

Layouts - Receber Arquivos

[IOF]



19/12/2011

Conteúdo

1	DPOSICAO_IOF.....	3
2	DOPERACAO_IOF.....	5

IOF	
Nome do Arquivo	Direcionado ao: Participante
1 DPOSICAO_IOF	
Arquivo enviado diariamente com a posição vigente dos contratos. Serão apresentadas as operações dos derivativos de cálculos do IOF.	

Campo	Descrição
Tipo de Contrato	Tipo de contrato utilizado na operação
Separador	Ponto e vírgula (;)
Código do Contrato	Código do Contrato
Separador	Ponto e vírgula (;)
Data de Registro	Data de registro do contrato
Separador	Ponto e vírgula (;)
Data da Operação	Data início da operação
Separador	Ponto e vírgula (;)
Data de Início	Data a partir da qual as curvas do contrato passam a ser atualizadas.
Separador	Ponto e vírgula (;)
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato
Separador	Ponto e vírgula (;)
Data do Próximo Evento	Próxima data da agenda de eventos do contrato
Separador	Ponto e vírgula (;)
Data de Fixing do Próximo Evento	Data de formação da cotação do próximo evento
Separador	Ponto e vírgula (;)
Conta 1(Ponta 1, Comprador, Titular)	Código Cetip da ponta 1 para SWAP, comprador para Termo e lançador para Opção
Separador	Ponto e vírgula (;)
CPF/CNPJ 1 (Ponta 1, Comprador, Titular)	CPF/CNPJ da ponta 1 para SWAP, comprador para Termo e lançador para Opção.
Separador	Ponto e vírgula (;)
Conta 2(Ponta 2, Vendedor, Lançador)	Código Cetip da ponta 2 para SWAP, vendedor para Termo e titular para Opção.
Separador	Ponto e vírgula (;)
CPF/CNPJ 2 (Ponta 2, Vendedor, Lançador)	CPF/CNPJ da ponta 2 para SWAP, vendedor para Termo e titular para Opção.
Separador	Ponto e vírgula (;)
NAJR\$ ou NAJMBC	Nocional Ajustado na Moeda Base do contrato
Separador	Ponto e vírgula (;)
VBR - Valor base remanescente (na moeda contrato)	Valor base restante do contrato
Separador	Ponto e vírgula (;)
Moeda do VBR	Moeda Base do Valor Base Remanescente
Separador	Ponto e vírgula (;)
Moeda Estrangeira (ME)	Moeda estrangeira envolvida no contrato
Separador	Ponto e vírgula (;)
Cotação Inicial do Contrato	Cotação inicial informada de comum acordo entre as partes, onde o sistema utiliza para valorização da curva do contrato.
Separador	Ponto e vírgula (;)
Taxa a Termo	Taxa a Termo indicada nos contratos TMO

(Continua)

Campo	Descrição
Separador	Ponto e vírgula (;)
Preço de exercício de opção	Preço de Exercício indicados nos contratos OFCC ou OFVC
Separador	Ponto e vírgula (;)
Data de referência do cálculo	Referência para o cálculo do Nocial Ajustado
Separador	Ponto e vírgula (;)
Cotação da data de sessão	Cotação R\$/Moeda Estrangeira
Separador	Ponto e vírgula (;)
Paridade entre ME e US\$	Cotação US\$/Moeda Estrangeira
Separador	Ponto e vírgula (;)
Valor remanescente em Moeda Estrangeira	Valor remanescente do contrato na Moeda Estrangeira envolvida
Separador	Ponto e vírgula (;)
Delta Fator do CPF/CNPJ 1	Valor do Delta em fator para a conta 1
Separador	Ponto e vírgula (;)
Delta Fator do CPF/CNPJ 2	Valor do Delta em fator para a conta 2
Separador	Ponto e vírgula (;)
Notional Ajustado CPF/CNPJ1 em US\$	Nocial Ajustado em US\$ para a conta 1
Separador	Ponto e vírgula (;)
Notional Ajustado CPF/CNPJ2 em US\$	Nocial Ajustado em US\$ para a conta 2
Separador	Ponto e vírgula (;)
Fonte	Cetip ou Simplificado

(Fim)

IOF	
Nome do Arquivo	Direcionado ao: Participante
2 DOPERACAO_IOF	
Arquivo enviado diariamente com a posição vigente dos contratos. Serão apresentadas as operações dos derivativos de cálculos do IOF.	

Campo	Descrição
Tipo de Contrato	Tipo de contrato utilizado na operação (OFFC, OFVC, TMO, SWAP)
Separador	Ponto e vírgula (;)
Código do Contrato	Código do Contrato
Separador	Ponto e vírgula (;)
Data da Operação	Data início da operação
Separador	Ponto e vírgula (;)
Tipo de Operação	Descrição do(s) Tipo(s) da Operação
Separador	Ponto e vírgula (;)
Conta 1(Ponta 1, Comprador, Titular)	Código Cetip da ponta 1 para SWAP, comprador para Termo e lançador para Opção.
Separador	Ponto e vírgula (;)
CPF/CNPJ 1 (Ponta 1, Comprador, Titular)	CPF/CNPJ da ponta 1 para SWAP, comprador para Termo e lançador para Opção.
Separador	Ponto e vírgula (;)
Conta 2(Ponta 2, Vendedor, Lançador)	Código Cetip da ponta 2 para SWAP, vendedor para Termo e titular para Opção.
Separador	Ponto e vírgula (;)
CPF/CNPJ 2 (Ponta 2, Vendedor, Lançador)	CPF/CNPJ da ponta 2 para SWAP, vendedor para Termo e titular para Opção.
Separador	Ponto e vírgula (;)
Valor da Operação em US\$	Valor Base da Operação em US\$
Separador	Ponto e vírgula (;)
Notional Ajustado Compra CPF/CNPJ 1	Nocional Ajustado Comprado da Operação em US\$ para conta 1
Separador	Ponto e vírgula (;)
Notional Ajustado Venda CPF/CNPJ 1	Nocional Ajustado Vendido da Operação em US\$ para conta 1
Separador	Ponto e vírgula (;)
Notional Ajustado Compra CPF/CNPJ 2	Nocional Ajustado Comprado da Operação em US\$ para conta 2
Separador	Ponto e vírgula (;)
Notional Ajustado Venda CPF/CNPJ 2	Nocional Ajustado Vendido da Operação em US\$ para conta 2

(Fim)