
Message Structure – TradeLegNotificationCancellation (imb.506.01).....	130
Supplementary Data - SUPL.506.01 – TradeLegNotificationCancellationSD	138
imb.507.01 – InvoiceNotification	142
Message functionality	142
Rules	142
Message Structure – InvoiceNotification (imb.507.01).....	142



imb.508.01 – ETFTradeNotification.....155

- Message functionality 155
- Rules 155
- Message Structure – ETFTradeNotification (imb.508.01) 155

imb.509.01 – InformGiveUpPendingApproval170

- Message functionality 170
- Rules 170
- Message Structure – InformGiveUpPendingApproval (imb.509.01) 170

imb.510.01 – ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection193

- Message functionality 193
- Rules 193
- Message Structure – ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection (imb.510.01) 193

imb.522.01 – SecuritiesAllocatedAmountNotification.....200

- Message functionality 200
- Rules 200
- Message Structure – SecuritiesAllocatedAmountNotification (imb.522.01) 200

imb.521.01 – FinancialValueApprovalResponse211

- Message functionality 211
- Rules 211
- Message Structure – FinancialValueApprovalResponse (imb.521.01) 211



Overview

Scope

This document describes the series of message definitions, which were developed by B3 and will be used in the capture, allocation and trade give-up flows of iMercado.

Trading scenarios have been modeled and a series of XML messages conceived. In due course, these messages will be submitted for approval by the ISO20022 registration body. Each trading scenario is represented by a standard work flow and a fixed number of normalized messages.

Message List

1. TradeLegNotification <imb.500>

The TradeLegNotification message is sent by the Full Trading Participant (FTP) to the Manager via iMercado and provides details of the trades captured in the Participant's system.

2. TradeNotificationResponse <imb.501>

The TradeNotificationResponse message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) to accept/reject trades captured in the Participant's system.



3. SecuritiesAllocationInstruction <imb.502>

The SecuritiesAllocationInstruction is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to request the entry of allocation information by trade (identification of the end customer's account and other information necessary for settlement purposes) and trade give-up.

4. SecuritiesLotAllocationInstruction <imb.503>

The SecuritiesLotAllocationInstruction message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to request the entry of allocation information in a lot (identification of the end customer's account and other information necessary for settlement purposes) and trade give-up.

5. SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504>

The SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado and informs the status of the request executed with gross settlement.

6. SecuritiesAllocationInstructionCancellation <imb.505>

The SecuritiesAllocationInstructionCancellation message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) as a requirement of allocation exclusion.

7. TradeLegNotificationCancellation <imb.506>

The TradeLegNotificationCancellation message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado, notifying it of trade cancellation.

8. InvoiceNotification <imb.507>



The InvoiceNotification message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado and provides details of the brokerage bill, after end-of-day closing executed in the Participant's system.

9. ETFTradeNotification <imb.508>

The ETFTradeNotification message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado and provides details of Primary ETF trades and price/settlement update.

10. InformGiveUpPendingApproval <imb.509>

The InformGiveUpPendingApproval message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado and provides details of take-up trades and give-up pending acceptance/rejection status.

11. ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection <imb.510>

The ResponseGiveupAcceptanceOrRejection message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) via iMercado to accept or reject take-up trades or give-up cancellation.

12. SecuritiesAllocatedAmountNotification <imb.522>

The SecuritiesAllocatedAmountNotification message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado to inform net financial value per trade.

12. FinancialValueApprovalResponse <imb.521>

The FinancialValueApprovalResponse message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) via iMercado to validate the net/gross financial value per trade.



Definition – Message Catalogue

Date: Apr. 25, 2019

iMercado - Capture, Allocation and Give-up

How to Read

Unified Modeling Language (UML) has been used to describe logical and business models. As an understanding of UML is not a requirement for the discussion about business standards, the data format for messages is presented in a friendlier way. This manner of representation is generated automatically from models, thus assuring that the model's information is absolutely congruent with the published rule.



Message Flows

Sends Executed Trade

Introduction

This flow illustrates the use of the TradeLegNotification message in typical sequential scenarios to notify the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) of a trade executed in a Master account or Sub-account in the Participant's system.

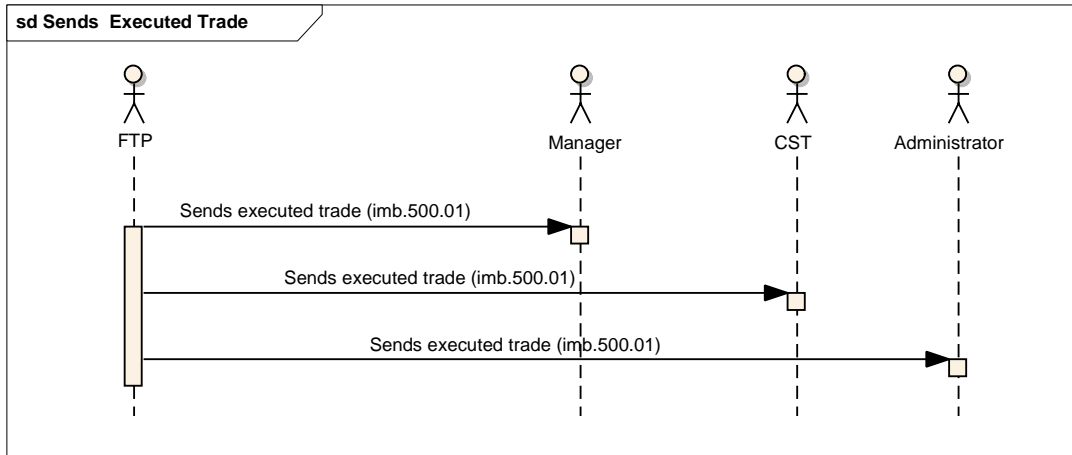
Notification of an executed trade will occur through the following trade processes in the Clearinghouse:

1. Trade capture by the Participant's system directly in the Master account or Final account;
2. Allocation entry by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) through an account in its own name to the Master account or Sub-Account (e.g. entry of Capture account allocation to the Master account);
3. Trade capture by the Participant's system directly in the Master account or Final account with a give-up link (Give-up participant).

Scenario 1: Full Trading Participant Sends Executed Trade

This is the most basic and elementary scenario for notifying the Manager, Custodian and/or Administrator of the execution of a trade in the Participant's system.

- The Full Trading Participant sends the TradeLegNotification <imb.500.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable), notifying them of an executed trade and its details.



Sends Cancelled Trade

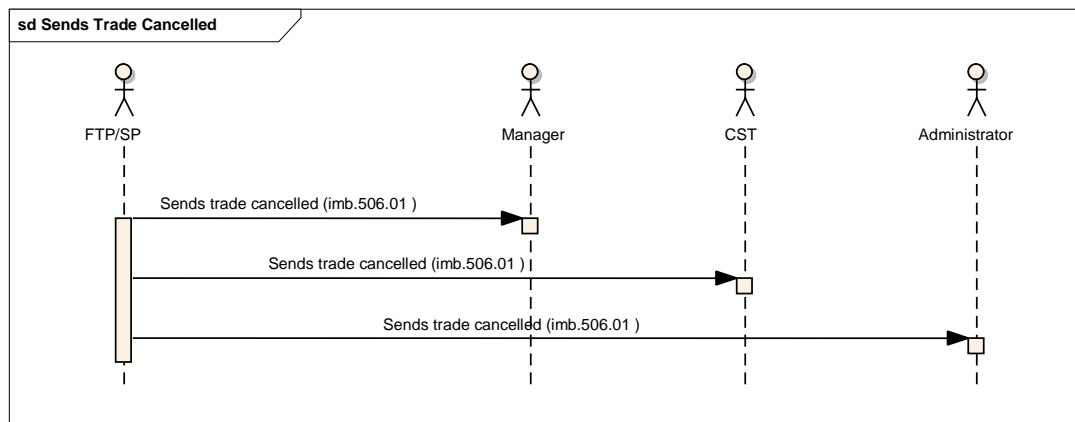
Introduction

This flow illustrates use of the TradeLegNotificationCancellation message in typical sequential scenarios to notify the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) of cancellation of the trade in the Participant's system.

Scenario 1: Full Trading Participant or Settlement Participant Sends Cancelled Trade

This is the most basic and elementary scenario for notifying the Manager, Custodian and/or Administrator of the cancellation of a trade in the Participant's system.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the TradeLegNotificationCancellation <imb.506.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable), notifying them of cancellation of the trade and its details.



Trade Acceptance or Rejection

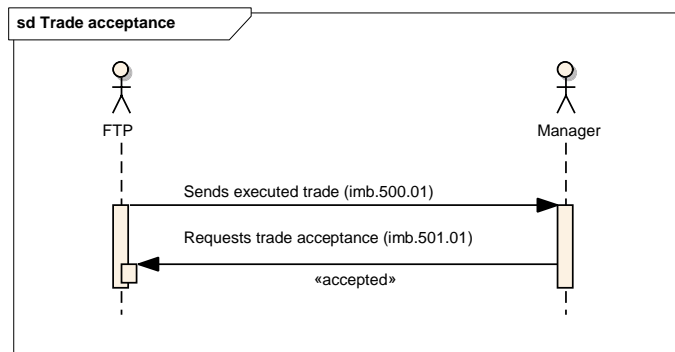
Introduction

This flow illustrates use of the TradeNotificationResponse message in typical sequential scenarios to request acceptance or rejection of a trade executed by the Full Trading Participant. This scenario does not involve give-ups.

Scenario 1: Manager accepts notification of executed trade

This is the most basic and elementary scenario for requesting approval of the executed trade.

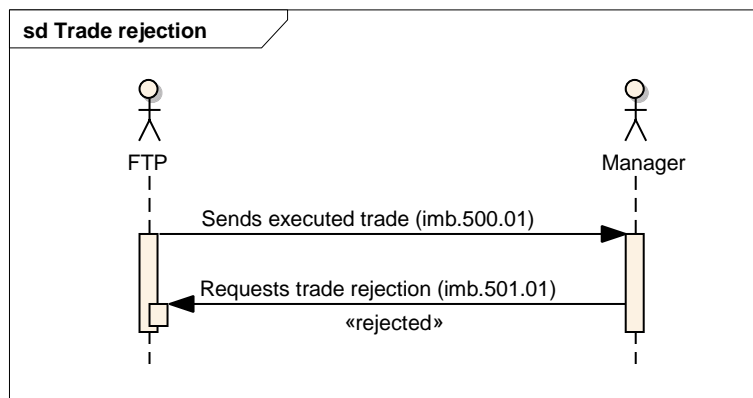
- The Full Trading Participant sends the TradeLegNotification <imb.500.01> message to the Manager, notifying it of the executed trade and its details;
- The Manager sends the TradeNotificationResponse <imb.501.01> message to the Full Trading Participant, requesting acceptance of the notification of the executed trade.



Scenario 2: Manager rejects notification of executed trade

This is the most basic and elementary scenario for requesting approval of the executed trade.

- The Full Trading Participant sends the TradeLegNotification <imb.500.01> message to the Manager, notifying it of the executed trade and its details;
- The Manager sends the TradeNotificationResponse <imb.501.01> message to the Full Trading Participant, requesting rejection of the executed trade notification.





Allocation Entry by Trade

Introduction

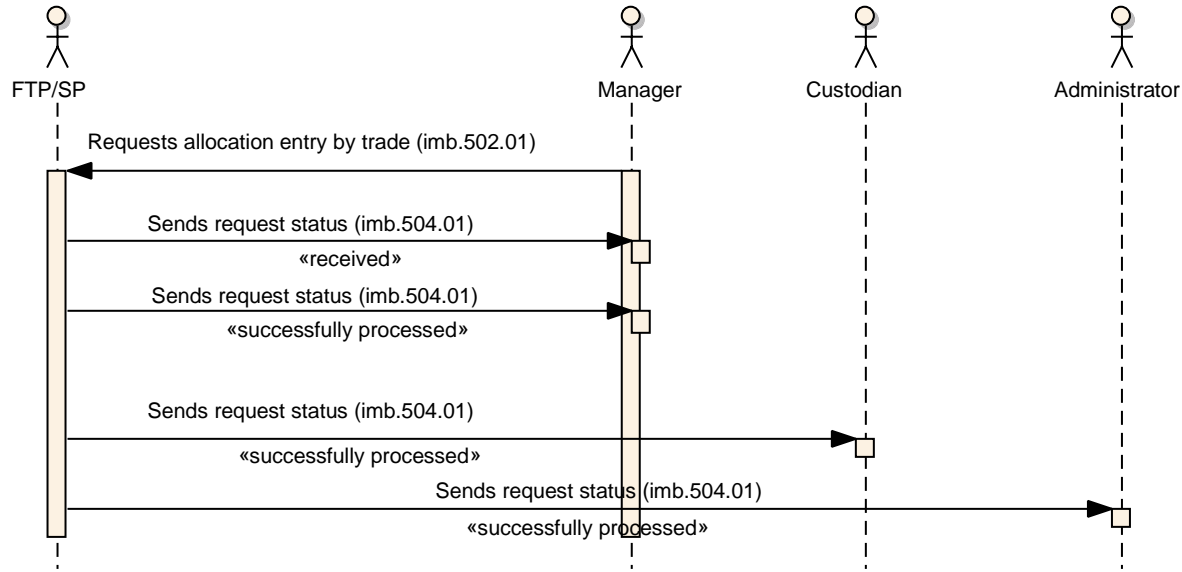
This flow illustrates use of the SecuritiesAllocationInstruction message in typical sequential scenarios so that the Manager can request entry of the Master account allocation to the Final account by trade.

Scenario1: Manager requests Allocation Entry by Trade – successful

This is the most basic and elementary scenario for trade allocation entry.

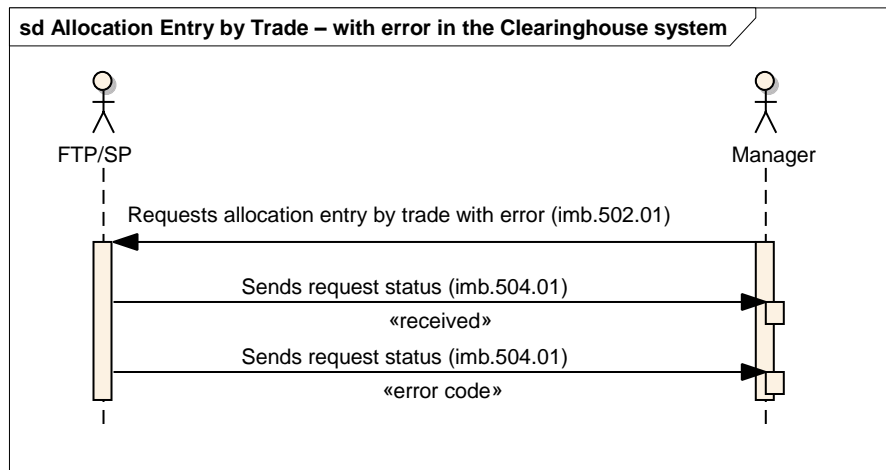
- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstruction <imb.502.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant, requesting trade allocation entry and notifying them of all the details pertinent to the allocation;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the status of the requested allocation (successfully processed).

sd Allocation Entry by Trade - successful



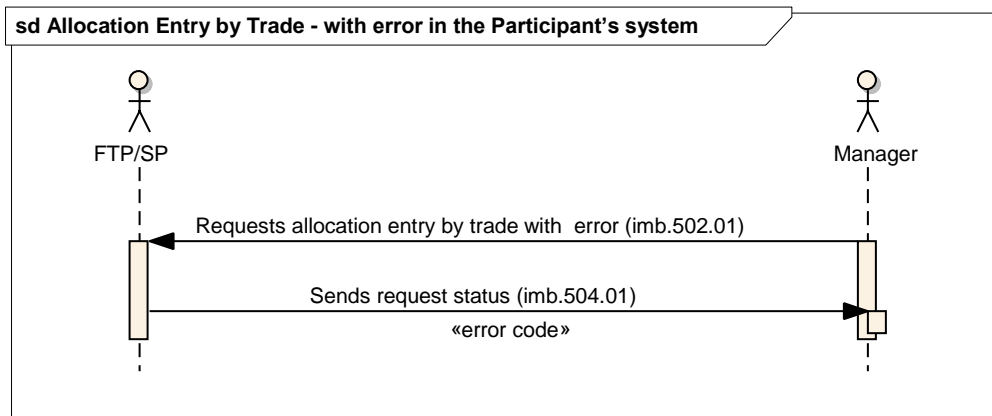
Scenario 2: Manager requests Allocation Entry by Trade – with error at the Clearinghouse

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstruction <imb.502.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant, requesting trade allocation entry and sends details with some nonconformity;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, notifying it of the status of the requested allocation (with error).



Scenario 3: Manager requests allocation entry by trade – with error in the Participant's system

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstruction <imb.502.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant, requesting trade allocation entry and sends details with some nonconformity;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, informing the status of the requested allocation (with error).





Allocation Entry by Lot

Introduction

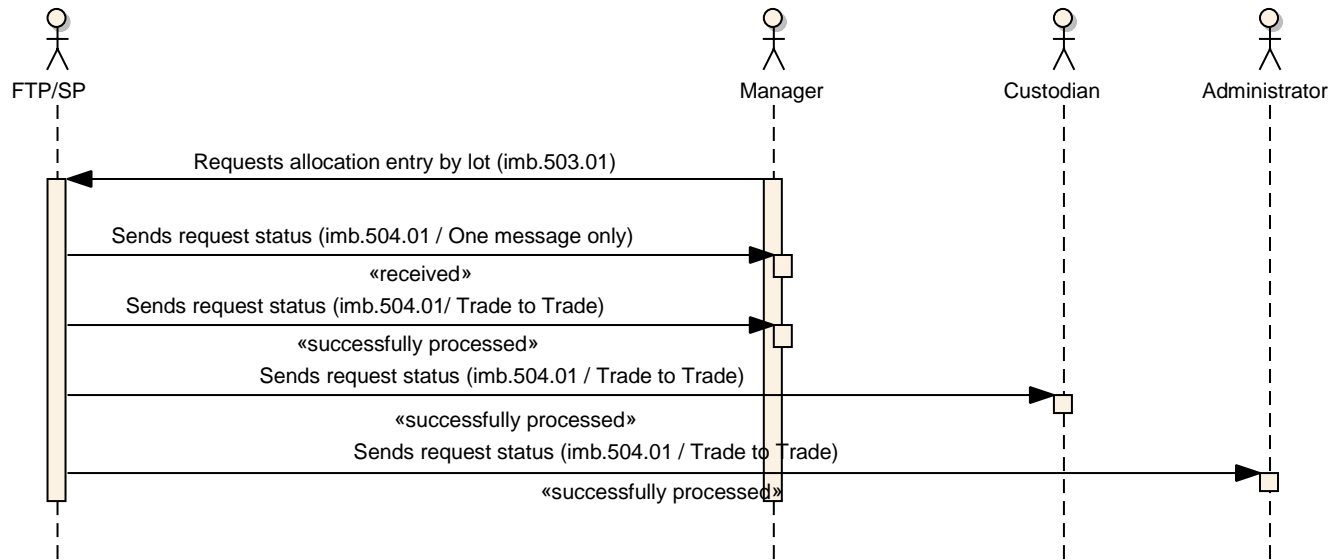
This flow illustrates use of the SecuritiesLotAllocationInstruction message in typical sequential scenarios for the Manager to request allocation entry from a Master account to a Sub-account by lot.

Scenario 1: Manager requests Allocation Entry by Lot – successful

This is the most basic and elementary scenario for allocation entry.

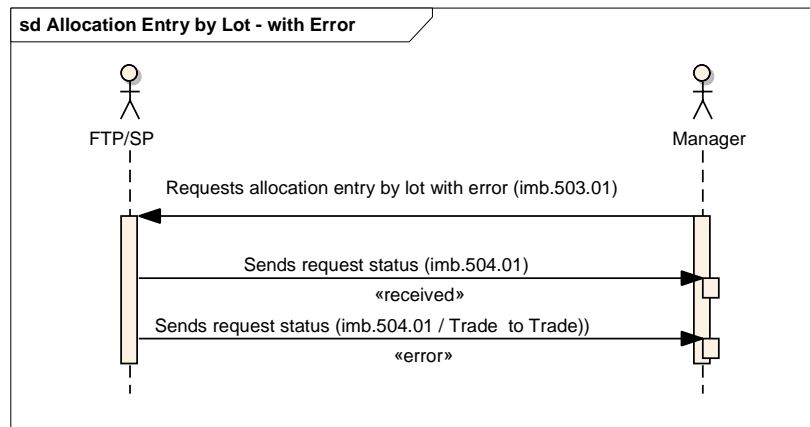
- The Manager sends the SecuritiesLotAllocationInstruction <imb.503.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant to request allocation entry by lot and inform the details pertinent to allocation;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> trade to trade message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) informing the status of the requested allocation (successfully processed).

sd Allocation Entry by Lot - Successful



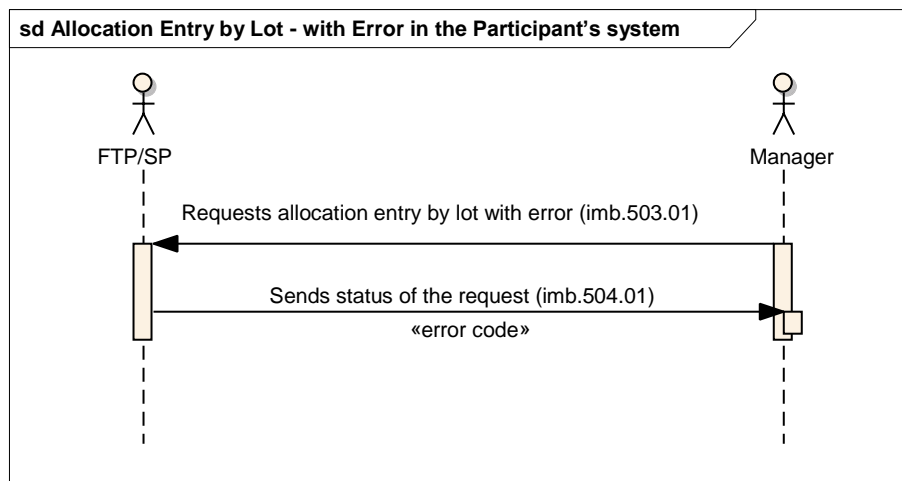
Scenario 2: Manager requests allocation entry by lot – with error at the Clearinghouse

- The Manager sends the SecuritiesLotAllocationInstruction <imb.503.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant, requesting allocation entry by lot and informing details with some nonconformity;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, informing the status of the requested allocation (with error).



Scenario 3: Manager requests allocation entry by lot – with error in the Participant’s system

- The Manager sends the SecuritiesLotAllocationInstruction <imb.503.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant, requesting allocation entry by lot and sends details with some nonconformity;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, informing the status of the requested allocation (with error).





Allocation Exclusion

This flow illustrates use of the SecuritiesAllocationInstructionCancellation message in typical sequential scenarios to request allocation exclusion of the Master account or the Final account.

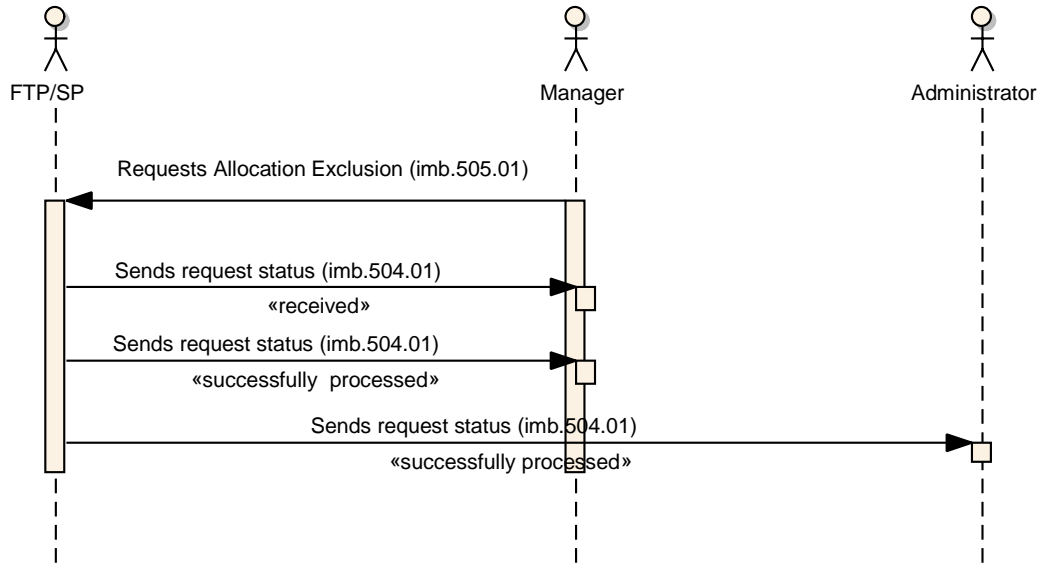
Introduction

This is the most basic and elementary scenario for trade allocation exclusion.

Scenario 1: Manager requests allocation exclusion of Master account – successful

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstructionCancellation <imb.505.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant to request trade allocation exclusion;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the allocation exclusion status (successfully processed).

sd Master account Allocation Exclusion - Successful

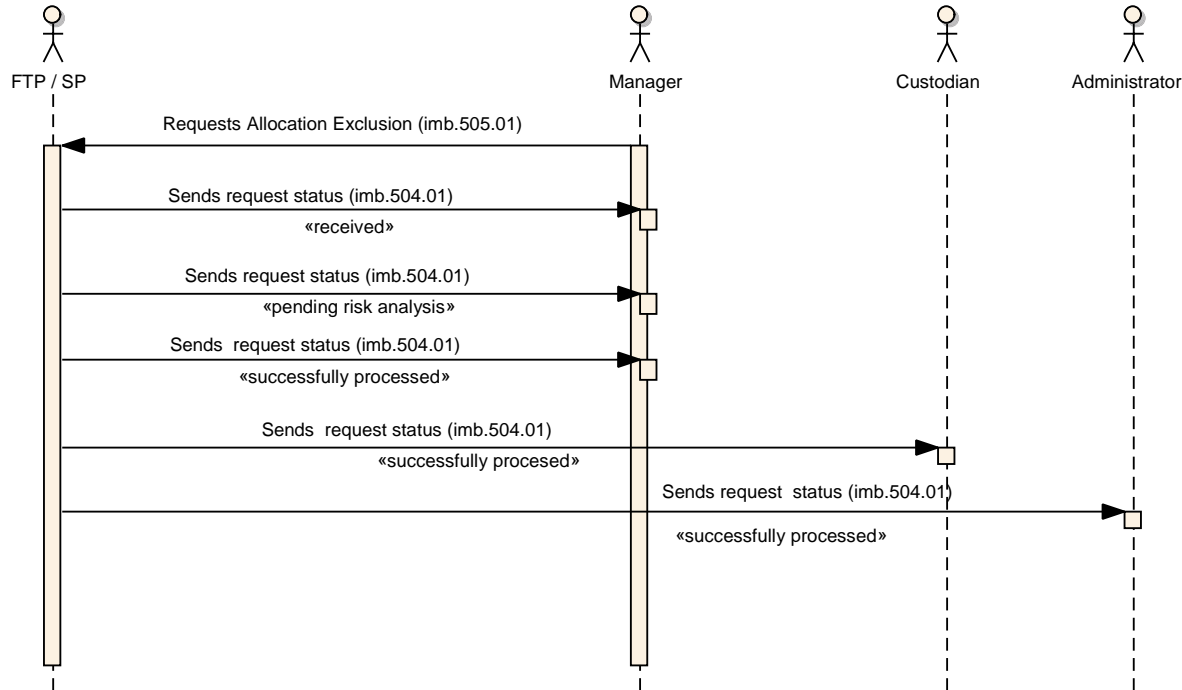




Scenario 2: Manager requests Sub-account allocation exclusion – successful

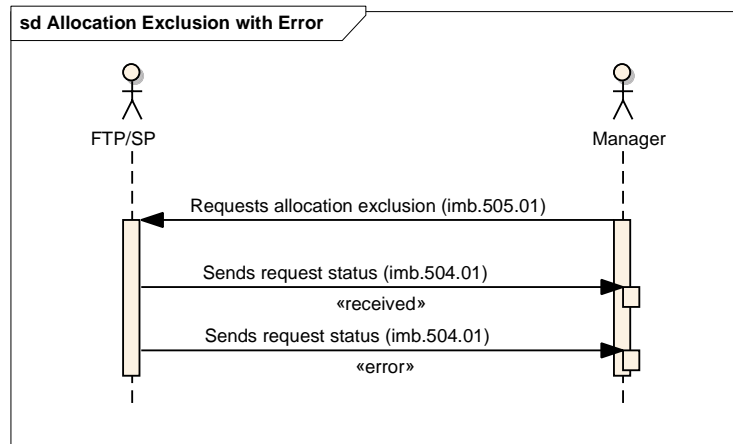
- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstructionCancellation <imb.505.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant to request exclusion of the trade allocation;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message notifying the Manager, Custodian and/or Administrator of the status of the allocation exclusion (pending risk analysis).
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) informing the status of the allocation exclusion (successfully processed).

sd Final account Allocation Exclusion - Successful



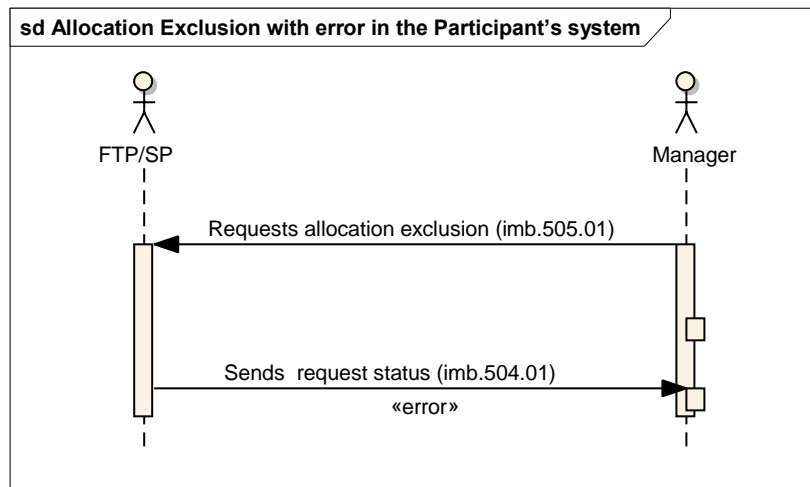
Scenario 3: Manager requests allocation exclusion – with error at the Clearinghouse

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstructionCancellation <imb.505.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant to request trade allocation exclusion and sends the details with some nonconformity;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, informing the status of the requested allocation (with error).



Scenario 4: Manager requests allocation exclusion – with error in the Participant's system

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstructionCancellation <imb.505.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant to request exclusion of the allocation request and sends details with some nonconformity;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, informing the status of the requested allocation (with error).





Sends Brokerage Bill

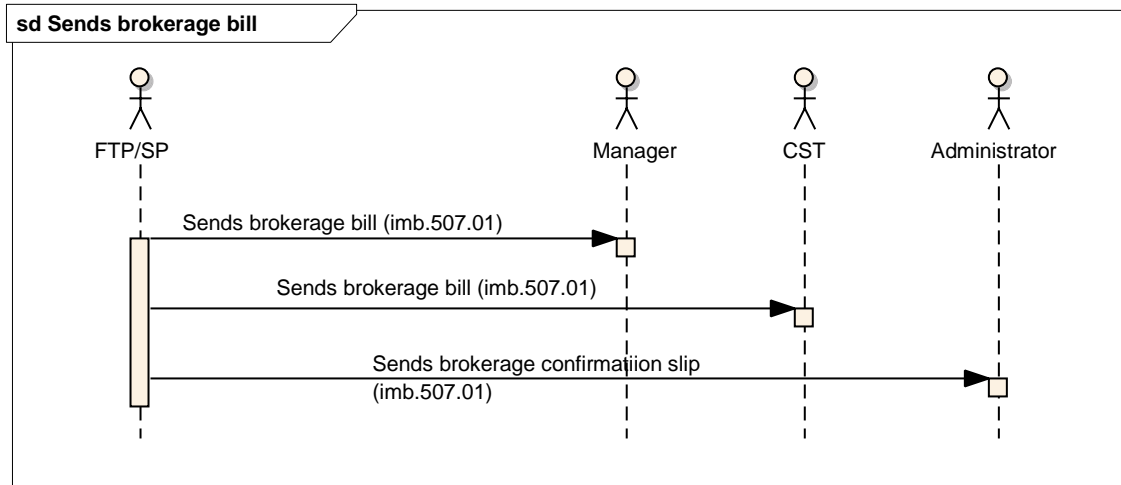
This flow illustrates use of the InvoiceNotification message in typical sequential scenarios to send the brokerage bill.

Introduction

This is the most basic and elementary scenario to send the brokerage bill.

Scenario 1: Sends Brokerage Bill

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the InvoiceNotification <imb.507.01> message to the Manager, Administrator and/or Custodian (the recipients are parameterizable) to send the brokerage bill.





Sends Net Settlement by Trade

This flow illustrates use of the SecuritiesAllocatedNetAmountNotification message in typical sequential scenarios to inform net settlement by trade.

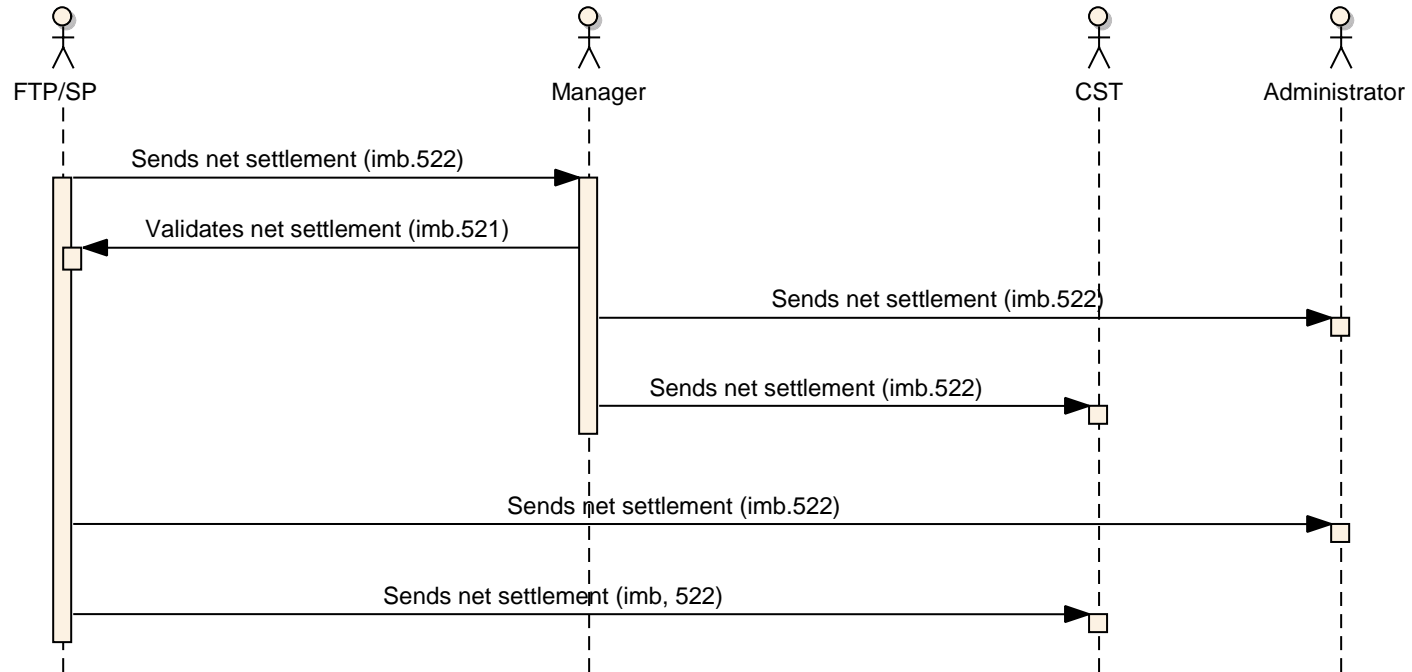
Introduction

This is the most basic and elementary scenario for informing net settlement value by trade.

Scenario 1: Sends net settlement

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocatedNetAmountNotification <imb.522> message to the Manager to inform the net settlement value by trade;
- The Manager sends the FinancialValueApprovalResponse <imb.521> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant to validate the net settlement value;
- The Manager sends the SecuritiesAllocatedNetAmountNotification <imb.522> message to the Administrator to inform the net settlement value by trade;
- The Manager sends the SecuritiesAllocatedNetAmountNotification <imb.522> message to the Custodian to inform the net settlement value by trade;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocatedNetAmountNotification <imb.522> message to the Administrator and/or Custodian (the recipients are parameterizable) to inform the net settlement value by trade.

sd Sends Net Settlement





Sends Gross Settlement

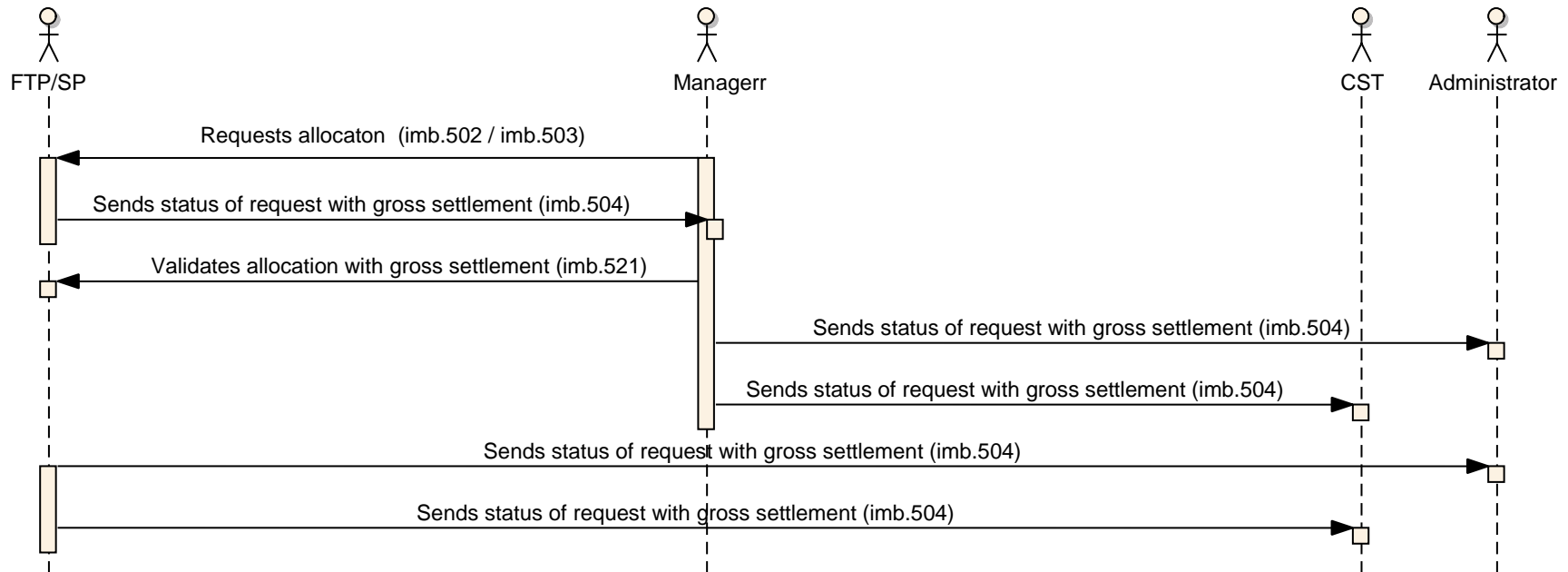
This flow illustrates use of the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice message in typical sequential scenarios to inform gross settlement by allocation.

Introduction

This is the most basic and elementary scenario for informing the gross settlement value by allocation.

Scenario 1: Sends gross settlement

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstruction <imb.502.01> message or the SecuritiesLotAllocationInstruction <imb.503.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant to request allocation entry and inform all the details pertinent to allocation;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator informing the status of the requested allocation (successfully processed) with gross settlement value;
- The Manager sends the FinancialValueApprovalResponse <imb.521> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant to validate the gross settlement value;
- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504> message to the Administrator to inform the gross settlement value;
- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504> message to the Custodian to inform the gross settlement value;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionAdvice <imb.504> message to the Administrator and/or Custodian (the recipients are parameterizable) to inform the gross settlement value of the allocation.

sd Allocation with Gross Settlement**Sends Allocation Entry Preview**

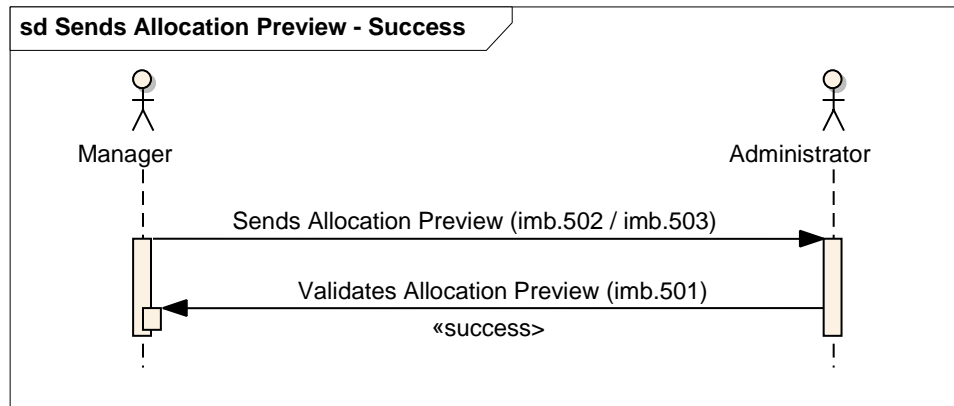
This flow illustrates use of the SecuritiesAllocationInstruction message or SecuritiesLotAllocationInstruction message in typical sequential scenarios for preinforming allocation entry.

Introduction

This is the most basic and elementary scenario for a preview of trade allocation(s).

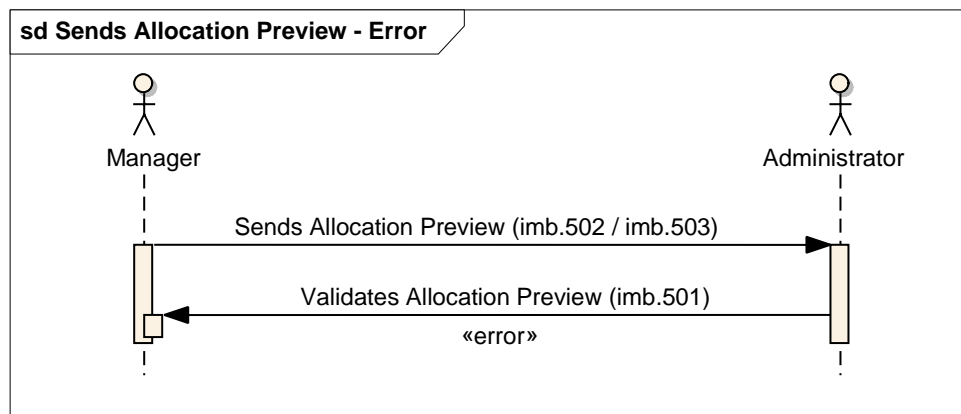
Scenario 1: Manager requests allocation preview validation – successful

- The Manager may send the SecuritiesAllocationInstruction <imb.502.01> message or the SecuritiesLotAllocationInstruction <imb.503> message to the Administrator to request preview validation of allocation entry;
- The Administrator sends the TradeNotificationResponse <imb.501.01> message to the Manager informing the allocation preview status (successfully validated).



Scenario 2: Manager requests allocation preview validation – with error

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstruction <imb.502.01> message or the SecuritiesLotAllocationInstruction <imb.503> message to the Administrator to request validation of the allocation entry preview;
- The Administrator sends the TradeNotificationResponse <imb.501.01> message to the Manager informing the allocation preview status (validated with error).



Message Flow – Give-up

Trade give-up

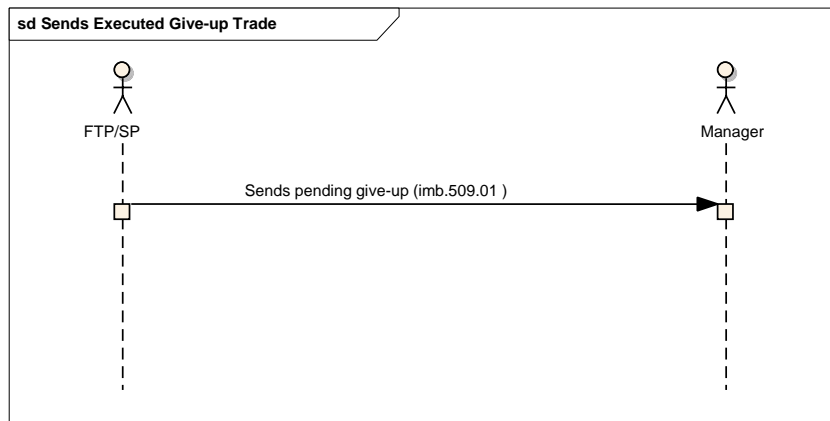
Introduction

This section illustrates trade give-up flows in typical sequential scenarios to inform give-ups executed successfully or with error. The give-up may occur when capturing the executed trade (if the account captured in the order has a give-up link) or in the allocation entry (if the allocated account has a give-up link).

Scenario1: Sends trade give-up executed, pending acceptance or rejection by the Manager

This is the most basic and elementary scenario for informing execution of a trade with a give-up that must be accepted or rejected by the Manager.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the InformGiveUpPendingApproval <imb.509.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) informing the existence of trades resulting from a give-up with pending acceptance/rejection;





Give-up Accepted or Rejected

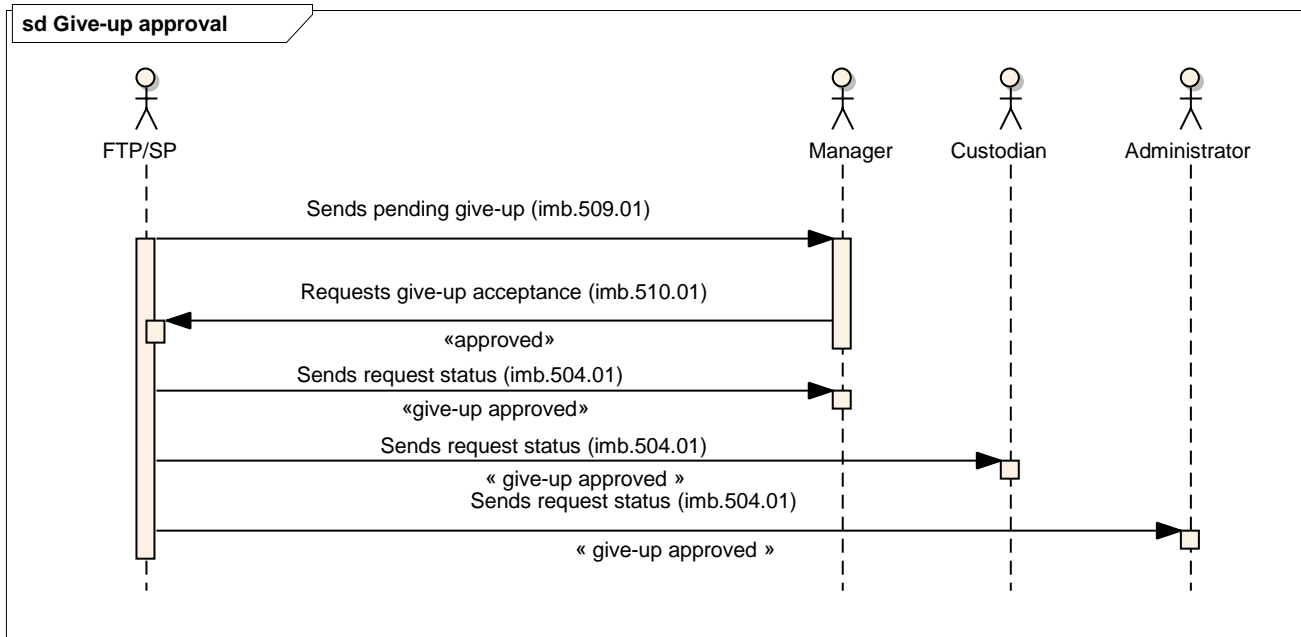
Introduction

This flow illustrates use of the ResponseGiveUpAcceptanceorRejection message in typical sequential scenarios between two parties to inform acceptance or rejection of the give-up.

Scenario 1: Give-up actively accepted

This is the most basic and elementary scenario for requesting give-up acceptance or rejection.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the InformGiveUpPendingApproval <imb.509.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) informing the existence of trades resulting from give-ups with pending acceptance/rejection;
- The Manager sends the ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection <imb.510.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant notifying them of acceptance of the give-up.
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable), notifying them of the final status of the give-up acceptance request (give-up accepted).

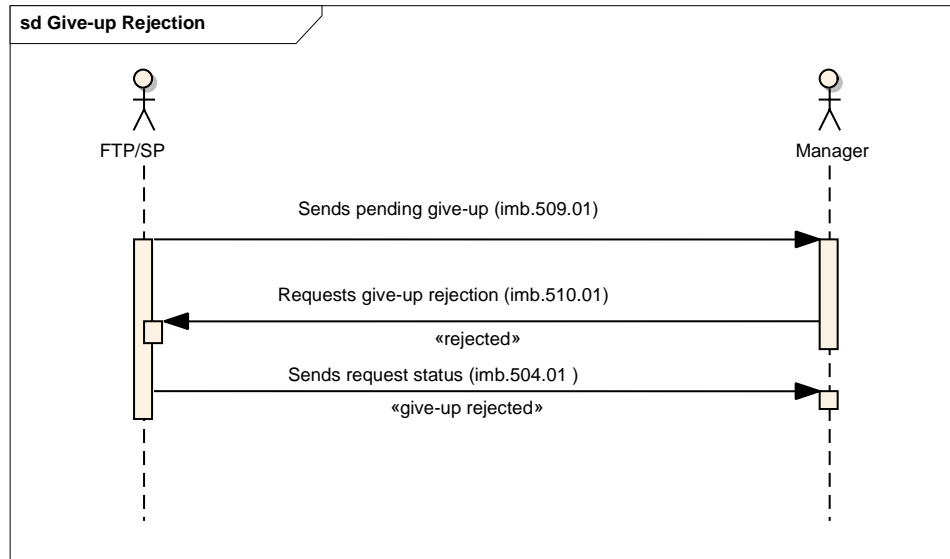


Scenario 2: Give-up actively rejected

This is the most basic and elementary scenario for requesting give-up acceptance or rejection.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the InformGiveUpPendingApproval <imb.509.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the existence of trades from a give-up pending acceptance/rejection;
- The Manager sends the <imb.510.01> ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection message to the Full Trading Participant or Settlement Participant notifying them of the give-up rejection.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable), notifying them of the final status of the give-up rejection request (give-up rejected).



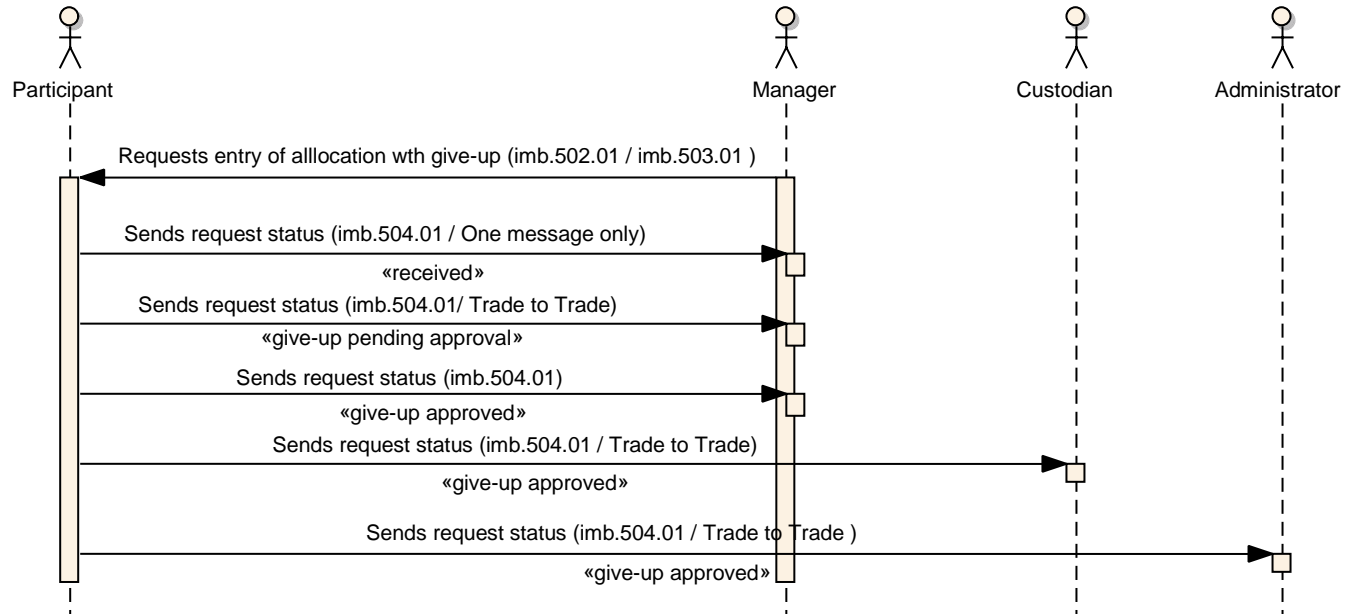


Sending a give-up in the allocation entry

Scenario 1: Manager requests allocation entry with give-up - accepted

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstruction <imb.502.01> message or SecuritiesLotAllocationInstruction <imb.503.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant, requesting trade allocation entry in an account with a give-up link and informing all the details pertinent to the allocation;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the status of the requested allocation (give-up pending approval).
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the status of the requested allocation (give-up accepted).

sd Entry of Allocation with Give-up - approved

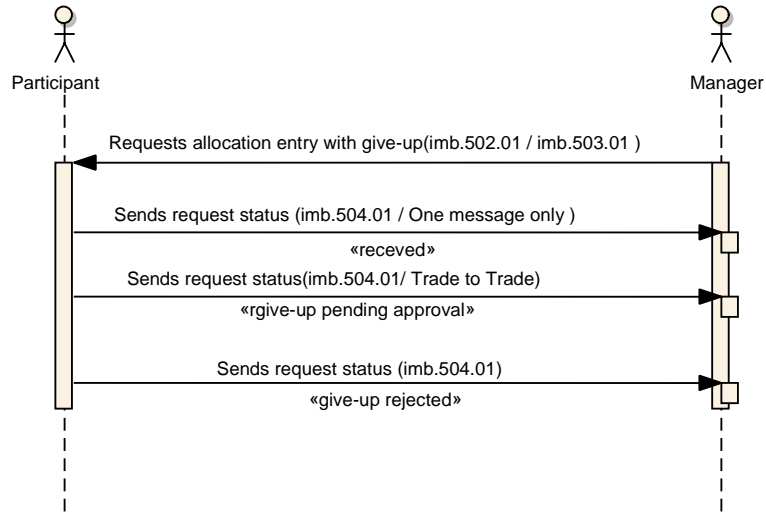




Scenario 2: Manager requests allocation entry with give-up - rejected

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstruction <imb.502.01> message or SecuritiesLotAllocationInstruction <imb.503.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant, requesting trade allocation entry in an account with give-up link and sends all the details pertinent to allocation;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the status of the requested allocation (give-up pending approval).
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the status of the requested allocation (give-up rejected).

sd Allocation Entry with Give-up - rejected





Definition – Message Catalogue

Date: Apr. 25, 2019

iMercado - Capture, Allocation and Give-up

Message Flow - Primary ETF

Sends executed Payment/Redemption of (Primary EFT) shares

Introduction

This flow illustrates use of the ETFTradeNotification message to inform execution of Primary ETF Payment/Redemption.

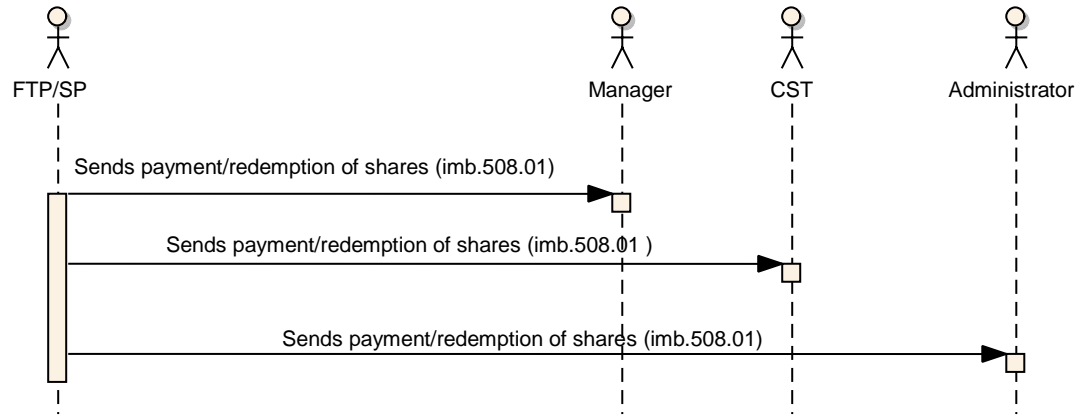
Scenario1: Full Trading Participant or Settlement Participant sends ETF trade executed in the Primary Market

This is the most basic and elementary scenario for informing execution of ETF Payment/Redemption.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends an ETFTradeNotification (imb.508.01) message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the Payment/Redemption of ETF shares executed in the primary trading system and their details.



sd Sends Payment/Redemption of shares (Primary ETF)





Primary ETF trade give-up

Introduction

This section illustrates trade give-up flows in typical sequential scenarios to inform an executed give-up. The give-up may occur during capture of the executed trade (if the account captured in the order has a give-up link) or in the allocation entry (if the allocated account has a give-up link).

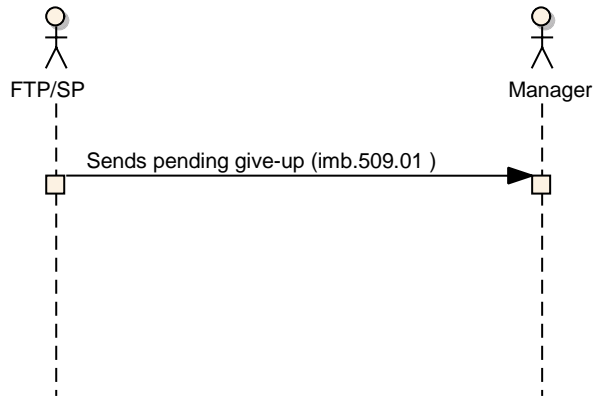
Scenario1: Sends Primary ETF trade give-up - (pending acceptance or rejection by the Manager)

This is the most basic and elementary scenario for informing the execution of a Primary ETF trade with give-up.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the InformGiveUpPendingApproval <imb.509.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the existence of trades resulting from Primary ETF give-ups with pending acceptance/rejection.



sd Sends Give-up Trade Executed – Primary ETF



S



Give-up acceptance or rejection

Introduction

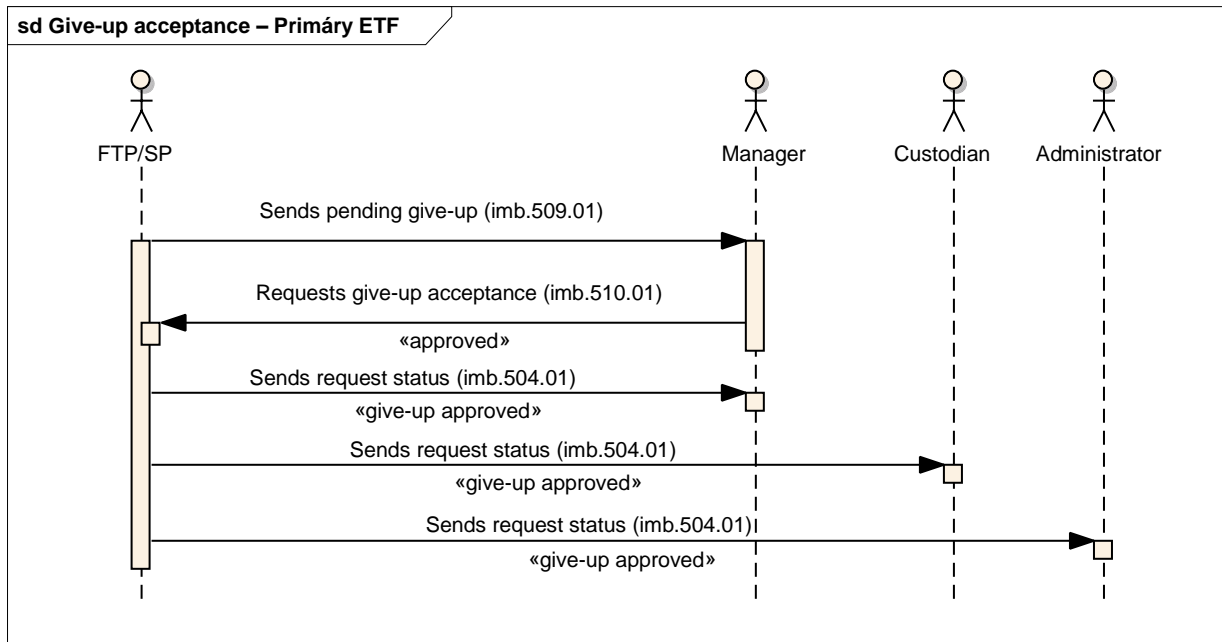
This flow illustrates use of the ResponseGiveUpAcceptanceorRejection message in typical sequential scenarios between two parties to inform give-up acceptance or rejection or trade give-up cancellation.

The following scenarios represent only on-hour give-up acceptance or rejection. The other off-hour give-up, or give-up cancellation, scenarios will be covered in the Rule Violations section.

Scenario 1: Primary ETF Give-up actively accepted

This is the most basic and elementary scenario for requesting give-up acceptance.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the InformGiveUpPendingApproval <imb.509.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) informing the existence of Primary ETF trades resulting from give-ups with pending acceptance/rejection;
- The Manager sends the ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection <imb.510.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant notifying them of acceptance of the Primary ETF give-up.
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager notifying it of the final status of the give-up acceptance request (give-up accepted).

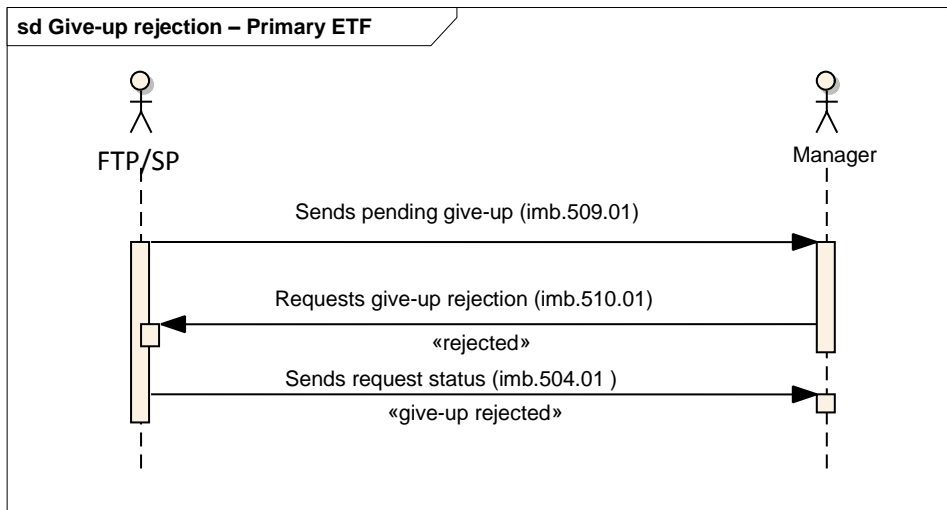


Scenario 2: Primary ETF Give-up actively rejected

This is the most basic and elementary scenario for requesting give-up rejection.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the InformGiveUpPendingApproval <imb.509.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) informing the existence of Primary ETF trades from give-ups with pending acceptance/rejection;
- The Manager sends the ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection <imb.510.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant informing acceptance of the Primary ETF give-up.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager informing the final status of the give-up acceptance request (give-up rejected).



ETF Price/Settlement update Executed in the Primary Market

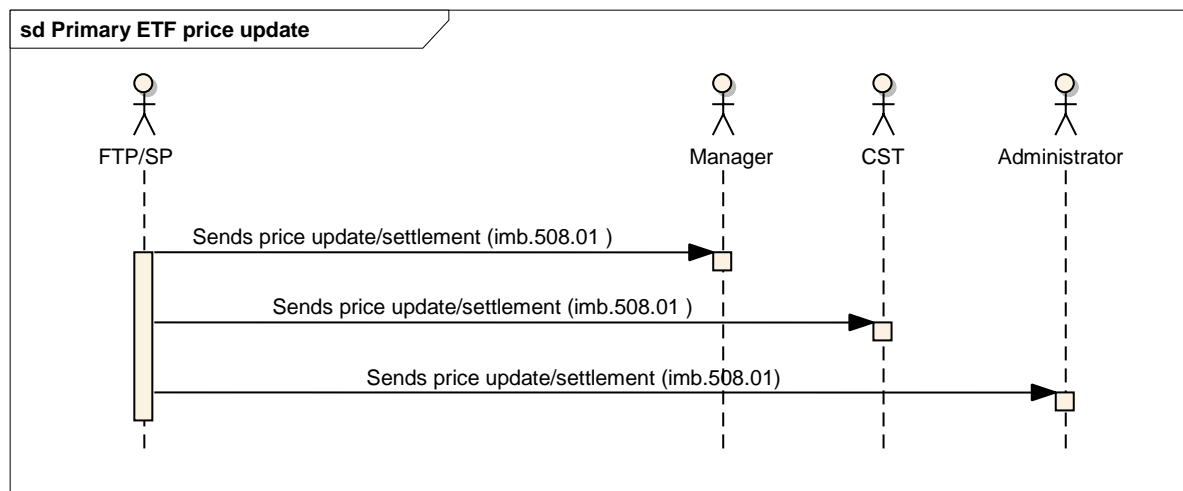
Introduction

This flow illustrates use of the ETFTradeNotification message in typical sequential scenarios to inform the ETF Price/settlement update executed in the Primary Market.

Scenario1: Full Trading Participant or Settlement Participant sends ETF Price/Settlement update Executed in the Primary Market

This is the most basic and elementary scenario for informing the Primary ETF price/settlement update.

- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the ETFTradeNotification (imb.508.01) message to the Manager, Custodian and/or Administrator informing the final or provisional prices or reset of the ETF payment/redemption trades executed in the Primary Market.





Message Flow - Off-Hour Allocation

Off-hour trade allocation entry

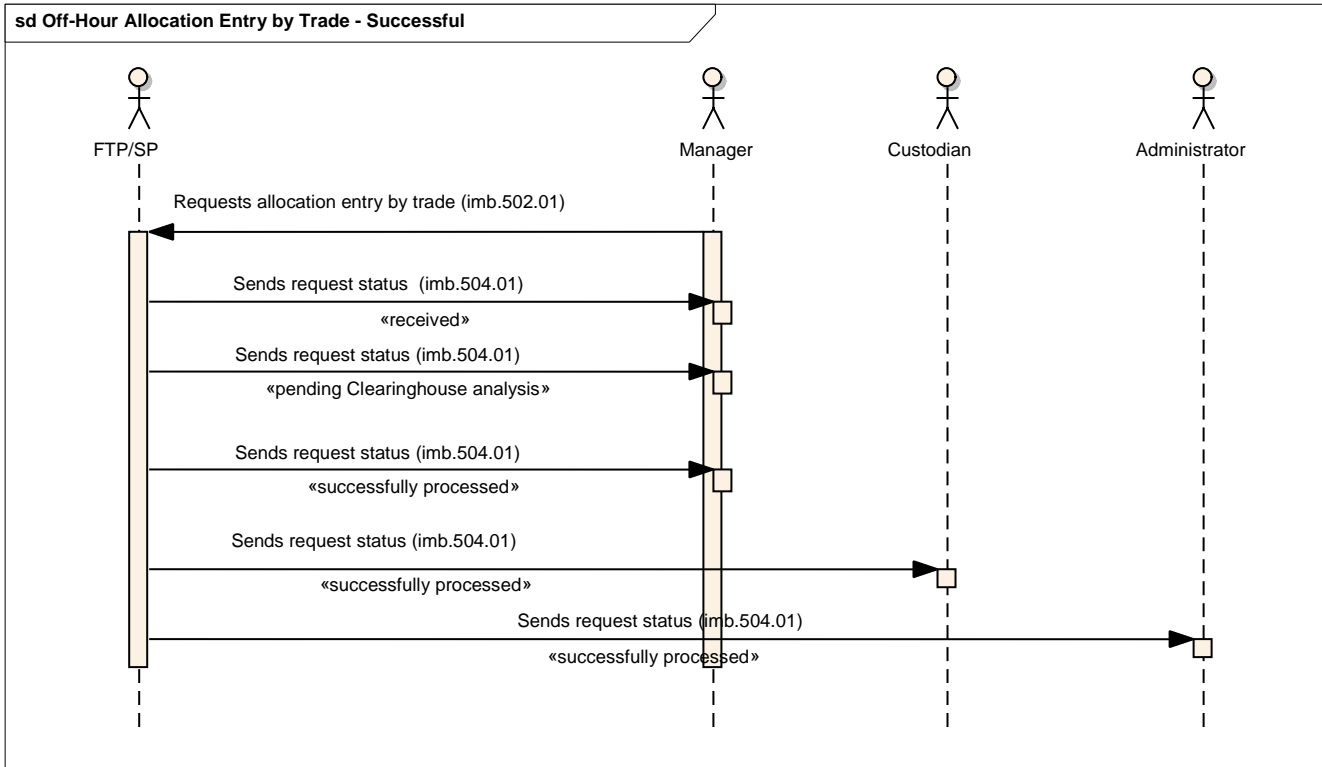
Introduction

This flow illustrates use of the SecuritiesAllocationInstruction message in typical sequential scenarios for the Manager to request off-hour Master account allocation entry to a Sub-account.

Scenario 1: Manager requests off-hour allocation entry - accepted by the Clearinghouse

This is the most basic and elementary scenario for requesting off-hour allocation entry.

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstruction <imb.502.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant to request off-hour allocation entry of an account with no give-up link.
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message notifying the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) of the allocation entry status (pending Clearinghouse analysis).
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the allocation entry status (successfully processed).

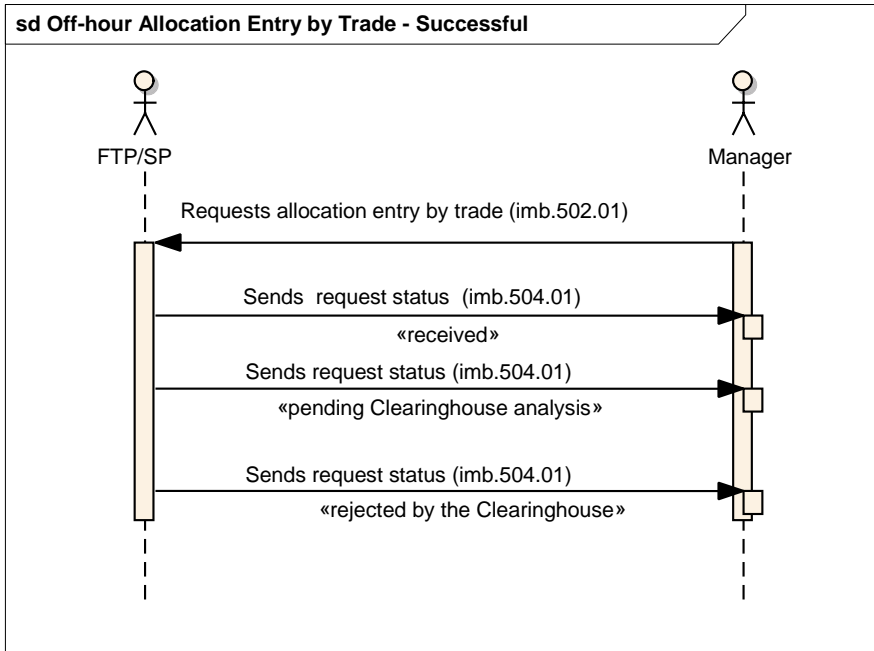




Scenario 2: Manager requests off-hour allocation entry - rejected by the Clearinghouse

This is the most basic and elementary scenario for the off-hour allocation entry request.

- The Manager sends the SecuritiesAllocationInstruction <imb.502.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant to request off hour allocation entry of an account with no give-up link.
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message confirming receipt of the request;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message notifying the Manager, Custodian and/or Administrator of the allocation entry status (pending Clearinghouse analysis).
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the allocation entry (rejected by the Clearinghouse).





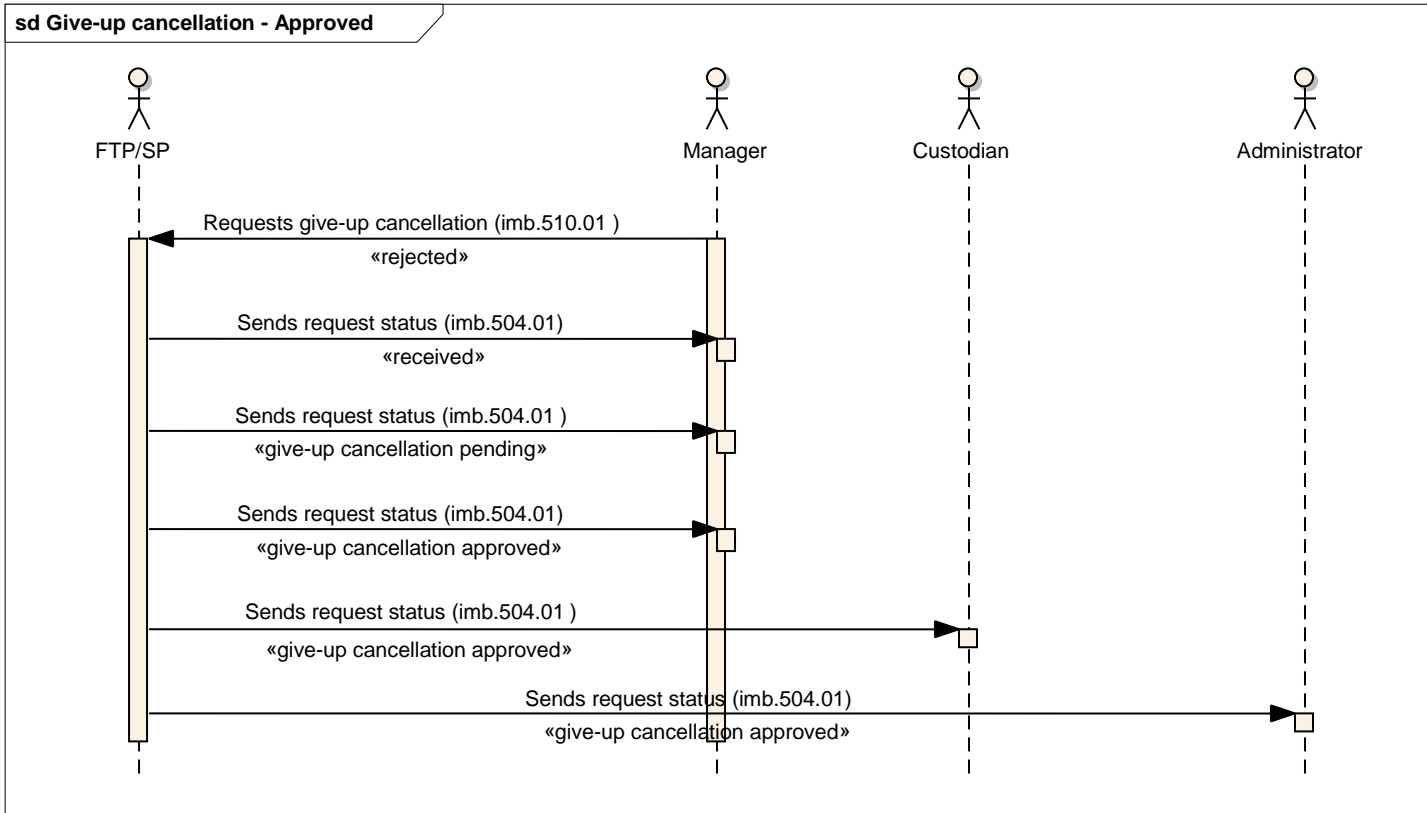
Give-up cancellation

Introduction

This flow illustrates use of the ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection message in typical sequential scenarios between two parties to request rejection of the off-hour give-up as established by the Clearinghouse.

Scenario 1: Request for off-hour allocation rejection - accepted by the Give-up Participant

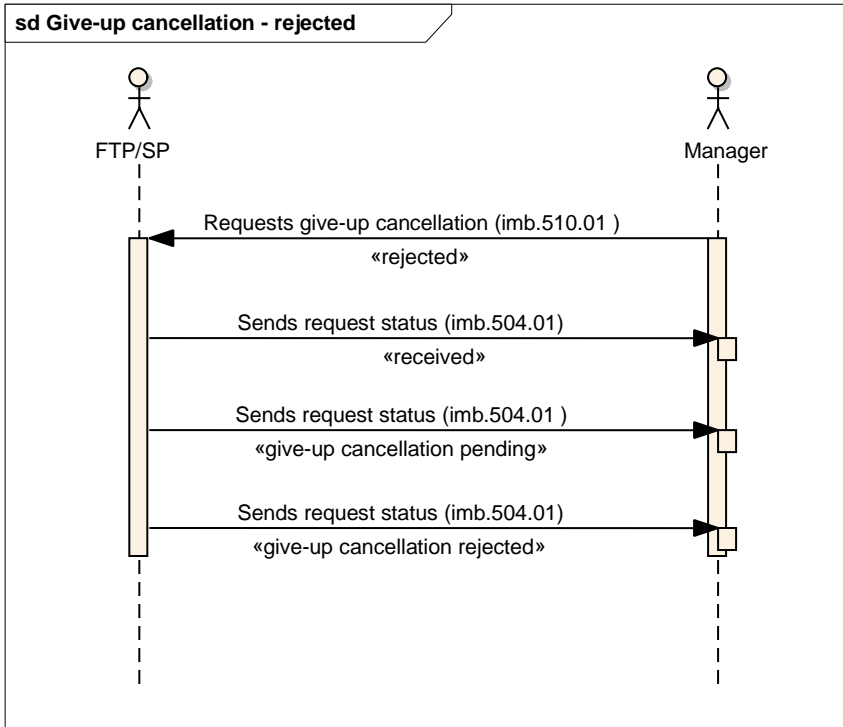
- The Manager sends the ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection <imb.510.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant requesting rejection of the off-hour give-up as established at the Clearinghouse;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the request status (give-up cancellation pending approval);
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the request status (give-up cancellation accepted);





Scenario 2: Rejection of off-hour give-up request - rejected by the Give-up Participant

- The Manager sends the ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection <imb.510.01> message to the Full Trading Participant or Settlement Participant requesting rejection of the off-hour give-up as established at the Clearinghouse;
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the request status (give-up cancellation pending approval);
- The Full Trading Participant or Settlement Participant sends the SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice <imb.504.01> message to the Manager, Custodian and/or Administrator (the recipients are parameterizable) notifying them of the request status (give-up cancellation rejected).





imb.500.01 – TradeLegNotification

Message functionality

The TradeLegNotification message is sent by the Full Trading Participant (FTP) to the Manager via iMercado and provides details of trades captured in the Participant's system.

Rules

R1. This field will only be filled out for equities.

R2. This field notifies the type of account allocated at the FTP/SP, having as a reference the '2.0 Clearing Account' field of the imb.500.01 – TradeLegNotification message.

Message Structure – TradeLegNotification (imb.500.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+		This block identifies the clearing member of the trading participant who executed the trade.	Este bloco identifica o Membro de Compensação do participante de negociação pleno que efetuou o negócio.	
1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	



1.1.1	Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternaliMercadoRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternaliMercadoRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>
1.1.2	Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>
1.1.3	SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	<p>Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>
2.0	ClearingAccount	ClrAcct	[1..1]	+		<p>This block identifies the account of the investor at the party that made the trade. The identification of the account must be informed in the standard below:</p>	<p>Este bloco identifica a conta do investidor no participante de negociação pleno que fez o negócio.</p>

							Account Number. e.g 115 = Account Number.	A identificação da conta precisa ser informada conforme padrão abaixo: Número da Conta. Ex: 115 = Número da Conta.	
2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the investor's account. e.g 115 = Account Number.	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta.	
2.2		Type	Tp	[1..1]	ClearingAccountType1Code	string	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = CLIE.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = CLIE.	
3.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+		This block provides details of the trade.	Este bloco fornece detalhes do negócio.	
3.1		TradeLegIdentification	TradLegId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = 0.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = 0.	
3.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Trade Identification	Número do negócio.	
3.3		TradeExecutionIdentification	TradExcId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = 0.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = 0.	
3.4		OrderIdentification	OrdId	[0..1]	Max26Text	string minLength = 1 maxLength = 26	Unique identifier for Order assigned by the trading system.	Número da ordem no sistema eletrônico.	

3.5		AllocationIdentification	AllcId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identifies the portion of assets within a determined trade that shall be allocated to different clients.	Identifica a parte dos ativos em um determinado negócio que devem ser atribuídos a diferentes clientes.	
3.6		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODateTime	dateTime	Provides the date and time of trading session.	Fornecer a data e hora do pregão.	
3.7		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrMId	[1..1]	+		Provides details about the security identification.	Fornecer detalhes da identificação do instrumento.	
3.7.1		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	string pattern = [A-Z0-9]{12,12}	<p>INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER (ISIN). A numbering system designed to standardize the codes of financial securities internationally. The code for Brazilian securities has the BR AAAA BB CC 7 structure, where:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) The two-character prefix (BR) identifies the code for the country of issue (BRAZIL) b) The four characters (AAAA) are alphanumeric characters and identify the issuer. c) The three characters (BBB) are alphanumeric characters and identify the type of security. It may have an automatic sequence in the second position (Sequence 1) and in the third position (Sequence 2) or have no sequence at all. d) The two characters (CC) are alphanumeric characters and identify the type, when it is a stock, or represent an automatic sequence to identify each security issue, when it is a different asset category. e) The last character (7) is the control digit. 	<p>INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER – É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7, onde:</p> <ul style="list-style-type: none"> a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL; b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor; c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter sequência automática na segunda posição (sequência 1) e na terceira posição (sequência 2) ou não ter qualquer sequência; d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma sequência automática, para identificar cada 	



								emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias; e e) o último caractere (7) é o dígito de controle.	
3.8		BuySellIndicator	BuySellInd	[1..1]	Side1Code	string	Coded list to specify the side of the trade. E.g. Buy or Sell. The valid codes are BUYI and SELL.	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	
3.9		TradeQuantity	TradQty	[1..1]	+		Identifies the trade quantity.	Quantidade negociada.	
3.9.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.10		DealPrice	DealPric	[1..1]	+		Specifies the price.	Este bloco informa o valor negociado.	
3.10.1		Value	Val	[1..1]	+		Price value traded	Valor da cotação negociada.	
3.10.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Price value traded	Valor da cotação negociada.	
3.11		GrossAmount	GrssAmt	[0..1]	+		This block informs the gross trade amount.	Este bloco informa o volume negociado.	
3.11.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	



3.12		PlaceOfTrade	PlcOfTrade	[1..1]	+		<p>This block identifies the trading environment where the trade is executed.</p> <p>This block is not used by BM&FBOVESPA. See the default value for this fields in the Code field.</p>	<p>Este bloco identifica o ambiente de negociação onde o negócio foi executado.</p> <p>Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Veja no campo Code o valor default deste campo.</p>	
3.12.1		Type	Tp	[1..1]	+		<p>This block is not used by BM&FBOVESPA. See "Code" field in the default value of this field.</p>	<p>Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Veja no campo Code o valor default deste campo.</p>	
3.12.1.1		Code	Cd	[1..1]	MarketType2 Code	string	<p>This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = EXCH.</p>	<p>Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o default = EXCH.</p>	
3.13		TradeType	TradTp	[1..1]	TradeType1 Code	string	<p>This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = LKTR.</p>	<p>Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = LKTR.</p>	
3.14		TradingParty	TradgParty	[1..1]	+		<p>Full Trading Participant's ID code.</p>	<p>Código do Participante de Negociação Pleno que realizou o negócio.</p>	
3.14.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p>	<p>Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p>	
3.14.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternaliMercadoRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternaliMercadoRole no</p>	

								arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.14.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification, e.g., iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.14.1.3		SchemaName	Schmen	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.15		TradeRegistrationOrigin	TradRegnOrgn	[0..1]	Max50Text	string minLength = 1 maxLength = 50	Indicates trade session origin. E.g: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	Código da sessão de origem do negócio. Ex: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	
3.16		TradingCapacity	TradgCpcty	[1..1]	TradingCapacity5Code	string	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = PRIN.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = PRIN.	
4.0		SettlementDetails	SttlmDtl	[1..1]	+		This block is not used by the BM&FBOVESPA.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	
4.1		SettlementAmount	SttlmAmt	[1..1]	+		This block is not used by the BM&FBOVESPA.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	

4.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = 0.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. O conteúdo a ser preenchido neste campo é = 0.	
5.0		Supplementary Data	Splmtry Data	[0..1]	+		Optional element, which allows additional data to be located at some specific point in the message if necessary (PlaceAndName). Used to incorporate the BM&FBOVESPA extensions. These extensions are data or concepts that are not supported by the ISO message, but are necessary for the Brazilian market.	Elemento opcional, que permite que dados adicionais sejam localizados em algum ponto específico na mensagem se necessário (PlaceAndName). Usados para incorporar as extensões BM&FBOVESPA. Essas extensões são dados ou conceitos que não são suportados pela mensagem ISO, porém, são necessários para o mercado brasileiro.	
5.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[0..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message. In this case, the XPATH must be used.	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. Neste caso, deve ser usado o XPATH.	
5.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+		Technical element wrapping the supplementary data.	Elemento técnico que especifica os dados complementares.	
5.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+		Technical element involving complementary data. In the case of an XML file, it must be validated by a new XSD schema	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	



Supplementary Data - SUPL.500.01 – TradeLegNotificationSD

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identifications	Ids	[1..1]	+		Identification assigned by the participant who is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
1.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended //Document/TradLegNtfctn	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn	
1.2		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unambiguous identification of the transaction as known by the instructing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		AllocationInformation	AllcnInf	[0..1]	+		Specifies how the trades have to be allocated.	Fornecer detalhes da alocação.	
2.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended //Document/TradLegNtfctn	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn	
2.2		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	string maxLength = 5 minLength = 1	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	



2.3		CustodianIdentificationAndAccount	CtdnIdAndAcct	[0..1]	+		This block identifies the Custodian ID code and the Custodian Account ID code if the position account captured has a custodian link previously registered.	Este bloco contém a identificação do Agente de Custodia e da conta de custódia, caso a conta capturada possua vínculo de custódia previamente registrada.
2.3.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+		Provides details about the party identification.	Fornecer detalhes de identificação do participante.
2.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.
2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below:</p> <p>Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>
2.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.



2.3.1.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
2.3.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.3.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the investor's account. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.0		AllocationDetails	AllcnDtls	[1..1]	+		Provides allocation account details	Fornece detalhes da conta de alocação.	
3.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended //Document/TradLegNtfctn	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn	

3.2		SecurityAccountType	SctyAcctTp	[1..1]	ExternalSecurityAccountTypeCode	int	Identifies the Account Type in which the trade is allocated. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalSecurityAccountTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Identifica o tipo de conta em que o negócio é alocado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityAccountTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	R2
4.0		FinancialInstrumentAttributesInformation	FinInstrmAttrbtsInf	[1..1]	+		Information on the elements characterizing a financial instrument.	Informações das características de um instrumento.	
4.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctn	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn	
4.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1	Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex: BVMF3	
4.3		DistributionIdentification	Dstrbtnd	[0..1]	int	int	Distribution code of the instrument.	Número de distribuição do papel.	



4.4		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	int	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Equity – Cash 2 - Equity derivatives 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	
-----	--	---------	------	--------	---------------------	-----	---	---	--



4.5		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	int	<p>A Market represents the second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 – Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external code is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>exemplo</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é</p>	
-----	--	--------	-----	--------	--------------------	-----	---	---	--



								ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	
4.6		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	decimal fractionDigits = 10 totalDigits = 11	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	

4.7		OptionType	OptnTp	[0..1]	+		Specifies whether it is a Call option (right to purchase a specific underlying asset) or a Put option (right to sell a specific underlying asset).	Este bloco identifica se o estilo da opção é opção de compra (direito de comprar um ativo específico subjacente) ou opção de venda (direito de vender um ativo específico subjacente).	
4.7.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1 Code	string	This block identifies the option type. Call option (right to buy the underlying asset of the option) or put option (right to sell the underlying asset of the option). The valid codes are CALL and PUTT.	Este bloco identifica o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente da opção) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente da opção). Valores válidos: CALL e PUTT.	
5.0		TradeLegDetailsExtension	TradLegDtlsXtnsn	[1..1]	+		This block contains trade details not covered by the ISO message..	Este bloco contém informações relacionadas ao negócio que não foram contempladas pela mensagem ISO.	
5.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctn/TradLegDtls	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn/TradLegDtls	
5.2		TradingSessionIdentification	TradgSsnld	[0..1]	ExternalTradingSessionIdentificationCode	int	Indicates if the trade has been done on regular or non regular trade (after market). This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradingSessionIdentificationCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Este campo informa se o negócio foi feito no horário regular do pregão ou after market Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradingSessionIdentificationCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	R1



5.3		TradeSubType	TradSubTp	[0..1]	ExternalTradeSubTypeCode	int	<p>Further qualification to the trade type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeSubTypeCode the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls E.g.</p> <p>37 Cross trade</p> <p>43 Auction Trade</p> <p>1000 Trade was inserted by market ops on-behalf of firm</p> <p>1001 Termo Vista</p> <p>1002 Termo Vista Registered</p>	<p>Qualificação adicional para o tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeSubTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p> <p>Ex.:</p> <p>37 Cross trade</p> <p>43 Auction Trade</p> <p>1000 Trade was inserted by market ops on-behalf of firm</p> <p>1001 Termo Vista</p> <p>1002 Termo Vista Registered</p>	
5.4		DaysToSettlement	DaysToSttim	[0..1]	Max4Text	string maxLength = 4 minLength = 1	Indicates number of days for settlement of a forward contract (in equities).	Prazo em dias para a liquidação do contrato a termo (em ações).	



5.5		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	int	<p>This field identifies the settlement type . This field requires an externalcodelist. These codes and values were made on external sheets to allow flexible maintenance according to the update requirements from BM&FBOVESPA. In this case, the external code is ExternalPaymentTypeCode on the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts</p>	<p>Este campo identifica a forma de liquidação do negócio.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>Ex.:</p> <p>0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts</p>	
5.6		TradeTransactionType	TradTxTp	[1..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	int	<p>Specifies the type of trade.</p> <p>This field requires an external code list. These codes and values were made on external spreadsheets to allow flexible maintenance according to the update requirements from BM&FBOVESPA. In this case, the external code is ExternalTradeTransactionTypeCode on the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. E.g. 0 Regular Trade 29 Exercise Complement 38 Block Trade (BTF)</p>	<p>Código do tipo de negócio.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>Ex:</p> <p>0 Regular Trade</p>	

							45 Options Exercise 56 Opening Trade	29 (Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	
5.7		BacenAuctionDetails	BacenAuctionDtls	[0..1]	+		Contains information about BACEN Auction trades (dollar swap trades).	Detalha informações sobre leilões de swap cambial realizados pelo BACEN.	
5.7.1		BacenAuctionIdentification	BacenAuctionId	[0..1]	Max8Text	string maxLength = 8 minLength = 1	BACEN's communication number.	Número do comunicado BACEN.	
5.7.2		AuctionProposalIdentification	AuctionProposalId	[0..1]	Max6Text	string minLength = 1 maxLength = 6	Number of BACEN's Auction Proposal.	Número da Proposta do leilão de swap cambial BACEN.	
5.7.3		SelicAccountIdentification	SelicAccountId	[0..1]	Max9NumericText	string pattern = [0-9]{1,9}	Selic Account ID.	Identifica a Conta Selic.	
5.7.4		StartPositionDate	StartPositionDt	[0..1]	+		Start position date of the Dollar swap trade.	Data início da valorização do contrato de swap cambial.	
5.7.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Specifies a date.	Especifica uma data.	
5.8		StrategyTrade	StrategyTrade	[0..1]	+		Strategy information.	Contém dados de estratégia.	
5.8.1		ShortFuturePrice	ShortFuturePrice	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmount	decimal fractionDigits = 3 totalDigits = 15	Short leg price.	Valor futuro curto.	

5.8.2		LongFuturePrice	LngFutrPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmount	decimal fractionDigits = 3 totalDigits = 15	Long leg price.	Valor futuro longo.	
5.8.3		Delta	Dlta	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	decimal fractionDigits = 7 totalDigits = 19	Delta value.	Valor do Delta.	
5.9		ExercisePrice	ExrcPric	[0..1]	+		This block informs the strike price of an option.	Este bloco informa o preço de exercício da opção.	
5.9.1		Value	Val	[1..1]	+		Value of the strike	Possui o valor financeiro.	
5.9.1.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	decimal fractionDigits = 8 totalDigits = 32	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
5.10		TradingSessionSubIdentification	TradgSsnSubld	[0..1]	ExternalTradingSessionSubIdentificationCode	int	Identifier for the instrument group phase. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternalTradingSessionSubIdentificationCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Identifica o grupo da fase na sessão de negociação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradingSessionSubIdentificationCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	

5.11		SecurityTrading Status	SctyTradingSts	[0..1]	ExternalSecurityTradingStatusCode	int	Identifier for the instrument phase. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternalSecurityTradingStatusCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Identifica a fase do instrumento na negociação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityTradingStatusCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.12		TraderIdentification	Tradrlid	[0..1]	Max50Text	string minLength = 1 maxLength = 50	Indicates the trader code.	Este campo informa o código do operador.	
5.13		PublicOffer	PblcOffer	[0..1]	+		Public Offer Details	Detalhes da oferta pública.	
5.13.1		OfferingNumber	OfferngNb	[1..1]	Number	int fractionDigits = 0 totalDigits = 18	Indicates the original offering code.	Código da oferta.	
5.13.2		OfferingType	OfferngTp	[1..1]	ExternalOfferingTypeCode	string maxLength = 2	Provides the offering type code. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external code is ExternalOfferingTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Fornece o código do tipo de oferta. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalOfferingTypeCode no	



								arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.13.3		CollateralOfferIndicator	CollOfferInd	[1..1]	CollateralOfferTypeCode	string	Identifies whether the offer is with collateral or without collateral. 1 = with collateral 2 = without collateral	Informa se a oferta é garantida ou não. 1 = Com garantia 2 = Sem garantia	
5.14		SideTradeSubType	SdTradSubTp	[0..1]	SideTradeSubTypeCode	string	Identifies the strategy subtype.	Identifica o subtipo de estratégia.	
5.15		StrategyType	StrtgyTp	[0..1]	ExternalStrategyTypeCode	string maxLength = 2	Strategy type definition. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternalStrategyTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Define o tipo de estratégia. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStrategyTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.16		TradingDeskIdentification	TradgDsKld	[0..1]	Max50Text	string minLength = 1 maxLength = 50	Identifier for the trading desk or strategy. The data in this field will be received from the trading system.	Identifica a mesa de negociação ou estratégia. A informação deste campo será recebida do sistema de negociação.	



6.0		GiveUpInformation	GvUpInf	[0..1]	+		This block informs if the captured account has a give-up link.	Este bloco informa se a conta capturada possui vínculo de repasse.	
6.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctn	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctn	
6.2		GiveUpOnCaptureIndicator	GvUpOnCaptrInd	[1..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates if the captured account has a give up link to an account on another participant.	Indicativo de que a conta capturada possui vínculo de repasse para uma conta em outro participante.	
7.0		TradeParticipantIdentification	TradPtcptId	[0..1]	+		Trade Participant Code.	Código do Participante de Negociação.	
7.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
7.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the investor's account. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	



imb.501.01 – TradeNotificationResponse

Message functionality

The TradeNotificationResponse message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) to accept/reject executed trades.

Rules

N/A.

Message Structure – TradeNotificationResponse (imb.501.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identifications	Ids	[1..1]	+	Transaction Identification 4	Identification assigned by the participant responding to this message.	Identificação atribuída pelo participante que está respondendo essa mensagem.	
1.1		TransactionIdentification	Txid	[1..1]	Max35Text	Max35Text	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		References	Refs	[1..1]	+	Linkages15	Reference to the transaction identifier issued by a participant. It may also be used to reference a previous transaction. Transaction number assigned by the participant who sent the imb.500.01 message	Referência à identificação da transação feita por um participante. Também é usado para fazer referência a uma operação anterior. Número da transação atribuída pelo participante que enviou a mensagem imb.500.01.	
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+	Identification Reference8 Choice	Reference to a linked transaction.	Referência de uma transação.	
2.1.1	{OR	ExecutingPartyTransactionIdentification	ExctgPtyTxid	[1..1]	Max35Text	Max35Text	Identification of the confirmation transaction as known by the executing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	



3.0		TradingSecurityInformation	TradgSctyInf	[1..1]	+	FinancialInstrumentAttributesBVMF20	Provides information about Trading Securities.	Informações de títulos de negociação.	
3.1		Segment	Sgmt	[1..1]		ExternalSegmentCode	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process.</p> <p>Example: 1 - Equity – Cash 2 - Equity derivatives 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>Exemplos: 1 - Ações – Vista 2 - Ações – Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalSegmentCode no arquivo</p>	



								ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.0		Status	Sts	[1..1]	+	StatusAndReason10	This block contains the acceptance or rejection of the trade.	Este bloco contém informações sobre o aceite ou rejeição de um negócio.	
4.1		AffirmationStatus	AffirmSts	[1..1]	+	AffirmStatus7Choice	This block contains information on acceptance or rejection of the transaction.	Este bloco contém informação do aceite ou rejeição da transação.	
4.1.1		Code	Cd	[1..1]		AffirmStatus1Code	AFFI: Acceptance NAFI: Rejection	AFFI: Aceito NAFI: Rejeitado	
4.2		AdditionalReasonInformation	AddtlRsnInf	[0..1]		Max210Text	Provides additional information about the rejection reason.	Informa o motivo da rejeição referente ao valor financeiro.	
5.0		StatusDate	StsDt	[1..1]	+	DateAndDateTime1Choice	Provides date and time of acceptance or rejection of a trade.	Fornece a data e hora do Status (aceite/rejeição) de uma operação.	
5.1		DateTime	DtTm	[1..1]		ISODatetime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.	



imb.502.01 – SecuritiesAllocationInstruction

Message functionality

The SecuritiesAllocationInstruction message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to request the entry of allocation-by-trade information (identification of the customer's final account, designation of the Master account and other information needed for settlement purposes) and trade give-up.

Rules

N/A.

Message Structure – SecuritiesAllocationInstruction (imb.502.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		PaginationInformation	PgntnInf	[1..1]	+		Provides pagination information.	Fornecer informação sobre a paginação.	
1.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique identification for the group of partitioned messages.	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.1.1		PaginationIdentification	PgntnId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique identification for the group of partitioned messages	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.2		Pagination	Pgntn	[1..1]	+		Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	Número da página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuação, informando se é a última página ou se existem mais.	



1.2.1	PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	string pattern = [0-9]{1,5}	Page number.	Número da página.
1.2.2	LastPageIndicator	LastPglnd	[1..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.
2.0	Identifications	Ids	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.
2.1	TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.
3.0	Reference	Ref	[0..1]	+		This block contains the allocation Identification.	Este bloco contém informações relacionadas ao número de alocações.
3.1	AllocationIdentification	AllcId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Allocation ID number provided by B3.	Número de identificação da alocação atribuído pela B3.
4.0	TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+		Details of the trade.	Detalhes de um bloco de negócio.
4.1	TradeDate	TradDt	[1..1]	+		Provides the date of the trading session..	Fornece a data do pregão.
4.1.1	Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Specified date.	Especifica uma data.
4.2	TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Trade identification.	Número do negócio.
4.3	Side	Sd	[1..1]	Side3Code	string	Coded list to specify the side of the trade. E.g. Buy or Sell The valid codes are BUYI and SELL.	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.



5.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier of a financial instrument, assigned under a formal or proprietary identification schema.	Fornecer detalhes da identificação do instrumento.	
6.0		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+		Provides details of the security identification.	Fornecer detalhes sobre a identificação de um instrumento.	
6.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1	Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock. E.g. BVVF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex: BVVF3	
6.2		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	int	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. Exemplos:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Ações – Vista 2 - Ações – Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalSegmentCode no arquivo</p>	



								ExternalCodeLists_iMERCAD O.xls.
6.3		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	int	<p>A Market represents the second level of market classification in the post trade process.</p> <p>Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Spot Market 2 - Futures Market 3 - Options on Spot 4 - Options on Futures 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalMarketCode</p>	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>Exemplos:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - MERCADO DISPONÍVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPÇÕES SOBRE DISPONÍVEL 4 - OPÇÕES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO A TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCAD O.xls.</p>

7.0		AllocationDetails	AllcnDtIs	[1..*]	+		Specifies how the trades have to be allocated.	Especifica como os negócios devem ser alocados.
7.1		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcnId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and the response.	Número individual de alocação. Esse número é atribuído pelo sistema do participante que envia a mensagem, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e sua resposta.
7.2		CustodianIdentificationAnd Account	CtdnIdAndA cct	[0..1]	+		This block identifies the Custodian ID code and theCustodian Account ID code if the position account captured has a custodian link previously registered.	Este bloco contém a identificação do Agente de Custodia e da conta de custódia, caso a conta capturada possua vínculo de custódia previamente registrada.
7.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+		Provides details of the party identification.	Fornecer detalhes de identificação do participante.
7.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.
7.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. The identification of the party must be informed in the	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. A identificação do participante



							standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)	precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
7.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
7.2.1.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCod e no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
7.2.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
7.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	

7.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
7.3		PartyIdentificationAndAccount	PtyIdAndAccount	[1..1]	+		Provides party identification and account.	Fornece identificação e conta do participante.	
7.3.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+		Provides details of the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
7.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
7.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO. xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3- 123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCAD O.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	



7.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g. iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
7.3.1.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCod e no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
7.3.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Provides account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.	
7.3.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
7.3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
7.4		Quantity	Qty	[1..1]	+		Specifies the quantity related to the allocation.	Especifica a quantidade relacionada a alocação.	



7.4.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	decimal fractionDigit s = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
7.5		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	string maxLength = 5 minLength = 1	Identification of the sub account.	Identificação da carteira na depositária.	



imb.503.01 – SecuritiesLotAllocationInstruction

Message functionality

The SecuritiesLotAllocationInstruction message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to request allocation information by lot (identification of customer's final account identification, Master account designation and other information necessary for settlement purposes) and trade give-up.

Rules

R1. The Distribution Criterion attribute has the ExternalDistributionCriteriaCode with the following options:

- If DistributionCriteria = 1 – Quantity and Price, it will be mandatory to fill out the Quantity and Price fields.
- If DistributionCriteria = 2 - Quantity, it will be mandatory to fill out the Quantity field.
- If DistributionCriteria = 3 - Volume, it will be mandatory to fill out the Quantity field.
- If DistributionCriteria = 4 – Quantity Percentage, it will be mandatory to fill out the PercentageAmount field.

Message Structure – SecuritiesLotAllocationInstruction (imb.503.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		PaginationInformation	PgntnInf	[1..1]	+		Provides pagination information.	Fornecer informação sobre a paginação.	
1.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique identification for the group of partitioned messages.	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.1.1		PaginationIdentification	PgntnId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique identification for the group partitioned messages	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	



1.2		Pagination	Pgntn	[1..1]	+		Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	Número da página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuação, informando se é a última página ou se existem mais.	
1.2.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	string pattern = [0-9]{1,5}	Page number.	Número da página.	
1.2.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	
2.0		Identifications	lds	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
2.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
3.0		TradeLegDetails	TradLegDetails	[1..1]	+		Details of the trade.	Detalhes de um bloco de negócio.	
3.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODate	date	Provides the date of trading session.	Fornecer a data do pregão.	
3.2		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	string	Coded list to specify the side of the trade. E.g. Buy or Sell. The valid codes are BUYI and SELL.	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	
4.0		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttributes	[1..1]	+		Provides details of the security identification.	Fornecer detalhes sobre a identificação de um instrumento.	
4.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1	Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de	



								identificar uma ação.Ex: BVMF3	
4.2		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	int	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. Exemplos:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Ações – Vista 2 - Ações – Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	
4.3		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	int	<p>A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Spot Market 	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. Exemplos:</p>	



							<p>2 - Futures Market 3 - Options on Spot 4 - Options on Futures 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put</p> <p>This field requires an external code list. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external is ExternalMarketCode</p>	<p>1 - MERCADO DISPONÍVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPÇÕES SOBRE DISPONÍVEL 4 - OPÇÕES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO A TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	
5.0		DistributionCriteriaDetails	DstrbtnCrit Dtls	[1..*]	+		<p>Details of distribution criteria.</p>	<p>Fornece o critério de alocação que será aplicado na alocação.</p>	



5.1		DistributionCriteria	DstrbtnCrit	[1..1]	ExternalDistributionCriteriaCode	string maxLength = 2	<p>Criteria that have been used to distribute in the allocation process.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternalDistributionCriteriaCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Critério utilizado para distribuição no processo de alocação.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalDistributionCriteriaCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	R1
5.2		SourcePartyIdentification	SrcPtyId	[0..1]	+		<p>This block contains information of the give-up participant.</p>	<p>Este bloco contém informações do participante origem do repasse.</p>	
5.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p>	<p>Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p>	



5.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLengt h = 35 minLengt h = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>	
5.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLengt h = 35 minLengt h = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo</p>	

							ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.2.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength h = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.3		AdditionalInformation	Addtlnf	[0..1]	Max350Text	string maxLength h = 350 minLength h = 1	Additional information about the Strategy for lot distribution.	Informa a estratégia utilizada para distribuição em lote.	
5.4		TradeParticipantIdentification	TradPtcpld	[0..1]	+		Trade Participant Code.	Código do Participante de Negociação.	
5.4.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength h = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	



5.5		OrderIdentification	Ordrid	[0..1]	Max35Text	string maxLengt h = 35 minLengt h = 1	Unique identifier for Order as assigned by sell-side.	Número da ordem no sistema eletrônico.	
5.6		AllocationDetails	AllcnDtls	[1..*]	+		Specifies how the trades have to be allocated.	Especifica como os negócios devem ser alocados.	
5.6.1		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcnId	[1..1]	Max35Text	string maxLengt h = 35 minLengt h = 1	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and the response.	Número individual de alocação. Esse número é atribuído pelo sistema do participante que envia a mensagem, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e sua resposta.	
5.6.2		CustodianIdentificationAndAccount	CtdnIdAndAcct	[0..1]	+		This block identifies the Custodian ID code and theCustodian Account ID code if the position account captured has a custodian link previously registered.	Este bloco contém a identificação do Agente de Custódia e da conta de custódia, caso a conta capturada possua vínculo de custódia previamente registrada.	
5.6.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+		Provides details of the party identification.	Fornecer detalhes de identificação do participante.	
5.6.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	



<p>5.6.2.1.1.1</p>		<p>Identification</p>	<p>Id</p>	<p>[1..1]</p>	<p>Max35Text</p>	<p>string maxLengt h = 35 minLengt h = 1</p>	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>	
<p>5.6.2.1.1.2</p>		<p>Issuer</p>	<p>Issr</p>	<p>[1..1]</p>	<p>Max35Text</p>	<p>string maxLengt h = 35 minLengt h = 1</p>	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo</p>	



							ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.6.2.1.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.6.2.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Provides account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.	
5.6.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.6.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.6.3		PartyIdentificationAndAccount	PtyIdAndAcct	[1..1]	+		Provides party identification and account.	Fornecer identificação e conta do participante.	
5.6.3.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+		Provides details of the party identification.	Fornecer detalhes de identificação do participante.	
5.6.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a	Identificação única atribuída a uma instituição usando um	

							proprietary identification schema.	schema de identificação proprietária.	
5.6.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength h = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo:</p> <p>Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>	
5.6.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength h = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos</p>	



							the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.6.3.1.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLengt h = 35 minLengt h = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.6.3.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Provides account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.	
5.6.3.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.6.3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLengt h = 35 minLengt h = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.6.4		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	string maxLengt	Identification of the sub account.	Identificação da carteira na depositária.	



						h = 5 minLengt h = 1			
5.6.5		Quantity	Qty	[0..1]	+		Specifies the quantity related to the allocation.	Especifica a quantidade relacionada a alocação.	
5.6.5.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	decimal fractionDi gits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
5.6.6		Price	Pric	[0..1]	+		Specifies the price of the traded financial instrument.	Especifica o preço (médio) do instrumento pelo qual a alocação será efetuada.	
5.6.6.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDi gits = 13 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em moeda e valor.	
5.6.7		PercentageAmount	PctgAmt	[0..1]	+		Is the percentage amount that is allocated. (Example: 20% will be allocated to the client 1 and 80% will be allocated to the client 2).	É o percentual da quantidade que será alocada. (Exemplo: 20% será alocada para o cliente 1 e 80% será alocada para o cliente 2).	
5.6.7.1		Percentage	Pctg	[1..1]	PercentageRate	decimal fractionDi gits = 10 totalDigits = 11	Percentage of amount invested in a funds.	Porcentagem do montante investido em um dos fundos.	



imb.504.01 – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice

Message functionality

The SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado and sends the allocation request status (receipt of allocation request, give-up confirmation, allocation exclusion entry by the Clearinghouse).

Rules

R1. Only option for this block.

Message Structure – SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice (imb.504.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		PaginationInformation	PgntnInf	[1..1]	+		Provides pagination information.	Fornecer informação sobre a paginação.	
1.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique identification for the group partitioned messages.	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.1.1		PaginationIdentification	PgntnId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique identification for the group partitioned messages	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.2		Pagination	Pgntn	[1..1]	+		Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	Número da página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuação, informando se é a última página ou se existem mais.	
1.2.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	string pattern = [0-9]{1,5}	Page number.	Número da página.	

1.2.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	
2.0		Identifications	Ids	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
2.1		TransactionIdentification	Txld	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
3.0		References	Refs	[0..1]	+		Reference to the transaction identifier issued by a business party. It may also be used to reference a previous transaction. Transaction number assigned by the participant who sent the message imb.502.01 and imb.505.01.	Referência à identificação da transação feita por um participante. Também é usado para fazer referência a uma operação anterior. Número da transação atribuída pelo participante que enviou a mensagem imb.502.01 ou a imb.505.01.	R2
3.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	
3.1.1	{OR}	ExecutingPartyTransactionIdentification	ExctgPtyTxld	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification of the confirmation transaction as known by the executing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	R1
4.0		PartyIdentification	Ptyld	[1..1]	+		This block identifies the participant who will receive the "Status Advice" message.	Este bloco identifica o participante que receberá a mensagem "Status Advice".	
4.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos	

							external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).
4.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.
4.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações.

							external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.0		TradeLegDetails	TradLegDtIs	[0..1]	+		This block provides details of the trade.	Este bloco fornece detalhes do negócio.	
5.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+		Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
5.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2		TradeIdentification	TradId	[0..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Trade identification.	Número do negócio.	
5.3		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	string	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL.	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	
6.0		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttributes	[0..1]	+		Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam o instrumento financeiro.	
6.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1	Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex: BVMF3	
6.2		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	int	A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial	Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo: 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio	



							<p>6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_iMERCAD O.xls</p>	<p>5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCAD O.xls.</p>	
6.3		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	int	<p>A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <p>1 - Spot Market 2 - Futures Market 3 - Options on Spot 4 - Options on Futures 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put</p> <p>This field requires an external code list. These codes and values were made in external</p>	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>Exemplos:</p> <p>1 - MERCADO DISPONÍVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPÇÕES SOBRE DISPONÍVEL 4 - OPÇÕES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO A TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC</p>	



							spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the B3 updates. In this case the external is ExternalMarketCode.	80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
7.0		AllocationInformation	AllcnInf	[0..*]	+		Specifies how the trades have to be allocated.	Especifica como o negócio deve ser alocado. Este bloco contém a situação de alocação negócio a negócio.	
7.1		AllocationIdentification	AllcnId	[0..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Allocation ID number provided by BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação atribuído pela BM&FBOVESPA.	
7.2		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcnId	[0..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and the response.	Número individual de alocação. Esse número é atribuído pelo sistema do participante que envia a mensagem, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e sua resposta.	
7.3		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+		Identification of the account owned by the party.	Identificação da conta do investidor.	
7.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	



7.3.1.1	Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
7.4	SecurityAccountType	SctyAcctTp	[1..1]	ExternalSecurityAccountType Code	int	Identifies the Account Type in which the trade is allocated. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalSecurityAccountType Code in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Identifica o tipo de conta em que o negócio é alocado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityAccountType Code no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls
7.5	AllocatedQuantity	AllctdQty	[0..1]	+		Specifies the trade quantity to be allocated.	Especifica a quantidade destinada à alocação.
7.5.1	Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.
7.6	CustodianIdentificationAndAccount	CtdnIdAndAcct	[0..1]	+		This block identifies the Custodian ID code and the Custodian Account ID code if the position account captured has a custodian link previously registered.	Este bloco contém a identificação do Agente de Custódia e da conta de custódia, caso a conta capturada possua vínculo de custódia previamente registrada.
7.6.1	PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+		Provides details about the party identification.	Fornecer detalhes de identificação do participante.
7.6.1.1	ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um esquema de identificação proprietária.



7.6.1.1 .1	Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>
7.6.1.1 .2	Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>
7.6.1.1 .3	SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength	<p>Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE</p>	<p>Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO</p>



						h = 35 minLength = 1	IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
7.6.2	AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+			Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
7.6.2.1	Proprietary	Prtry	[1..1]	+			Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
7.6.2.1.1	Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1		Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
7.7	SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	string maxLength = 5 minLength = 1		Identification of the sub account.	Identificação da carteira na depositária.	
7.8	GrossTradeAmount	GrssTradAmt	[0..1]	+			This block informs the gross trade amount.	Este bloco informa o volume bruto negociado.	
7.8.1	Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18		Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
7.8.2	CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string		Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	



7.9	AllocationStatus	AllcnSts	[1..1]	+			This structure provides the status and/or the error of the allocations requested or final give-up status.	Essa estrutura identifica a situação e/ou o erro de cada processamento das alocações e situação final de repasse solicitado
7.9.1	ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+			Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.
7.9.1.1	StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	string maxLength = 10 minLength = 1		Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external file is ExternalStatusAllocationAdviceCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalStatusAllocationAdviceCode localizado no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls
7.9.2	ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+			Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.
7.9.2.1	RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	string maxLength = 10 minLength = 1		Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.
8.0	AllocationInstructionStatus	AllcnInstrSts	[1..1]	+			This block identifies the allocation status request	Este bloco contém a situação da solicitação de alocação e/ou o erro encontrado para a solicitação.
8.1	ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+			Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.
8.1.1	StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	string maxLength = 10		Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem.



						minLength = 1	code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external file is ExternalAllocationInstructionS tatus in the file ExternalCodeLists_iMERCAD O.xls	Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalAllocationInstructionS tatus localizado no arquivo ExternalCodeLists_iMERCAD O.xls	
8.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+		Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	
8.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1.. 1]	Max10Text	string maxLength = 10 minLength = 1	Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	



imb.505.01 – SecuritiesAllocationInstructionCancellation

Message functionality

The SecuritiesAllocationInstructionCancellation message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) as a requirement for allocation exclusion.

Rules

N/A.

Message Structure – SecuritiesAllocationInstructionCancellation (imb.505.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identifications	Ids	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
1.1		TransactionIdentification	Txld	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		PartyIdentification	Ptyld	[1..1]	+		Participant who is submitting the allocation cancellation.	Participante que solicita o cancelamento da alocação.	
2.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única e inequívoca, como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	



2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternaliMercadoRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternaliMercadoRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	

2.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCod e no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+		Provides details of the security identification.	Fornecer detalhes da identificação do instrumento.	
3.1		OtherIdentification	OthrId	[0..1]	+		Identification of a security by proprietary or domestic identification schema.	Este bloco contém a identificação proprietária de um instrumento.	
3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification of a security.	Identificação de um instrumento.	
3.1.2		Type	Tp	[1..1]	+		Identification type.	Tipo da identificação.	
3.1.2.1		Code	Cd	[1..1]	ExternalFinancialInstrumentIdentificationType1Code	string maxLength = 4 minLength = 1	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = EXCH.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = EXCH.	
4.0		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+		Provides details of the security identification.	Fornecer detalhes sobre a identificação de um instrumento.	



4.1		TickerSymbol	TckrSym b	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1	Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.	Código que identifica um instrumento negociado/registrado em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar um instrumento.	
4.2		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	int	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Equity – Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternalSegmentCode in</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo</p>	



							the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.3		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	int	<p>Represents the second level of market classification in the post-trading process.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external code is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	
5.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+		This block provides details of the trade.	Este bloco fornece detalhes do negócio.	
5.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+		Provides the date of trading session.	Fornece a data do pregão.	
5.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Specified date.	Especifica uma data.	
5.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Trade identification.	Número do negócio.	



5.3		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	string	Coded list to specify the side of the trade. E.g. Buy or Sell. The valid codes are BUYI and SELL.	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	
6.0		References	Refs	[1..1]	+		This block identifies the individual allocation identification assigned by the participant.	Este bloco identifica o número de alocação individual atribuído pelo participante.	
6.1		AllocationIdentification	AllcId	[0..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Allocation ID number provided by BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação atribuído pela BM&FBOVESPA.	
6.2		IndividualAllocationIdentification	IndvAllcId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Individual Allocation ID. Control ID assigned on each allocation request message by the participant. This number allows participants match the allocation leg request and the response.	Número individual de alocação. Esse número é atribuído pelo sistema do participante que envia a mensagem, permitindo a correspondência entre a alocação enviada (leg) e sua resposta.	
7.0		Quantity	Qty	[1..1]	+		Quantity to be cancelled.	Especifica a quantidade a ser cancelada da alocação.	
7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
8.0		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Account ID to be cancelled.	Identificação da conta a ser cancelada da alocação.	
8.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	



Definition – Message Catalogue

Date: Apr. 25, 2019

iMercado - Capture, Allocation and Give-up

8.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
-------	--	----------------	----	--------	-----------	---	--	---	--



imb.506.01 TradeLegNotificationCancellation

Message functionality

The TradeLegNotificationCancellation message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado notifying it of trade cancellation.

Rules

N/A.

Message Structure – TradeLegNotificationCancellation (imb.506.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+		This block identifies the clearing member of the participant who is receiving the message.	Este bloco identifica o membro de compensação do participante que está recebendo a mensagem.	
1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso</p>	



							BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternaliMercadoRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	o externo é ExternaliMercadoRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
1.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCod e no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	



2.0		ClearingAccount	ClrAcct	[1..1]	+		This block is not used by BM&FBOVESPA.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.
2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value "NoFilled".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default= "NoFilled".
2.2		Type	Tp	[1..1]	ClearingAccountType1 Code	string	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = CLIE.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = CLIE.
3.0		TradeLegDetails	TradLegDtl s	[1..1]	+		This block provides details of the trade.	Este bloco fornece detalhes do negócio.
3.1		AllocationIdentification	AllcId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Allocation ID number provided by BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação atribuído pela BM&FBOVESPA.
3.2		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODatetime	dateTime	Provides the date of trading session.	Fornece a data do pregão.
3.3		SettlementDate	StlmDt	[1..1]	+		This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = 1900-01-01	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. O conteúdo a ser preenchido está definido no campo abaixo. com o valor 1900-01-01.
3.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário
3.4		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+		Provides details of the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.

3.4.1		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	string pattern = [A-Z0-9]{12,12}	<p>INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER (ISIN). A numbering system designed to standardize the codes of financial securities internationally. The code for Brazilian securities has the BR AAAA BB CC 7 structure, where:</p> <p>a) The two-character prefix (BR) identifies the code for the country of issue (BRAZIL)</p> <p>b) The four characters (AAAA) are alpha-numeric characters and identify the issuer.</p> <p>c) The three characters (BBB) are alpha-numeric characters and identify the type of security. It may have an automatic sequence in the second position (Sequence 1) and in the third position (Sequence 2) or have no sequence at all.</p> <p>d) The two characters (CC) are alpha-numeric characters and identify the type, when it is a stock, or represent an automatic sequence to identify each security issue, when it is a different asset category.</p> <p>e) The last character (7) is the control digit.</p>	<p>INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER – É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7, onde:</p> <p>a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL;</p> <p>b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor;</p> <p>c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter sequência automática na segunda posição (sequência 1) e na terceira posição (sequência 2) ou não ter qualquer sequência;</p> <p>d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma sequência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias; e</p>	
-------	--	------	------	--------	----------------	--	--	--	--



								e) o último caractere (7) é o dígito de controle.	
3.5		BuySellIndicator	BuySellInd	[1..1]	Side1Code	string	Identifies the trade leg indicator which gives the trade side (buy or sell).	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUY1 e SELL.	
3.6		TradeQuantity	TradQty	[1..1]	+		Identifies the cancelled quantity.	Quantidade cancelada.	
3.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	

3.7		PlaceOfTrade	PlcOfTrad	[1..1]	+			This field is not used by the BM&FBOVESPA. The default content of this field is defined in the Code field.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.
3.7.1		Type	Tp	[1..1]	+			This block is not used by BM&FBOVESPA. See "Code" field in the default value of this field.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Veja no campo Code o valor default deste campo.
3.7.1.1		Code	Cd	[1..1]	MarketType2Code	string		This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = EXCH.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o default = EXCH.
3.8		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+			Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.
3.8.1		Identification	Id	[1..1]	+			Code allocated to places of trade, ie, stock exchanges, regulated markets, eg, Electronic Trading Platforms (ECN), and unregulated markets, e.g, Automated Trading Systems (ATS), as sources of prices and related information, in order to facilitate automated processing.	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado.
3.8.1.1		MarketIdentifierCode	MktldrCd	[1..1]	MICIdentifier	string pattern = [A-Z0-9]{4,4}		Market Identifier Code. Identification of the exchange as stipulated in the ISO 10383 standard "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Securities Exchange is provided - it is assumed to be a B3 instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador da bolsa em que o instrumento está listado. Identificação do mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383. Default = "BVMF".
3.8.2		Type	Tp	[1..1]	+			This field is not used by the BM&FBOVESPA.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.
3.8.2.1		Code	Cd	[1..1]	MarketType5Code	string		This field is not used by the BM&FBOVESPA. It must be filled with the Default Value = EXCH.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. O conteúdo a ser preenchido deve ser igual a "EXCH".



3.9		TradeType	TradTp	[1..1]	TradeType1Code	string	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = LKTR.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = LKTR.	
3.10		TradingParty	TradgPty	[1..1]	+		Participant ID code.	Identificação do código do participante.	
3.10.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.10.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternaliMercadoRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternaliMercadoRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.10.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode	



							ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.10.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode e no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.11		TradingCapacity	TradgCpty	[1..1]	TradingCapacity5Code	string	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = PRIN.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default =PRIN.	
4.0		SettlementDetails	SttlmDtls	[1..1]	+		This field is not used by the BM&FBOVESPA.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	
4.1		SettlementAmount	SttlmAmt	[1..1]	+		This block is not used by the BM&FBOVESPA.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA.	
4.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	



5.0		SupplementaryData	SplmtryData	[0..*]	+		Optional element, which allows additional data to be located at some specific point in the message if necessary (PlaceAndName). Used to incorporate the BM&FBOVESPA extensions. These extensions are data or concepts that are not supported by the ISO message, but are necessary for the Brazilian market.	Elemento opcional, que permite que dados adicionais sejam localizados em algum ponto específico na mensagem se necessário (PlaceAndName). Usados para incorporar as extensões BM&FBOVESPA. Essas extensões são dados ou conceitos que não são suportados pela mensagem ISO, porém, são necessários para o mercado brasileiro.	
5.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[0..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. In this case, the XPATH must be used.	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. Neste caso, deve ser usado o XPATH.	
5.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+		Technical element involving complementary data. In the case of an XML file, it must be validated by a new XSD schema.	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	
5.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+		Technical element that specifies the supplementary data. Must be included the supplementary data XML structure in this point.	Elemento técnico que especifica os dados complementares.	

Supplementary Data - SUPL.506.01 – TradeLegNotificationCancellationSD

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identifications	Ids	[1..1]	+		Unambiguous identification of the transaction as known by the instructing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	

1.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended //Document/TradLegNtfctnCxl	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctnCxl	
1.2		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unambiguous identification of the transaction as known by the instructing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		FinancialInstrumentAttributesInformation	FinInstrmAttrbsInf	[1..1]	+		Informations of the elements characterising a financial instrument.	Informações das características de um instrumento.	
2.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctnCxl	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctnCxl	
2.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1	Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex: BVMF3	
2.3		DistributionIdentification	DstrbtId	[0..1]	int	int	Distribution code of the instrument.	Número de distribuição do papel.	
3.0		TradeLegDetailsExtension	TradLegDtlsXtnsn	[1..1]	+		This block contains information related to the trade that was not covered by ISO message.	Este bloco contém informações relacionadas ao negócio que não foram contempladas pela mensagem ISO.	

3.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctnCxl/TradLegDtls	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctnCxl/TradLegDtls	
3.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Trade identification.	Número do negócio.	
3.3		LotCode	LotCd	[0..1]	int	int	A Unique identification for this ETF trade in the depository	Identificador unico da operação do ETF na depositária.	
4.0		GiveUpOnCaptureIndicator	GvUpOnCaptrInd	[1..1]	+		Indicates if the captured account has a give up link to an account on another participant.	Indicativo de que a conta capturada possui vínculo de repasse para uma conta em outro participante.	
4.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctnCxl	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctnCxl	
4.2		GiveUpOnCaptureIndicator	GvUpOnCaptrInd	[1..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates if the captured account has a give up link to an account on another participant.	Indicativo de que a conta capturada possui vínculo de repasse para uma conta em outro participante.	
5.0		TradeLegInformationCancellation	TradLegInfCxl	[0..1]	+		Block with the cancellation of trade information.	Bloco com informações do cancelamento do negócio.	
5.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. XPath to the element that is being extended is //Document/TradLegNtfctnCxl	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/TradLegNtfctnCxl	



5.2		TradeLegDetailsCancellation	TradLegDtIsCxl	[1..1]	+		Block with the details of trade information.	Bloco com detalhes do cancelamento do negócio.	
5.2.1		TradeCancellationDateTime	TradCxlDtTm	[1..1]	ISODateTime	dateTime	Trade Cancellation Date and Time	Informa a data e hora da realização do cancelamento.	
5.2.2		TradeRemainingQuantity	TradRmngQty	[0..1]	DecimalNumber	decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Remaining Quantity of the trade.	Indica a quantidade remanescente após o cancelamento.	
5.2.3		CancellationJustification	CxlJustfn	[0..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Inform the cancellation of the trade justification.	Informa a justificativa do cancelamento do negócio.	



imb.507.01 – InvoiceNotification

Message functionality

The InvoiceNotification message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado and provides detailed trade information (brokerage bill) after the close of trading.

Rules

N/A.

Message Structure – InvoiceNotification (imb.507.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		PaginationInformation	PgntnInf	[1..1]	+		Provides pagination information.	Fornecer informação sobre a paginação.	
1.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique identification for the group of partitioned messages.	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.1.1		PaginationIdentification	PgntnId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique identification for the group partitioned messages	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.2		Pagination	Pgntn	[1..1]	+		Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	Número da página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuação, informando se é a última página ou se existem mais.	

1.2.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	string pattern = [0-9]{1,5}	Page number.	Número da página.	
1.2.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	
2.0		TradingParty	TradgPty	[1..1]	+		Trading Participant's ID code.	Código do Participante de Negociação Pleno que realizou o negócio.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	



							<p>The identification of the party must be informed in the standard below:</p> <p>Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo:</p> <p>Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	
2.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCo de in the file</p>	<p>Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationType</p>	



							ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Code no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.0		InvoiceDetails	InvcDtls	[1..*]	+		Contains invoice details.	Detalhes da nota de corretagem.	
3.1		InvoiceIdentification	InvclId	[1..1]	Max9Text	string maxLength = 9 minLength = 1	Identifies each invoice.	Número da Nota de Corretagem. Até nove inteiros para o Segmento Bovespa e até seis inteiros para o Segmento BM&F.	
3.2		CancelledInvoiceIndicator	CanclInvclnd	[1..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates whether the invoice was cancelled.	Indica se é uma nota de corretagem cancelada.	
3.3		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Identifies the investor account	Identificação da conta do investidor.	
3.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	



3.4		SecurityAccountType	SctyAcctTp	[1..1]	ExternalSecurityAccountTypeCode	int	Identifies the Account Type in which the trade is allocated. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalSecurityAccountTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Identifica o tipo de conta em que o negócio é alocado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityAccountTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	
3.5		ServiceTaxPaymentCity	SvcTaxPmtCity	[1..1]	+		This field indicates the service tax (ISS) payment city.	Indica o município de recolhimento do ISS.	
3.5.1		TownName	TwnNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Name of a built-up area, with defined boundaries, and a local government.	Nome da cidade.	
3.6		TradeAndInstrumentDetails	TradAndInstrmDtls	[0..*]	+		Details of trade and instruments	Detalhes sobre o negócio e o instrumento.	
3.6.1		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+		Elements characterising a financial instrument	Elementos que caracterizam um instrumento.	



3.6.1.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1	Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
3.6.1.2		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	int	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Equity – Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalSegmentCode in</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>Exemplos:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Ações – Vista 2 - Ações – Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é</p>	



							the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.6.1.3		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	int	<p>A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Spot Market 2 - Futures Market 3 - Options on Spot 4 - Options on Futures 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put 	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>Exemplos:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - MERCADO DISPONÍVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPÇÕES SOBRE DISPONÍVEL 4 - OPÇÕES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO A TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV 	



							This field requires an external code list. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external is ExternalMarketCode	Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.6.1.4		ExpirationDate	XprtnDt	[0..1]	+		Date on which a instruments expires.	Data de expiração do instrumento.	
3.6.1.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
3.6.2		SettlementDate	StlmDt	[1..1]	+		Date at which the securities are to be delivered or received.	Data de liquidação.	
3.6.2.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
3.6.3		TradeDate	TradDt	[1..1]	+		Provides the date of trading session.	Fornece a data do pregão.	
3.6.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	



3.6.4		DaysToSettlement	DaysToSttlm	[0..1]	Max4Text	string maxLength = 4 minLength = 1	Indicates number of days settlement in a forward's contract	Prazo em dias para a liquidação do contrato.	
3.6.5		BillingServiceTypeIdentification	BllgSvcTpld	[1..1]	ExternalBillingServiceTypeCode	int	Provides identification about billing service type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalBillingServiceTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Fornece a identificação do tipo de serviço faturado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalBillingServiceTypeCode.xls no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	
3.6.6		BuySellIndicator	BuySellInd	[1..1]	Side1Code	string	Coded list to specify the side of the trade. E.g. Buy or Sell. The valid codes are BUYI and SELL.	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	
3.6.7		TradeQuantity	TradQty	[1..1]	+		Identifies the quantity of the trade leg.	Quantidade negociada.	



3.6.7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.6.8		DealPrice	DealPric	[1..1]	+		Specifies the price of the traded financial instrument.	Valor do ativo.	
3.6.8.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em moeda e valor.	
3.6.9		GrossTradeAmount	GrssTradAmt	[0..1]	+		Trade variation margin.	Este bloco informa o volume negociado.	
3.6.9.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em moeda e valor.	
3.6.10		InstrumentAdjustedValue	InstrmAdjstdVal	[0..1]	+		Asset variation margin.	Valor de ajuste do ativo ou mercadoria.	
3.6.10.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em moeda e valor.	



3.6.11		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	int	Specifies how the transaction is to be settled, for example, against payment. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalPaymentTypeCode at ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	<p>Especifica como a transação deve ser liquidada. "Contra pagamento" por exemplo.</p> <p>Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	
3.6.12		DayTradeIndicator	DayTradInd	[0..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates whether it is a day trade transaction or not.	Indica se é uma operação de Day Trade ou não.	
3.6.13		TradeRegistrationOrigin	TradRegnOrgn	[0..1]	Max50Text	string minLength = 1 maxLength = 50	Indicates trade session origin. E.g: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	Código da sessão de origem do negócio. Ex: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	
3.7		InvoiceValues	InvcVals	[0..*]	+		Contains the information for each expense and his type.	Este bloco contém detalhes de cada despesa relacionada e seu tipo.	



3.7.1		ExpensesType	ExpnssTp	[1..1]	ExternalExpensesTypeCode	string maxLength = 2	Indicates the type of expenses contained in the invoice. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalExpensesTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Indica o tipo de despesa contida na nota de corretagem. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalExpensesTypeCode.xls no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	
3.7.2		OtherExpensesDescription	OthrExpnssDesc	[0..1]	Max15Text	string maxLength = 15 minLength = 1	Describes other expenses.	Descreve outras despesas cobradas.	
3.7.3		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	+		Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se o lançamento é relacionado a um crédito ou um débito.	
3.7.3.1		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[1..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
3.7.4		ExpensesValue	ExpnssVal	[1..1]	+		Expense Value	Valor da despesa.	



Definition – Message Catalogue

Date: Apr. 25, 2019

iMercado - Capture, Allocation and Give-up

3.7.4.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em moeda e valor.	
---------	--	--------	-----	--------	--	---	--	----------------------------------	--



imb.508.01 – ETFTradeNotification

Message functionality

The ETFTradeNotification message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado and provides detailed Primary ETF information.

Rules

N/A.

Message Structure – ETFTradeNotification (imb.508.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		PaginationInformation	PgntnInf	[1..1]	+		Provides pagination information.	Fornecer informação sobre a paginação.	
1.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique identification for the group of partitioned messages.	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.1.1		PaginationIdentification	PgntnId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique identification for the group partitioned messages	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.2		Pagination	Pgntn	[1..1]	+		Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	Número da página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuação, informando se é a última página ou se existem mais.	



1.2.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	string pattern = [0-9]{1,5}	Page number.	Número da página.	
1.2.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	
2.0		Identifications	Ids	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
2.1		TransactionIdentification	Txld	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
3.0		PartyIdentification	Ptyld	[1..1]	+		This block contains the participant identification.	Este bloco contém a identificação do participante.	
3.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	



3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength h = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below:</p> <p>Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo:</p> <p>Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>	
3.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength h = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	



3.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode e no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.0		ETFTradeInformation	ETFTRadInf	[1..1]	+		Sends the ETF trade information.	Informa os dados da negociação do trade do ETF.	
4.1		LotCode	LotCd	[1..1]	int	int	A Unique identification for this ETF trade in the depository	Identificador unico da operação do ETF na depositária.	
4.2		ETFType	ETFTp	[1..1]	ExternalETFTypeCode	int	This field is used for information of ETF Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalETFTypeCode at ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.	Este campo é utilizado para informar os tipos de ETF. Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalETFTypeCode no arquivo	



								ExternalCodeLists_iMERCAD O_BVMF.xls.	
4.3		TradeDate	TradDt	[1.. 1]	ISODate	date	Provides the date of trading session.	Fornece a data do pregão.	
4.4		OperationType	OprnTp	[1.. 1]	ExternalOperationTypeCode	int	<p>Informa if the current operation is an application or a redemption.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalOperationTypeCode</p> <p>at ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.</p>	<p>Informa se a operação corrente é aplicação ou resgate.</p> <p>Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalOperationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCAD O_BVMF.xls.</p>	
4.5		DaysToSettlement	DaysToSttl m	[1.. 1]	Max4Text	string maxLength h = 4 minLengt h = 1	Indicates number of days to settlement.	Prazo em dias para liquidação.	



4.6		PaymentType	PmtTp	[1..1]	ExternalPaymentTypeCode	int	<p>Specifies how the transaction is to be settled, for example,</p> <p>0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalPaymentTypeCode at ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.</p>	<p>Especifica como a transação deve ser resolvida, EX:</p> <p>0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts</p> <p>Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.</p>	
4.7		MovementType	MvmntTp	[1..1]	ExternalMovementTypeCode	string maxLength = 2	<p>This field identifies if the quantities/values informed in the message are provisory or final ones.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalMovementTypeCode</p>	<p>Este campo identifica se as quantidades /valores informado na mensagem são provisório ou definitivo.</p> <p>Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é</p>	



							ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.	ExternalMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.	
4.8		FundAdministrationRate	FndAdmstnRate	[1..1]	PercentageRate	decimal fractionDigits = 10 totalDigits = 11	This field informs the management fee of the fund. The fund reports the value and B3 uses the data to generate the financial negotiation.	Este campo informa a taxa de administração do fundo. O fundo informa o valor e a B3 utiliza os dados para gerar o financeiro da negociação	
4.9		AdjustmentValue	AdjstmntVals	[0..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	The adjustment is the difference between share funds against the basket.	O ajuste é a diferença entre o valor da cota contra a cesta.	
4.10		OtherValues	OthrVals	[0..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Other values charged. It is a value that the fund manager can send as extra charge of a creation/redemption that does not fall in the fund administration rate or adjustment value.	Outros valores cobrados. É um valor que o administrador do fundo pode enviar como cobrança extra de uma emissão/resgate que não se enquadra na taxa de administração do fundo ou ajuste de valores.	
5.0		ETFTradeDetails	ETFTradDetails	[1..*]	+		Provides the details of trades associated with the ETF business.	Fornece os detalhes de trades associados ao negócio ETF.	



5.1		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Trade identification.	Numero do negócio.	
5.2		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	string	Coded list to specify the side of the trade. E.g. Buy or Sell. The valid codes are BUY1 and SELL.	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUY1 e SELL	
5.3		TradeQuantity	TradQty	[1..1]	+		Shows the quantity of financial ETF instruments.	Apresenta a quantidade de instrumentos financeiros ETF.	
5.3.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
5.4		DealPrice	DealPric	[1..1]	+		Specifies the price of the traded financial instrument.	Especifica o preço do instrumento financeiro negociado.	
5.4.1		Value	Val	[1..1]	+		Price value traded	Valor da cotação negociada.	
5.4.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Price value traded	Valor da cotação negociada.	

5.5	FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttributes	[1..1]	+		This block contains request's parameters of elements characterizing a financial instrument.	Fornecer detalhes da identificação do instrumento.	
5.5.1	Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	int	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Equity – Cash 2 - Equity derivatives 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX <p>This field requires an external code list. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the B3 updates. In this case the external is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. Exemplos:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Ações – Vista 2 - Ações – Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	



5.5.2	Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	int	<p>A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Spot Market 2 - Futures Market 3 - Options on Spot 4 - Options on Futures 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put <p>This field requires an external code list. These codes and values were made on external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the updates requirements from the BVMF. In this case the external code is ExternalMarketCode. In the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>Exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma</p>
-------	--------	-----	--------	--------------------	-----	---	---



									manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	
5.6		SecurityIdentification	Sctyld	[1..1]	+			This block contains the Security Identification.	Este bloco contém as informações de código da negociação.	
5.6.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1		Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Exemplo: BVMF3	
5.7		Allocation	Allcn	[1..1]	+			This block identifies the allocation identification.	Este bloco identifica o código de alocação.	
5.7.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1		Allocation ID number provided by B3.	Número de identificação da alocação atribuído pela B3.	
5.8		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+			Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	

5.8.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.
5.8.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
5.9		SecurityAccountType	SctyAcctTp	[1..1]	ExternalSecurityAccountTypeCode	int	Identifies the Account Type in which the trade is allocated. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalSecurityAccountTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Identifica o tipo de conta em que o negócio é alocado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityAccountTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls
5.10		CustodianInformation	CtdnInf	[1..1]	+		Identifies the Custodian ID code and the Custodian Account ID.	Contém as informações do agente de custódia e conta de custódia.
5.10.1		PartyIdentification	Ptyld	[1..1]	+		Provides details of the party identification.	Fornecer detalhes de identificação do participante.
5.10.1.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.



<p>5.10.1.1.1</p>		<p>Identification</p>	<p>Id</p>	<p>[1..1]</p>	<p>Max35Text</p>	<p>string maxLength = 35 minLength = 1</p>	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>	
<p>5.10.1.1.2</p>		<p>Issuer</p>	<p>Issr</p>	<p>[1..1]</p>	<p>Max35Text</p>	<p>string maxLength = 35 minLength = 1</p>	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	



5.10.1.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLengt h = 35 minLengt h = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCod e no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
5.10.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Provides account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.	
5.10.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.10.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLengt h = 35 minLengt h = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.11		SubAccountIdentification	SubAcctId	[1..1]	+		Provides identification of the sub account.	Fornecer a identificação da carteira na depositária.	
5.11.1		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	string maxLengt h = 5 minLengt h = 1	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	



Definition – Message Catalogue

Date: Apr. 25, 2019

iMercado - Capture, Allocation and Give-up

5.12		GiveUpInformation	GvUpInf	[0..1]	+		This block informs if the captured account has a give-up link.	Este bloco informa se a conta capturada possui vínculo de repasse.	
5.12.1		GiveUpOnCapture	GvUpOnCaptr	[1..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates if the captured account has a give up link to an account on another participant.	Indicativo de que a conta capturada possui vínculo de repasse para uma conta em outro participante.	



imb.509.01 – InformGiveUpPendingApproval

Message functionality

The InformGiveUpPendingApproval message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado and provides details of the give-up pending acceptance or rejection.

Rules

- R1.** The trades were received as take-ups and await acceptance or rejection from the Take-up Participant.
- R2.** This field will be filled out only for equities.
- R3.** The fields of this block will only be filled out for Primary ETF trades.
- R4.** This field is only related to the Take-up Participant's account.

Message Structure – InformGiveUpPendingApproval (imb.509.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identifications	lds	[1..1]	+		Unique identification for the group of partitioned messages.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
1.1		TransactionIdentification	Txid	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		SourcePartyIdentification	SrcPtyId	[0..1]	+		This block contains information of the give-up participant.	Este bloco contém informações do participante origem do repasse.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

							proprietary identification schema.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo</p>



								ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
2.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.0		DestinationPartyInformation	DstnPtyInf	[1..1]	+		This block contains information about the take-up participant ID and the take-up account ID.	Este bloco contém informações do participante e conta destino do repasse.	
3.1		PartyIdentification	Ptyld	[1..1]	+		Provides details of the party identification.	Fornecer detalhes de identificação do participante.	
3.1.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	



3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below:</p> <p>Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>	
3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	



3.1.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Provides account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.	
3.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.0		AccountDetails	AcctDtls	[1..1]	+		Provides information about account details.	Fornecer informações sobre detalhes da conta.	



4.1		SecurityAccountType	SctyAcctTp	[1..1]	ExternalSecurityAccountTypeCode	int	<p>Identifies the Account Type in which the trade is allocated.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalSecurityAccountTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Identifica o tipo de conta em que o negócio é alocado.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityAccountTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	R4
5.0		GiveUpInformation	GvUpInf	[1..1]	+		Details of the Give Up.	Este bloco contém informações relacionadas ao repasse.	
5.1		Quantity	Qty	[1..1]	+		Give-up quantity.	Quantidade repassada.	
5.1.1		Unit	Unit	[1..1]		DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
6.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+		Provides details of the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	

6.1	ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	string pattern = [A-Z0-9]{12,12}	<p>INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER (ISIN). A numbering system designed to standardize the codes of financial securities internationally. The code for Brazilian securities has the BR AAAA BB CC 7 structure, where:</p> <p>a) The two-character prefix (BR) identifies the code for the country of issue (BRAZIL)</p> <p>b) The four characters (AAAA) are alpha-numeric characters and identify the issuer.</p> <p>c) The three characters (BBB) are alpha-numeric characters and identify the type of security. It may have an automatic sequence in the second position (Sequence 1) and in the third position (Sequence 2) or have no sequence at all.</p> <p>d) The two characters (CC) are alpha-numeric characters and identify the type, when it is a stock, or represent an automatic sequence to identify each security issue, when it is a different asset category.</p> <p>e) The last character (7) is the control digit.</p>	<p>INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER – É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7, onde:</p> <p>a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL;</p> <p>b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor;</p> <p>c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter sequência automática na segunda posição (sequência 1) e na terceira posição (sequência 2) ou não ter qualquer sequência;</p> <p>d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma sequência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias; e</p>	
-----	------	------	--------	----------------	--	--	--	--



								e) o último caractere (7) é o dígito de controle.	
7.0		SecurityIdentification	Sctyld	[1..1]	+		This block contains the Ticker Symbol.	Este bloco contém informações do bloco de negociação.	
7.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1	Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.	Código que identifica um instrumento negociado/registrado em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar um instrumento.	
8.0		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+		Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
8.1		DistributionIdentification	Dstrbtnd	[0..1]	int	int	Distribution code of the instrument.	Número de distribuição do papel.	



8.2		Segment	Sgmt	[1..1]	ExternalSegmentCode	int	<p>A Segment represents the first level of market classification in the post trade process.</p> <p>Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Equity - Cash 2 - Equity derivative 3 - Corporate bonds 4 - Agribusiness 5 - Financial 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls</p>	<p>Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>Exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Ações - Vista 2 - Ações - Derivativos 3 - Renda fixa privada 4 - Agronegócio 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.</p>	
-----	--	---------	------	--------	---------------------	-----	---	--	--



8.3	Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	int	<p>A Market represents the Second level of market classification in the post trade process.</p> <p>Example:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external code is ExternalMarketCode in the file</p>	<p>Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação.</p> <p>Exemplo:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para</p>
-----	--------	-----	--------	--------------------	-----	---	--



							ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls	permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls	
8.4		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	decimal fractionDigits = 10 totalDigits = 11	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	
8.5		OptionType	OptnTp	[0..1]	+		This block specifies whether it is a Call option (right to purchase a specific underlying asset) or a Put option (right to sell a specific underlying asset).	Este bloco identifica se o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente).	
8.5.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	string	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	Este bloco identifica o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente da opção) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente da opção). Valores válidos: CALL e PUTT.	
8.6		ExercisePrice	ExrcPric	[0..1]	+		Strike of the option.	Preço de exercício da opção.	
8.6.1		Value	Val	[1..1]	+		Value of the strike	Possui o valor financeiro.	



8.6.1.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	decimal fractionDigits = 8 totalDigits = 32	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
9.0		TradeDetails	TradDtIs	[1..1]	+		Details of the trade.	Este bloco contém detalhes do negócio.	
9.1		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Trade identification.	Número do negócio.	
9.2		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	string	Coded list to specify the side of the trade. E.g. Buy or Sell. The valid codes are BUYI and SELL.	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
9.3		TradingSessionIdentification	TradgSsnId	[0..1]	ExternalTradingSessionIdentificationCode	int	<p>Identification of a specific execution time bracket code through its trading session name or description.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradingSessionIdentificationCode in the file</p>	<p>Este campo informa se o negócio foi feito no horário regular do pregão ou after market (Período de negociação que funciona fora do horário regular do pregão).</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste</p>	R2



							ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls	caso o externo é ExternalTradingSessionIdentificationCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls	
9.4		TradeRegistrationOrigin	TradRegnOrigin	[0..1]	Max50Text	string minLength = 1 maxLength = 50	Indicates trade session origin. E.g, DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	Indica a sessão de origem de negociação. Ex: DMA1, DMA3, REPS, COL00, COL01, CME, etc.	
9.5		TradingSessionSubidentification	TradgSsnSubld	[0..1]	ExternalTradingSessionSubidentificationCode	int	Identifier for the instrument group phase. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternalTradingSessionSubldentificationCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls	Identifica o grupo da fase na sessão de negociação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradingSessionSubldentificationCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.	
9.6		SecurityTradingStatus	SctyTradgSts	[0..1]	ExternalSecurityTradingStatusCode	int	Identifier for the instrument phase. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is	Identifica a fase do instrumento na negociação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da	



							ExternalSecurityTradingStatus Code in the file ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls	BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityTradingStatusCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.	
9.7		OrderIdentification	Ordrlid	[0..1]	Max26Text	string minLength = 1 maxLength = 26	Unique identifier for Order assigned by the trading system. This attribute will be filled in if the requester is Trading Participant or Direct Participant.	Número da ordem no sistema eletrônico. Este atributo será preenchido somente se requisitante for Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação.	
9.8		SecondaryTradeMatchIdentification	ScndryTradeMchld	[0..1]	Max10Text	string maxLength = 10 minLength = 1	Assigned by the matching engine. Used to link UDS Leg reports.	Designado pelo sistema de negociação	
9.9		TraderIdentification	Tradrlid	[0..1]	Max50Text	string minLength = 1 maxLength = 50	Indicates the trader code.	Este campo informa o código do operador.	
9.10		TradeSubType	TradSubTp	[0..1]	ExternalTradeSubTypeCode	int	Further qualification to the trade type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeSubTypeCode the file	Qualificação adicional para o tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é	



							ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls	ExternalTradeSubTypeCode e no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls	
9.11		SideTradeSubType	SdTradSubTp	[0..1]	SideTradeSubTypeCode	string	Identify the strategy sub type.	Identifica o subtipo de estratégia.	
9.12		StrategyType	StrtgyTp	[0..1]	ExternalStrategyTypeCode	string maxLength = 2	Strategy type definition. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external code is ExternalStrategyTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls	Define o tipo de estratégia. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStrategyTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.	
9.13		DaysToSettlement	DaysToSttlm	[0..1]	Max4Text	string maxLength = 4 minLength = 1	Indicates number of days for settlement in a forward contract (equities).	Prazo em dias para a liquidação do contrato a termo de ações.	



9.14		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	int	<p>Specifies how the transaction is to be settled.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalPaymentTypeCode the file ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.</p>	<p>Este campo identifica a forma de liquidação do negócio. Ex: Netting, Gross, Without Financial Transfer e Between Parts</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls</p>	
9.15		TradeTransactionType	TradTxTp	[0..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	int	<p>Specifies the type of trade. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalTradeTransactionTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls</p> <p>E.g 0 -Regular trade 29-Exercise complement 38-Block Trade 45-Options exercise</p>	<p>Este bloco identifica o código do tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls</p> <p>EX: 0 -Regular trade 29-Exercise complement 38-Block Trade 45-Options exercise</p>	



9.16		DealPrice	DealPric	[1..1]	+		Amount of money (price) traded for the instruments (bought or sold).	Este bloco informa a quantidade em dinheiro (preço) negociada do instrumentos (comprado ou vendido).	
9.16.1		Value	Val	[1..1]	+		Value of the strike	Possui o valor financeiro.	
9.16.1.1		Amount	Amt	[1..1]		RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
9.17		StrategyTrade	StrtgyTrad	[0..1]	+		Contains information on the strategy.	Contém dados de estratégia.	
9.17.1		ShortFuturePrice	ShrtFutrPric	[0..1]		RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmount	Short leg price.	Valor futuro curto.	
9.17.2		LongFuturePrice	LngFutrPric	[0..1]		RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd3DecimalAmount	Long leg price.	Valor futuro longo.	
9.17.3		Delta	Dlta	[0..1]		RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Delta value.	Valor do Delta.	



9.18		TradeDate	TradDt	[1..1]	+		Specifies the date/time on which the trade was executed.	Este bloco identifica a data e hora em que os instrumentos foram negociados.	
9.18.1		Date	Dt	[1..1]		ISODate	date	Specified date.	Especifica uma data.
9.19		TradingDeskIdentification	TradgDskId	[0..1]		Max50Text	string minLength = 1 maxLength = 50	Identifier for the trading desk or strategy.	Identifica a mesa de negociação ou estratégia. A informação deste campo será recebida do sistema de negociação.
10.0		GiveUpDateAndTime	GvUpDtAndTm	[1..1]	+			Give up Date and Time.	Fornece a data e hora do repasse.
10.1		DateTime	DtTm	[1..1]		ISODatetime	dateTime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.
11.0		BacenAuctionDetails	BacenAuctnDtls	[0..1]	+			Contains information BACEN auction trades (dollar swap).	Detalha informações sobre leilões de swap cambial do BACEN.
11.1		BacenAuctionIdentification	BacenAuctnId	[0..1]		Max8Text	string maxLength = 8 minLength = 1	BACEN's communication number.	Número do comunicado BACEN.



11.2		AuctionProposalIdentification	AuctnPrpsId	[0..1]	Max6Text	string minLength = 1 maxLength = 6	Number of BACEN's Auction Proposal.	Número da Proposta do leilão de swap cambial BACEN.	
11.3		SelicAccountIdentification	SelicAcctId	[0..1]	Max9NumericText	string pattern = [0-9]{1,9}	Selic Account ID.	Identifica a Conta Selic.	
11.4		StartPositionDate	StartPosDt	[0..1]	+		Start position date of the dollar swap trade.	Data início da valorização do contrato de swap cambial.	
11.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Specified date.	Especifica uma data.	
12.0		Reference	Ref	[1..1]	+		This block contains the allocation Identification.	Este bloco contém informações relacionadas ao número de alocações.	
12.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Allocation ID number provided by B3.	Número de identificação da alocação atribuído pela B3.	
13.0		AllocationStatusAdvice	AllcnStsAdvC	[1..1]	+		This block details the pending give-up status.	Informações de situação de pendência de repasse.	



13.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+		Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	
13.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	string maxLength = 10 minLength = 1	Provides status for the pending give-up approval or pending take-up cancellation approval.. This field requires an external code list. In this case the external code is ExternalStatusAllocationAdviceCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls. Possible values: 3- Pending Give Up Approval	Campo que identifica se trata-se de um repasse ou cancelamento de repasse pendente de confirmação. Este campo requer uma lista de código externo. Neste caso o externo é ExternalStatusAllocationAdviceCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls. Valores possíveis: 3- Pending Give Up Approval (repassa pendente de confirmação)	
14.0		TradeParticipantIdentification	TradPtcptId	[0..1]	+		Trading Participant Code	Código do Participante de Negociação.	
14.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
14.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
15.0		ETFTradeInformation	ETFTradeInf	[0..1]	+		Informs the ETF trade.	Informa os dados de negociação do trade de ETF.	R3



15.1		LotCode	LotCd	[1..1]	int	int	A Unique identifier for this ETF trade in the depository	Identificador unico da operação do ETF na depositária.	
15.2		ETFTType	ETFTp	[1..1]	ExternalETFTTypeCode	int	<p>This field is used for information of ETF Type.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalETFTTypeCode at ExternalCodeLists_iMERCAD O_BVMF.xls.</p>	<p>Este campo é utilizado para informar os tipos de ETF.</p> <p>Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalETFTTypeCode no arquivo</p> <p>ExternalCodeLists_iMERCAD O_BVMF.xls.</p>	
15.3		OperationType	OprnTp	[1..1]	ExternalOperationTypeCode	int	<p>Informs if the current operation is an application or a redemption.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalOperationTypeCode at ExternalCodeLists_iMERCAD O_BVMF.xls.</p>	<p>Informa se a operação corrente é aplicação ou resgate.</p> <p>Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalOperationTypeCod e no arquivo</p>	



								ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.
15.4		MovementType	MvmntTp	[1..1]	ExternalMovementTypeCode	string maxLen gth = 2	<p>This field identifies if the quantities/values informed in the message are provisory or final ones.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalMovementTypeCode</p> <p>at ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.</p>	<p>Este campo identifica se as quantidades /valores informado na mensagem são provisório ou definitivo.</p> <p>Este campo requer uma lista externa de códigos. Os códigos e valores foram armazenados em uma planilha externa para possibilitar uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso a lista é ExternalMovementTypeCode de no arquivo</p> <p>ExternalCodeLists_iMERCADO_BVMF.xls.</p>
15.5		FundAdministration Rate	FndAdmstrn Rate	[1..1]	PercentageRate	decimal fractionD igits = 10 totalDigit s = 11	<p>This field informs the management fee of the fund. The fund reports the value and BVMF uses the data to generate the financial negotiation.</p>	<p>Este campo informa a taxa de administração do fundo. O fundo informa o valor e a BVMF utiliza os dados para gerar o financeiro da negociação</p>



15.6		AdjustmentValue	AdjstmntVal	[0..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalsAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	The adjustment is the difference between share funds against the basket.	O ajuste é a diferença entre o valor da cota contra a cesta.	
15.7		OtherValues	OthrVals	[0..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalsAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Other values charged. It is a value that the fund manager can send as extra charge of a creation/redemption that does not fall in the fund administration rate or adjustment value.	Outros valores cobrados. É um valor que o administrador do fundo pode enviar como cobrança extra de uma emissão/resgate que não se enquadra na taxa de administração do fundo ou ajuste de valores.	



imb.510.01 – ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection

Message functionality

The ResponseGiveupAcceptanceOrRejection message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to accept or reject a take-up trade.

Rules

R1. The AccountIdentification (AccID) field must mandatorily be filled out in the situations described below:

- Give-up rejection request by the Take-up Participant, of a give-up with already-accepted status (Give-up status: 4-Give up approved), requested on-hour or off-hour for the give-up confirmation

Filling out the AccountIdentification (AccID) field is NOT required in the other cases: Give-up acceptance/rejection requests by the Take-up Participant whose give-up has pending approval status (Give-up status: 3-Pending Give up approval).

R2. There is a trade with Acceptance/Rejection Pending status for Take-up Participant.

R3. It is possible to reject a trade that has already been registered, following the rules of the window.

Message Structure – ResponseGiveUpAcceptanceOrRejection (imb.510.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identifications	Ids	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	string maxLen gth = 35 minLeng th = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	



2.0		References	Refs	[1..1]	+		Reference to the transaction identifier issued by a participant. It may also be used to reference a previous transaction. Transaction number assigned by the participant who sent the message.	Referência à identificação da transação feita por um participante. Também é usado para fazer referência a uma operação anterior. Número da transação atribuída pelo participante que enviou a mensagem.	
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	
2.1.1		ExecutingPartyTransactionIdentification	ExctgPtyTxId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification of the confirmation transaction as known by the executing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
3.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+		This block contains the participant identification.	Este bloco contém a identificação do participante.	
3.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+		Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	



3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLen gth = 35 minLeng th = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>	
3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLen gth = 35 minLeng th = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo</p>	



							ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.1.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
3.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+		Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
3.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	R1
4.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+		Provides details of the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	

4.1		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	string pattern = [A-Z0-9]{12,12}	<p>INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER (ISIN). A numbering system designed to standardize the codes of financial securities internationally. The code for Brazilian securities has the BR AAAA BB CC 7 structure, where:</p> <p>a) The two-character prefix (BR) identifies the code for the country of issue (BRAZIL)</p> <p>b) The four characters (AAAA) are alpha-numeric characters and identify the issuer.</p> <p>c) The three characters (BBB) are alpha-numeric characters and identify the type of security. It may have an automatic sequence in the second position (Sequence 1) and in the third position (Sequence 2) or have no sequence at all.</p> <p>d) The two characters (CC) are alpha-numeric characters and identify the type, when it is a stock, or represent an automatic sequence to identify each security issue, when it is a different asset category.</p> <p>e) The last character (7) is the control digit.</p>	<p>INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER – É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7, onde:</p> <p>a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL;</p> <p>b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor;</p> <p>c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter sequência automática na segunda posição (sequência 1) e na terceira posição (sequência 2) ou não ter qualquer sequência;</p> <p>d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma sequência</p>	
-----	--	------	------	--------	----------------	--	--	---	--

								automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias; e e) o último caractere (7) é o dígito de controle.	
4.2		OtherIdentification	OthrId	[0..1]	+		Identification of a security by proprietary or domestic identification schema.	Este bloco contém a identificação proprietária de um instrumento.	
4.2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification of a security.	Identificação de um instrumento.	
4.2.2		Type	Tp	[1..1]	+		Identification type.	Tipo da identificação.	
4.2.2.1		Code	Cd	[1..1]	ExternalFinancialInstrumentIdentificationType1Code	string maxLength = 4 minLength = 1	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = EXCH.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Deve ser preenchido com o valor default = EXCH.	
5.0		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+		This block contains the Ticker Symbol.	Este bloco contém informações do bloco de negociação.	
5.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength = 35 minLength = 1	Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Exemplo: BVMF3	

6.0		TradeLegDetails	TradLegD tls	[1..1]	+		This block provides details of the trade.	Este bloco fornece detalhes do negócio.	
6.1		TradIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Trade identification.	Número do negócio.	
6.2		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	string	Coded list to specify the side of the trade. E.g. Buy or Sell. The valid codes are BUYI and SELL..	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	
7.0		Status	Sts	[1..1]	+		This block allows the give-up acceptance or rejection (confirmation).	Este bloco contém os detalhes da situação do repasse. O participante destino informa o aceite ou Rejeite do repasse.	
7.1		AffirmationStatus	AffirmSts	[1..1]	+		This block contains information on acceptance or rejection of the transaction.	Este bloco contém informação do aceite ou rejeição da transação.	
7.1.1		Code	Cd	[1..1]	AffirmationStatus1Code	string	Give-up confirmation. Ex: AFFI: Acceptance NAFI: Rejection	Confirmação de repasse. Ex: AFFI: Aceito NAFI: Rejeitado	
7.2		AdditionalReasonInformation	AddtlRsnl nf	[0..1]	Max210Text	string maxLength = 210 minLength = 1	Provides additional information about the reject reason.	Informa o motivo da rejeição referente ao valor financeiro.	



imb.522.01 – SecuritiesAllocatedAmountNotification

Message functionality

The SecuritiesAllocatedAmountNotification message is sent by the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) to the Manager via iMercado to notify it of the net financial value per trade.

Rules

Message Structure – SecuritiesAllocatedAmountNotification (imb.522.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		PaginationInformation	PgntnInf	[1..1]	+		Provides pagination information.	Fornecer informação sobre a paginação.	
1.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique identification for the group of partitioned messages.	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.1.1		PaginationIdentification	PgntnId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique identification for the group partitioned messages	Identificação única para o conjunto de mensagens particionadas.	
1.2		Pagination	Pgntn	[1..1]	+		Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	Número da página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuação, informando se é a última página ou se existem mais.	
1.2.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	string pattern = [0-9]{1,5}	Page number.	Número da página.	
1.2.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	boolean	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	



2.0		Identifications	Ids	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.
2.1		TransactionIdentification	Txid	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.
3.0		PartyIdentification	Ptyld	[1..1]	+		Provides details of the party identification.	Fornecer detalhes de identificação do participante.
3.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.
3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below:</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo:</p>



							Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)	Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).
3.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.
3.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.



4.0		TradeLegDetails	TradLegDtls	[1..1]	+		This block provides details of the trade.	Este bloco fornece detalhes do negócio.	
4.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+		Provides the date of trading session.	Fornecer a data do pregão.	
4.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Specified date.	Especifica uma data.	
4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength = 1	Trade identification.	Número do negócio.	
4.3		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	string	Coded list to specify the side of the trade. E.g. Buy or Sell. The valid codes are BUYI and SELL..	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL.	
5.0		SecurityIdentification	Sctyld	[1..1]	+		This block contains the Ticker Symbol.	Este bloco contém informações do bloco de negociação.	
5.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	string maxLength h = 35 minLength = 1	Ticker that identifies a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock.	Código que identifica um instrumento negociado/registrado em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar um instrumento.	
6.0		NetAmountDetails	NetAmtDtls	[1..*]	+		This block contains the details of the net amount of each allocation.	Este bloco contém os detalhes do valor financeiro líquido de cada alocação.	



6.1		AllocationIdentification	AllcId	[0..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Allocation ID number provided by B3.	Número de identificação da alocação atribuído pela B3.	
6.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Provides account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.	
6.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
6.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
6.3		SecurityAccountType	SctyAcctTp	[1..1]	ExternalSecurityAccountTypeCode	int	Identifies the Account Type in which the trade is allocated. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalSecurityAccountTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Identifica o tipo de conta em que o negócio é alocado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecurityAccountTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	



6.4		Quantity	Qty	[1..1]	+		Specifies the trade quantity to be allocated.	Especifica a quantidade destinada à alocação.	
6.4.1		Unit	Unit	[1..1]		DecimalNumber decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
6.5		SubAccount	SubAcct	[0..1]		Max5Text string maxLength = 5 minLength = 1	Identification of the sub account.	Identificação da carteira na depositária.	
6.6		CustodianInformation	CtdnInf	[0..1]	+		Provides custodian details.	Este bloco identifica o custodiante relacionado com a alocação.	
6.6.1		PartyIdentification	Ptyld	[1..1]	+		Provides details of the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
6.6.1.1		ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	



6.6.1.1 .1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification schema.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external code is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means FTP (Full Trading Participant)</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo:</p> <p>Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>	
6.6.1.1 .2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength = 1	<p>Entity that assigns the identification.e.g iMercado.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIssuerCode no arquivo</p>	



								ExternalCodeLists_iMERC ADO.xls.	
6.6.1.1.3		SchemaName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field requires an external code list. Those codes and values have been made on external spreadsheet files to allow flexible maintenance according to the updates requirements. In this case the external code is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
6.6.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+		Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
6.6.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+		Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification schema.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
6.6.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Account number identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
6.7		InvoiceValues	InvVals	[1..*]	+		Contains details of each expense and expense type.	Este bloco contém detalhes de cada despesa relacionada e seu tipo.	



6.7.1		ExpensesType	ExpnssTp	[1..1]	ExternalExpensesTypeCode	string maxLength h = 2	<p>It indicates the type of expenses contained in the invoice.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalExpensesTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	<p>Indica o tipo de despesa contida na nota de corretagem.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalExpensesTypeCode.xls no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls</p>	
6.7.2		OtherExpensesDescription	OthrExpnssDesc	[0..1]	Max15Text	string maxLength h = 15 minLength = 1	<p>It describes other expenses.</p>	<p>Descreve outras despesas cobradas.</p>	
6.7.3		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	+		<p>Indicates whether an entry is a credit or a debit.</p>	<p>Indica se o lançamento é relacionado a um crédito ou um débito.</p>	
6.7.3.1		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[1..1]	CreditDebitCode	string	<p>Indicates whether an entry is a credit or a debit.</p>	<p>Indica se é um crédito ou um débito.</p>	
6.7.4		ExpensesValue	ExpnssVal	[1..1]	+		<p>Value of expense</p>	<p>Valor da despesa.</p>	



6.7.4.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em moeda e valor.	
6.8		GrossTradeAmount	GrssTradAmt	[0..1]	+		This block informs the gross trade amount.	Este bloco informa o volume bruto negociado.	
6.8.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
6.8.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
6.9		NetGainLoss	NetGnLoss	[1..1]	+		Amount representing the difference between the cost and the current price of a security. In the context of securities settlement, it is the amount paid or received when the instructions are netted or paired off.	Este bloco informa o volume líquido.	



6.9.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount	decimal fractionDigits = 5 minInclusive = 0 totalDigits = 18	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
6.9.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
6.10		ServiceTaxPayment City	SvcTaxPmtCity	[0..1]	+		This field indicates the service tax (ISS) payment city.	Indica o município de recolhimento do ISS.	
6.10.1		TownName	TwnNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Name of a built-up area, with defined boundaries, and a local government.	Nome da cidade.	



imb.521.01 – FinancialValueApprovalResponse

Message functionality

The FinancialValueApprovalResponse message is sent by the Manager to the Full Trading Participant (FTP) or Settlement Participant (SP) via iMercado to validate the net financial value per trade.

Rules

Message Structure – FinancialValueApprovalResponse (imb.521.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identifications	Ids	[1..1]	+		Identification assigned by the participant is sending this message.	Identificação atribuída pelo participante que está enviando essa mensagem.	
1.1		TransactionIdentification	Txid	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		References	Refs	[1..1]	+		Reference to the transaction identifier issued by a business party. It may also be used to reference a previous transaction. Transaction number assigned by the participant who sent the message imb.504	Referência à identificação da transação feita por um participante. Também é usado para fazer referência a uma operação anterior. Número da transação atribuída pelo participante que enviou a mensagem imb.504.	
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	

2.1.1	ExecutingPartyTransactionIdentification	ExctgPtyTxld	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Identification of the confirmation transaction as known by the executing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.
3.0	PartyIdentification	Ptyld	[1..1]	+		Provides details about the party identification.	Fornecer detalhes de identificação do participante.
3.1	ProprietaryIdentification	Prtryld	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.
3.1.1	Identification	ld	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	<p>Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.</p> <p>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from B3. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls</p> <p>The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).</p>	<p>Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.</p> <p>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da B3. Neste caso, o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>

3.1.2	Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength = 1	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.3	SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength = 1	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0	FinancialValueStatus	FinValSts	[1..*]	+		This block allows the participant acceptance or rejection the financial value for each allocation.	Esse bloco permite que o participante aceite ou rejeite o valor financeiro para cada alocação.	
4.1	AllocationIdentification	AllcId	[0..1]	Max35Text	string maxLength h = 35 minLength = 1	Allocation ID number provided by B3.	Número de identificação da alocação atribuído pela B3.	
4.2	Status	Sts	[1..1]	+		This block allows the participant acceptance or rejection the financial value.	Este bloco permite o participante aceitar ou rejeitar o valor financeiro enviado através da mensagem imb.504	
4.2.1	AffirmationStatus	AffirmSts	[1..1]	+		This block contains information on acceptance or rejection of the transaction.	Este bloco contém informação do aceite ou rejeição da transação.	
4.2.1.1	Code	Cd	[1..1]	AffirmationStatus1Code	string	AFFI: Acceptance NAFI: Rejection	AFFI: Aceito NAFI: Rejeitado	
4.2.2	AdditionalReasonInformation	AddtIRsnInf	[0..1]	Max210Text	string maxLength h = 210 minLength = 1	Provides additional information about the reject reason.	Informa o motivo da rejeição referente ao valor financeiro.	

