



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 28/08/2023

*iMercado – Pre-Matching*

## iMercado – Pre-Matching

# Relatório de Definições de Mensagens

Este documento descreve um conjunto de definições de mensagens desenvolvidas pela B3, a serem utilizadas nos processos de Pre-matching do iMercado.



## Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição
10/04/2017	1.0	Versão inicial
03/07/2017	1.0	Alteração na mensagem setr.044.001.02.
13/07/2018	1.1	1. Alteração na mensagem setr.027.001.02 2. Criação da mensagem setr.029.001.01 3. Criação da mensagem setr.030.001.01 4. Alteração na mensagem setr.044.001.02
24/07/2018	1.1	Inclusão da coluna informativa Data Type Details em todas as mensagens.
06/09/2018	1.2	Criação da mensagem SUPL.setr.044.001.02. Alterações nas mensagens setr.030.001.01, setr.029.001.01 e setr.027.001.03 Criação da mensagem SUPL.setr.029.001.01
30/01/2019	1.3	Alterações nas mensagens setr.029.001.01, setr.027.001.03, SUPL. setr.027.001.03, setr.044.001.02 e SUPL.setr.044.001.02.
14/02/2019	1.4	Alteração na mensagem SUPL.setr.027.001.03.
09/09/2019	1.5	Alterações nas mensagens setr.027.001.03, SUPL.setr.044.001.02.
04/11/2019	1.6	Alterações nas mensagens setr.027.001.03, SUPL.setr.044.001.02.
02/09/2022	1.7	Inclusão do fluxo de batimento de corretagem entre Executor e Carrying e Alteração nas mensagens setr.027.001.03 e setr.044.001.02
28/08/2023	1.8	Alteração na descrição do atributo "CommonIdentification".

Descrição detalhada no documento "Histórico de Alterações".



## Versão de Schema

A versão deste catálogo contempla as versões abaixo dos schemas XSDs.

Nome Mensagem	Versão Schema XSD
setr.027.001.03	1.4
SUPL.setr.027.001.03	1.3
setr.029.001.01	1.2
SUPL.setr.029.001.01	1.0
setr.030.001.01	1.1
setr.044.001.02	2.4
SUPL.setr.044.001.02	1.2



## Conteúdo

Histórico de Revisão .....	2
Versão de Schema .....	3
Visão geral .....	6
<i>Escopo</i> .....	6
<i>Lista de Mensagens</i> .....	7
<i>Como Ler</i> .....	8
Fluxos de Mensagens .....	9
<i>Informa Pre-Matching</i> .....	9
Introdução .....	9
Cenário 1: Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação informa pre-matching - Matched .....	9
Cenário 2: Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação informa pre-matching - Unmatched.....	10
Cenário 3: Agente de Custódia informa pre-matching.....	12
Cenário 4: Participante de Negociação Pleno informa pre-matching - Matched.....	12
<i>Cancelamento de Pre-Matching</i> .....	13
Introdução .....	13
Cenário 1: Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação solicita cancelamento de pre-matching .....	13
Cenário 2: Agente de Custódia solicita cancelamento de pre-matching .....	14
<i>Informa Pre-Matching – Corretagem entre Executor e Carrying</i> .....	15
Introdução .....	15



Cenário 1: Participante executor e carrying efetuam pre-matching de corretagem .....	15
Cenário 2: Participante executor e carrying efetuam cancelamento de pre-matching para corretagem .....	17
setr.027.001.03 – SecuritiesTradeConfirmation .....	18
Funcionalidade da mensagem.....	18
Regras .....	18
Estrutura da Mensagem – SecuritiesTradeConfirmation (setr.027.001.03) .....	18
Estrutura da Mensagem – Supplementary Data SUPL.setr.027.001.03 - SecuritiesTradeConfirmationSD .....	27
setr.044.001.02 - SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice .....	30
Funcionalidade da mensagem.....	30
Regras .....	30
Estrutura da mensagem – SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice (setr.044.001.02) .....	30
Estrutura da Mensagem SUPL.setr.044.001.02 – SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice .....	35
setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation .....	38
Funcionalidade da mensagem.....	38
Regras .....	38
Estrutura da mensagem - setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation .....	38
Estrutura da mensagem SUPL.setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation .....	40
setr.030.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationResponse .....	42
Funcionalidade da mensagem.....	42
Regras .....	42
Estrutura da mensagem - setr.030.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationResponse .....	42



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 28/08/2023

*iMercado – Pre-Matching*

## Visão geral

### Escopo

Este documento descreve o conjunto de definições de mensagens desenvolvidas pela B3 que serão utilizadas nos fluxos de pre-matching do iMercado.

Os cenários de negócios foram modelados e uma série de mensagens XML foi concebida. No devido tempo, essas mensagens serão submetidas à ISO20022, órgão de registro, para aprovação. Cada cenário de negócio é representado por um fluxo de trabalho padronizado e um número fixo de mensagens normatizadas.



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 28/08/2023

*iMercado – Pre-Matching*

## Lista de Mensagens

### 1. SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03>

A mensagem SecuritiesTradeConfirmation é enviada pelo Participante de Negociação Pleno (PNP), Participante de Liquidação (PL) ou Agente de Custódia (ACST) por meio do iMercado e detalha informações consolidadas de pre-matching por cliente e instrumento.

### 2. SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02>

A mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice é enviada pelo Agente de Custódia (ACST) por meio do iMercado para informar a situação da conciliação do pre-matching.

### 3. SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01>

A mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation é enviada pelo Agente de Custódia (ACST), Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) por meio do iMercado para solicitar o cancelamento do pre-matching.

### 4. SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01>

A mensagem SecuritiesTradeConfirmationResponse é enviada pelo Agente de Custódia (ACST), Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) por meio do iMercado para confirmar a solicitação de cancelamento de pre-matching.



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 28/08/2023

*iMercado – Pre-Matching*

## Como Ler

UML (Unified Modeling Language) tem sido usada para descrever modelos lógicos e de negócios. Como o entendimento de UML não é um requisito para a discussão de padrões de negócios, o formato de dados para as mensagens é apresentado de uma forma mais amigável. Esta forma de representação é gerada automaticamente a partir dos modelos, garantindo assim, a coerência absoluta entre as informações do modelo e a norma publicada.





## Fluxos de Mensagens

### Informa Pre-Matching

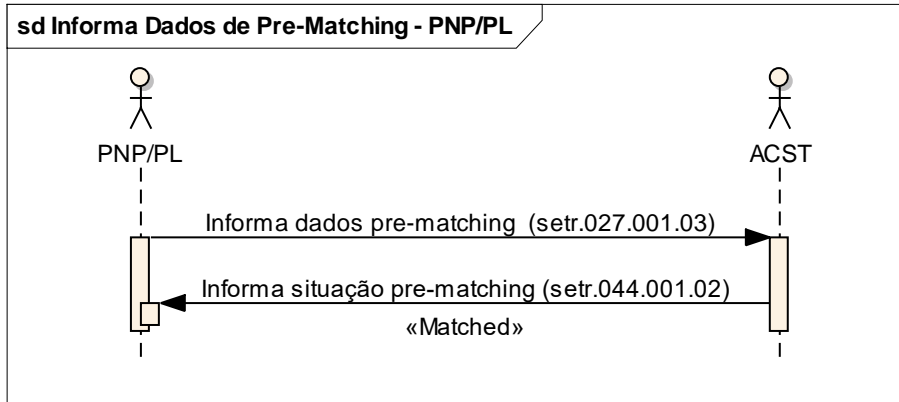
#### Introdução

Este fluxo ilustra o uso da mensagem SecuritiesTradeConfirmation em típicos cenários sequenciais para informar ao Agente de Custódia, Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação dados consolidados de liquidação por cliente e instrumento negociado.

#### **Cenário 1: Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação informa pre-matching - Matched**

Este cenário é básico e o mais elementar para informar ao Agente de Custódia dados consolidados de pre-matching.

- O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia (ACST), informando dados de pre-matching;
- O Agente de Custódia (ACST) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL), informando a situação da conciliação de dados do pre-matching - Matched.

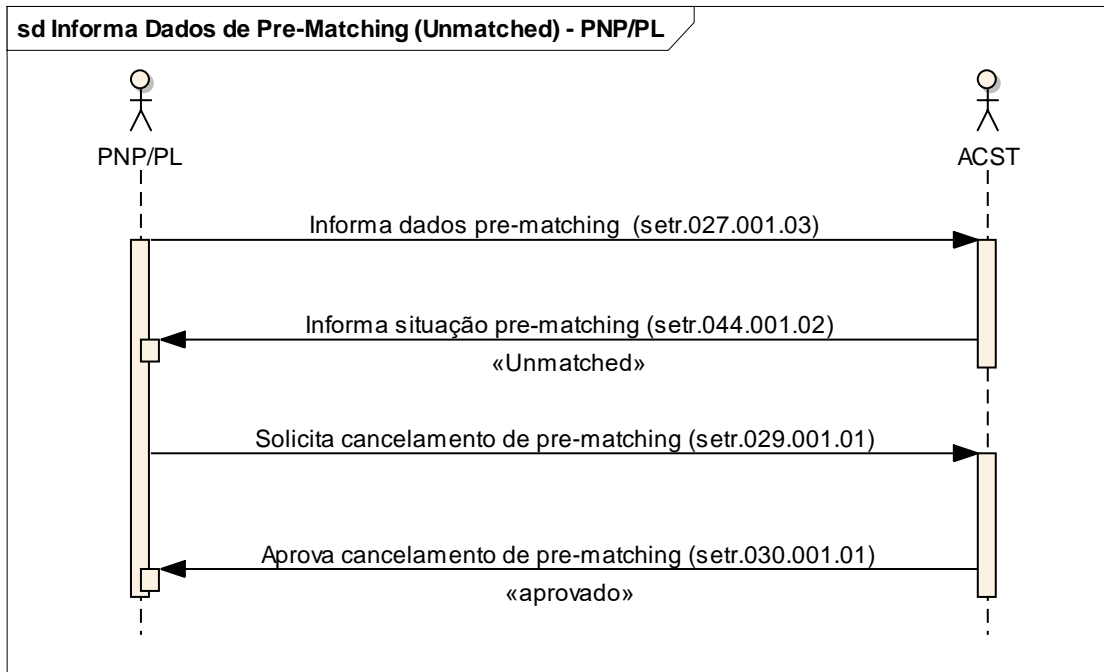


## Cenário 2: Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação informa pre-matching - Unmatched

Este cenário é básico e o mais elementar para informar ao Agente de Custódia dados consolidados de pre-matching.

- O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia (ACST), informando dados de pre-matching;
- O Agente de Custódia (ACST) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL), informando a situação da conciliação de dados do pre-matching – Unmatched;
- O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01> ao Agente de Custódia (ACST), solicitando cancelamento de pre-matching;

- O Agente de Custódia (ACST) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01> ao Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL), confirmando o cancelamento de pre-matching.

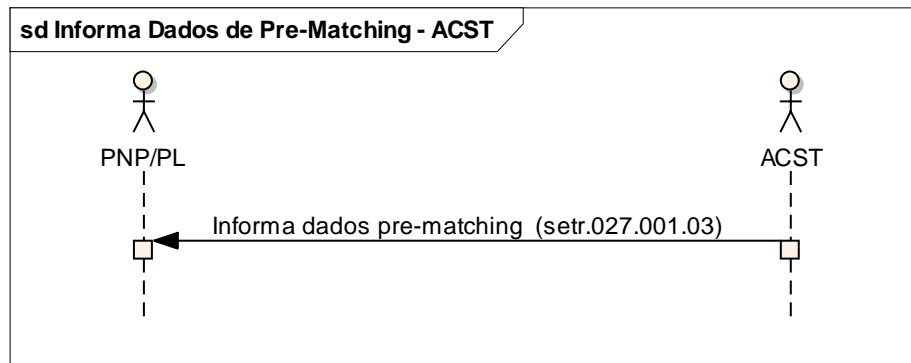




### Cenário 3: Agente de Custódia informa pre-matching

Este cenário é básico e o mais elementar para informar ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação dados consolidados de pre-matching.

- O Agente de Custódia (ACST) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL), informando dados de pre-matching.



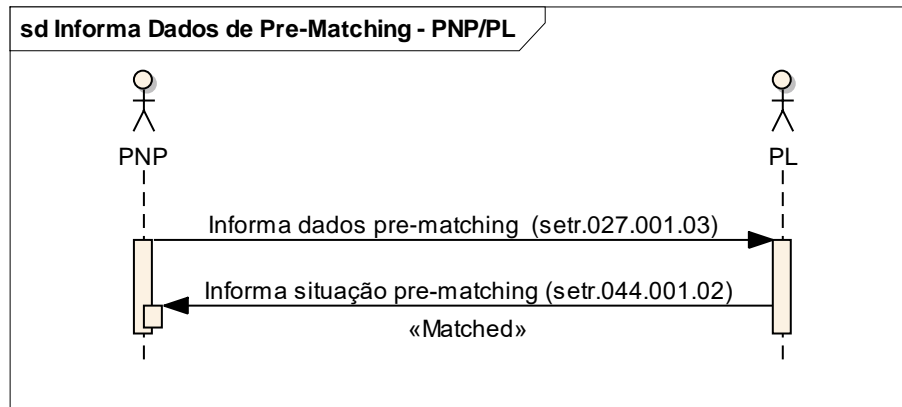
### Cenário 4: Participante de Negociação Pleno informa pre-matching - Matched

Este cenário é básico e o mais elementar para informar ao Participante de Liquidação dados consolidados de pre-matching.

- O Participante de Negociação Pleno (PNP) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Participante de Liquidação (PL), informando dados de pre-matching;



- O Participante de Liquidação (PL) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno (PNP), informando a situação da conciliação de dados do pre-matching - Matched.



## Cancelamento de Pre-Matching

### Introdução

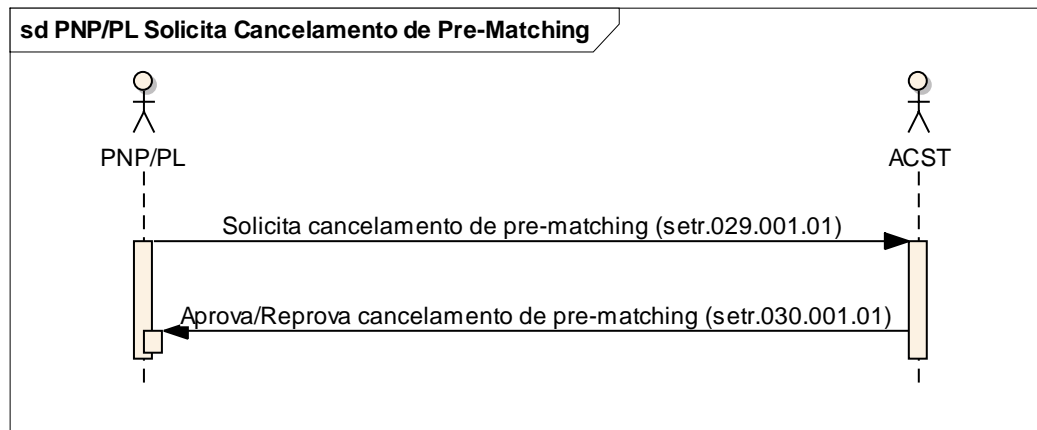
Este fluxo ilustra o uso da mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation em típicos cenários sequenciais para solicitar cancelamento de Pre-matching.

### Cenário 1: Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação solicita cancelamento de pre-matching

Este cenário é básico e o mais elementar para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação solicitar o cancelamento de Pre-matching.

- O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01> ao Agente de Custódia (ACST), solicitando cancelamento de pre-matching;

- O Agente de Custódia (ACST) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01> ao Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL), confirmando o cancelamento de pre-matching.

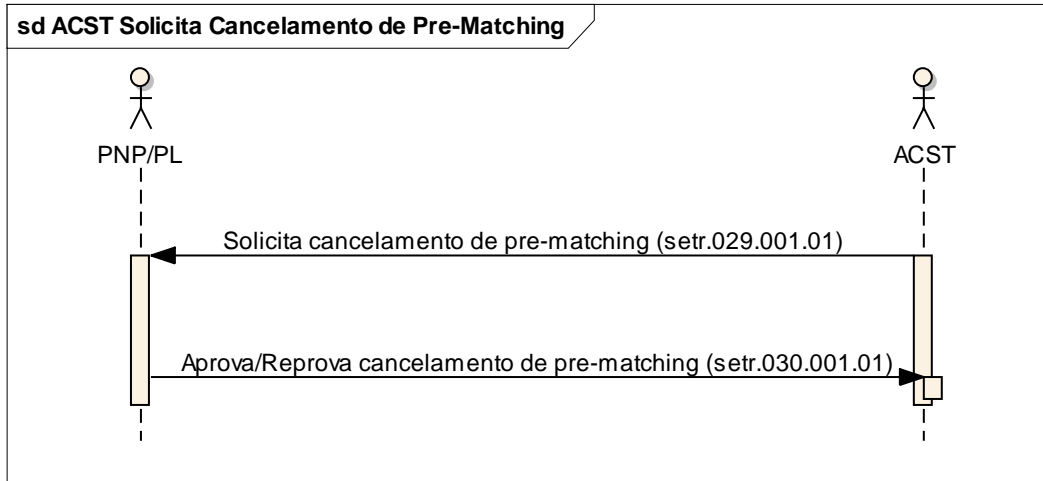


## Cenário 2: Agente de Custódia solicita cancelamento de pre-matching

Este cenário é básico e o mais elementar para o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação solicitar o cancelamento de Pre-matching.

- O Agente de Custódia (ACST) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01> ao Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL), solicitando cancelamento de pre-matching;

- O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01> ao Agente de Custódia (ACST), confirmando o cancelamento de pre-matching.



## Informa Pre-Matching – Corretagem entre Executor e Carrying

### Introdução

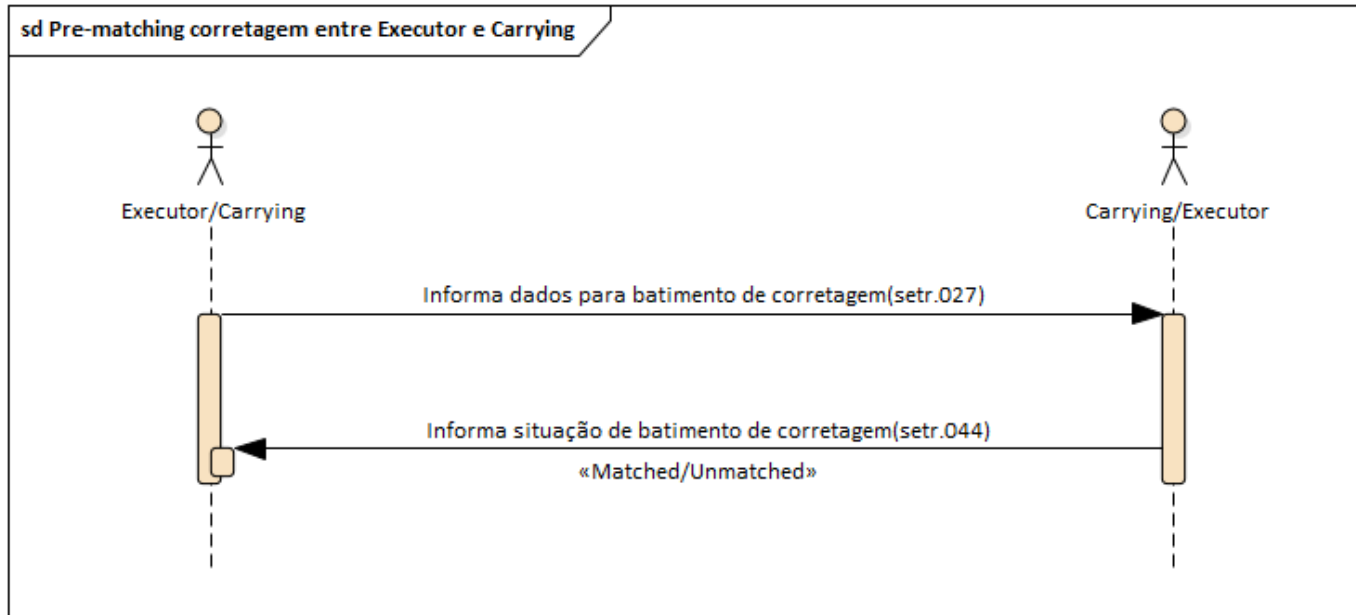
Este fluxo ilustra o uso da mensagem SecuritiesTradeConfirmation em típicos cenários sequenciais para informar ao Participante Executor e Carrying, dados consolidados de valores de corretagem por cliente e instrumento negociado.

### Cenário 1: Participante executor e carrying efetuam pre-matching de corretagem

Este cenário é básico e o mais elementar para informar ao Participante Executor e Carrying dados consolidados de corretagem para pre-matching.

- O Participante Executor ou Carrying enviam a mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Participante Executor ou Carrying, informando dados para batimento de corretagem;

- O Participante Executor ou Carrying enviam a mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante Executor ou Carrying, informando a situação de batimento de corretagem.



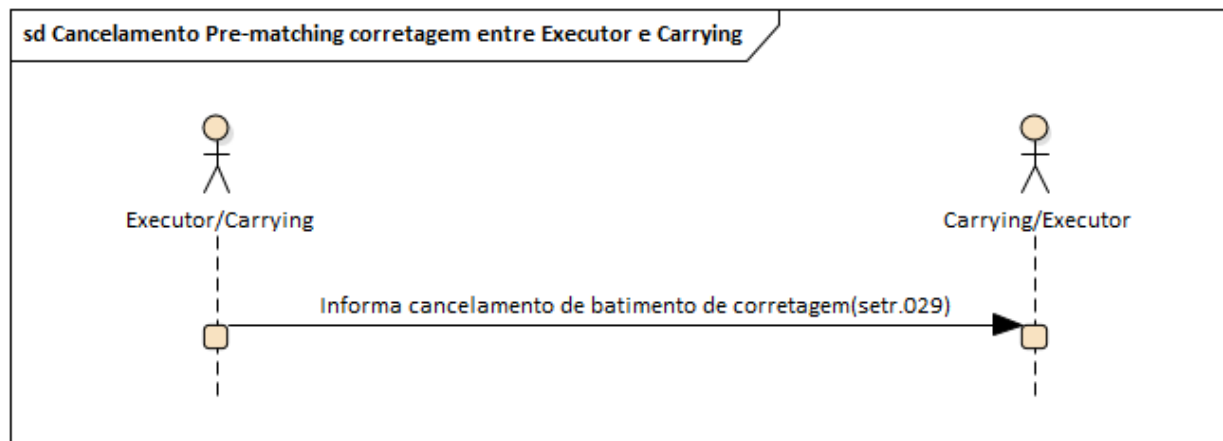
OBS: Caso o batimento seja rejeitado (unmatched) o fluxo deverá ser reiniciado.



## Cenário 2: Participante executor e carrying efetuam cancelamento de pre-matching para corretagem

Este fluxo ilustra o uso da mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation em típicos cenários sequenciais para solicitar cancelamento de Pre-matching para corretagem.

- O Participante Executor ou Carrying envia a mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01> ao Participante Executor ou Carrying, solicitando cancelamento de pre-matching para corretagem;



Não é necessária a aprovação do cancelamento da boletagem, ou seja, a aprovação é “tácita” pela contraparte.



## setr.027.001.03 – SecuritiesTradeConfirmation

### Funcionalidade da mensagem

A mensagem SecuritiesTradeConfirmation é enviada pelo Participante de Negociação Pleno (PNP), Participante de Liquidação (PL) ou Agente de Custódia (ACST) por meio do iMercado e detalha informações consolidadas de pre-matching por cliente e instrumento.

### Regras

**R1.** Opção única para este bloco.

**R2.** Preenchido somente quando a mensagem for enviada pela corretora.

**R3.** Este campo deve ser preenchido quando a mensagem for enviada pelo Custodiante.

**R4.** Caso o agente de custódia receba mais de uma setr.027 com a mesma quadra (data de pregão, ativo, natureza da operação, conta de custódia) o batimento deverá ser considerado incremental.

**R5.** Este campo deve ser preenchido quando o investidor não residente tiver domicílio em paraíso fiscal.

### Estrutura da Mensagem – SecuritiesTradeConfirmation (setr.027.001.03)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[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 Pre Match identifier.	Referência à identificação do Pre Match.	
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	
2.1.1	OR}	CommonIdentification	CmonId	[1..1]	Max35Text	string maxLength =	The “Pre-Matching ID” is unique reference (generated by the Broker) linked to a	O “Pre-matching ID” é uma referência única (gerada pela Corretora) vinculada a uma	R1



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
						35 minLength = 1	matching request to be agreed between the parties.	solicitação de batimento a ser acordado entre as partes.	
3.0		TradeDetails	TradDtls	[1..1]	+		Details of the trade.	Detalhes de um bloco de negócio.	
3.1		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	
3.2		TradeDate	TradDt	[1..1]	+		Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
3.2.1		Date	Dt	[1..1]	+		Date at which the securities are to be traded.	Data do pregão em que o negócio foi executado.	
3.2.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Numeric representation of the day of the month and year.	Representação numérica do dia, mês e ano no formato ISO.	
3.3		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	+		Date at which the securities are to be delivered or received.	Data de liquidação.	
3.3.1		Date	Dt	[1..1]	+		Date at which the securities are to be delivered or received.	Data em que os títulos devem ser entregues ou recebidos.	
3.3.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	date	Numeric representation of the day of the month and year.	Representação numérica do dia, mês e ano no formato ISO.	
3.4		ConfirmationQuantity	ConfQty	[1..1]	+		Identifies the trade quantity.	Quantidade negociada.	
3.4.1		Quantity	Qty	[1..1]	+		Quantity of financial instrument in units, original face amount or current face amount.	Quantidade de instrumentos financeiros em unidades, quantia original ou quantia atual.	
3.4.1.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.5		GrossTradeAmount	GrssTradeAmt	[0..1]	+		This block informs the gross trade amount.	Este bloco informa o volume bruto negociado.	R2
3.5.1		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.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
3.5.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
3.6		DealPrice	DealPric	[0..1]	+		Amount of money for which goods or services are offered, sold, or bought.	Este bloco especifica a cotação do instrumento financeiro negociado.	R2
3.6.1		Value	Val	[1..1]	+		Value of the price.	Valor da cotação negociada.	
3.6.1.1		Amount	Amt	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	decimal fractionDigits = 13 totalDigits = 18	Value of the price.	Valor da cotação negociada.	
3.7		AdditionalTradeInstructionProcessingInformation	AddlTradeInstrPrctlngInf	[0..1]	Max350Text	string maxLength = 350 minLength = 1	Provides additional details of the trade process not included within structured fields of this message. 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 ExternalPreMatchTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	Fornece detalhes adicionais do processo de negociação não incluídos nos campos estruturados desta mensagem.  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 BVMF. Neste caso o externo é ExternalPreMatchTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	R3
4.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier of a financial instrument, assigned under a formal or proprietary identification scheme.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
4.1		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	string pattern = [A-Z0-9]{12,12}	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	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:  a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL;	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
								<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> <p>e) o último caractere (7) é o dígito de controle.</p>	
5.0		ConfirmationParties	ConfPties	[1..1]	+		Parties involved in the confirmation of the details of a trade.	Partes envolvidas na confirmação dos detalhes de um negócio.	
5.1		ExecutingBroker	ExctgBrkr	[1..1]	+		Party responsible for executing an order (for example, an executing or give-up broker). Usually a commission is charged to the client for executing an order.	Parte responsável pela execução de uma ordem.	
5.1.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
5.1.1.1		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 schema de identificação proprietária.	
5.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.  This field requires an external code list.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
							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 identification is ExternaliMercadoRole in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	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.	
5.1.1.1.2		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 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.	
5.1.1.1.3		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 external 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.	
5.2		TradeBeneficiaryParty	TradBnf cryPty	[1..1]	+		This block identifies the custodian and account.	Este bloco identifica o agente de custódia, executor ou carrying e respectiva conta.	
5.2.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
5.2.1.1		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 schema de identificação proprietária.	
5.2.1.1.1		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 BM&amp;FBOVESPA. In this case the external identification 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&amp;FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternaliMercadoRole no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.</p>	
5.2.1.1.2		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 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.	
5.2.1.1.3		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 external 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.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
5.2.2		SafekeepingAccount	SfkpgAcct	[1..1]	+		This block identifies the custodian account.	Este bloco identifica a conta.	
5.2.2.1		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	
6.0		OtherBusinessParties	OthrBizPties	[0..1]	+		This block contains the account identification.	Este bloco contém a conta do investidor.	
6.1		Investor	Invstr	[1..1]	+		Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
6.1.1		SafekeepingAccount	SfkpgAcct	[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	
7.0		OtherAmounts	OthrAmts	[1..1]	+		This block contains the trade taxes.	Este bloco contém informações das taxas referente a um negócio.	
7.1		ChargesFees	ChrgsFees	[0..1]	+		Amount of money paid for the provision of financial services that cannot be categorised by another qualifier.	Valor da taxa de emolumento.	
7.1.1		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.	
7.1.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
7.2		LocalBrokerCommission	LclBrkrComssn	[0..1]	+		Amount of commission paid to a local broker.	Valor da taxa de corretagem.	
7.2.1		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.	
7.2.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	





INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
7.3		WithholdingTax	WhldgTax	[0..1]	+		Amount of money that will be withheld by a tax authority.	Valor do imposto.	R5
7.3.1		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.	
7.3.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
7.4		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.	Valor do volume líquido.	
7.4.1		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.	
7.4.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
7.5		LocalTaxCountrySpecific1	LclTaxCtrySpfc1	[0..1]	+		Registration fee.	Taxa de registro.	
7.5.1		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.	
7.5.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
7.6		LocalTaxCountrySpecific2	LclTaxCountrySpfc2	[0..1]	+		Settlement fee.	Taxa de liquidação.	
7.6.1		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.	
7.6.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
7.7		Other	Othr	[0..1]	+		Other tax.	Outras taxas	
7.7.1		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.	
7.7.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
8.0		Supplementary Data	SplmtryData	[1..1]	+		Additional information that cannot be captured in the structured elements and/or any other specific block.	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.	
8.1		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.	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem.  Neste caso, deve ser usado o XPATH.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
8.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+		Technical element wrapping the supplementary data.	Elemento técnico que especifica os dados complementares.	
8.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+		Technical element that specifies the supplementary data. Must be included the supplementary data XML structure in this point.	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	

### Estrutura da Mensagem – Supplementary Data SUPL.setr.027.001.03 - SecuritiesTradeConfirmationSD

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		FinancialInstrumentAttributesInformation	FinInstrmAttrbtsInf	[1..1]	+		Informations of the elements characterising a financial instrument.	Informações das características de um instrumento.	
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/FinInstrmId	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/FinInstrmId	
1.2		DistributionIdentification	Dstrbtnd	[0..1]	int	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
1.3		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 6 - Metal 7 - Energy 8 - Gov. Bonds 9 - FX This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible	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 5 - Financeiro 6 - Metais 7 - Energia elétrica 8 - Títulos públicos 9 - Câmbio  Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
							maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls	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.	
1.4		Market	Mkt	[0..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"> <li>1 - Spot Market</li> <li>2 - Futures Market</li> <li>3 - Options on Spot</li> <li>4 - Options on Futures</li> <li>5 - Forward</li> <li>10 - Cash</li> <li>12 - Options exercise (call)</li> <li>13 - Options exercise (put)</li> <li>17 - Auction</li> <li>20 - Odd Lot</li> <li>30 - Equity Forward</li> <li>70 - Equity Call</li> <li>80 - Equity Put</li> </ul> <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&amp;FBOVESPA updates. In this case the external 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"> <li>1 - MERCADO DISPONÍVEL</li> <li>2 - MERCADO FUTURO</li> <li>3 - OPÇÕES SOBRE DISPONÍVEL</li> <li>4 - OPÇÕES SOBRE FUTURO</li> <li>5 - MERCADO A TERMO</li> <li>10 - Vista</li> <li>12 - Exercício de opções de compra</li> <li>13 - Exercício de opções de venda</li> <li>17 - Leilão</li> <li>20 - Fracionário</li> <li>30 - Termo</li> <li>70 - OPC</li> <li>80 - OPV</li> </ul> <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>	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.5		TickerSymbol	TckrSym mb	[0..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	
1.6		PaymentType	PmtTp	[0..1]	ExternalPaymentTypeCode	int	Specifies how the transaction is to be settled. This field requires a list of external code. 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 file is in ExternalPaymentTypeCode ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	Este atributo identifica a forma de liquidação do 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 B3. Neste caso, o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	



## setr.044.001.02 - SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice

### Funcionalidade da mensagem

A mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice é enviada pelo Agente de Custódia (ACST) para informar a situação da conciliação do pre-matching.

### Regras

- R1.** Caso o participante aprove sem a necessidade de justificativa, deve-se informar apenas a tag "Matched (Mtchd)". Sendo necessária mais informações sobre a aprovação, deve-se utilizar a tag "AdditionalReasonInformation (AddtIRsnInf)".
- R2.** Os atributos "ExecutingPartyTransactionIdentification" e "CommonIdentification" são obrigatórios e devem ser informados nesta ordem de preenchimento no XML.
- R3.** Em situação de batimento com sucesso, se houver n instruções na corretora e 1 no agente de custódia, o campo deve ser preenchido de forma rateada.
- R4.** Em situação de desbatimento, o campo deve ser preenchido com valor zerado se houver n instruções na corretora e 1 no agente de custódia. Se houver 1 instrução na corretora e n no agente de custódia, o campo deverá ser preenchido com valor consolidado das instruções do cliente.
- R5.** Este campo deve ser preenchido quando o investidor não residente tiver domicílio em paraíso fiscal.

### Estrutura da mensagem – SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice (setr.044.001.02)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[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	[2..2]	+		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 setr.027.001.03.	Referência à identificação da transação feito por um participante. Também é usado para fazer referência a uma operação anterior. Número da transação atribuída pelo participante que enviou a mensagem setr.027.001.03.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	R2
2.1.1	{OR	ExecutingPartyTransactionIdentification	ExctgPartyTxId	[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.	
2.1.2	OR}	CommonIdentification	CmonId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	The "Pre-Matching ID" is unique reference (generated by the Broker) linked to a matching request to be agreed between the parties.	O "Pre-matching ID" é uma referência única (gerada pela Corretora) vinculada a uma solicitação de batimento a ser acordado entre as partes.	
3.0		MatchingStatus	MtchgStatus	[1..1]	+		Provides details on the matching status of a trade	Fornecer detalhes do status de matching de um negócio.	
3.1	{OR	Matched	Mtchd	[1..1]	+		Trade is matched.	Negócio aceito.	R1
3.1.1		AdditionalReasonInformation	AddtReasonInf	[0..1]	Max210Text	string maxLength = 210 minLength = 1	Provides additional information about the processed instruction.	Este campo contém informações adicionais sobre o status Matched.	
3.2	OR}	Unmatched	Umtchd	[1..1]	+		Trade is unmatched or mismatched.	Negócio recusado.	
3.2.1		Reason	Rsn	[1..*]	+		Specifies the reason of the UnmatchStatus.	Especifica o motivo do não aceite.	
3.2.1.1		Code	Cd	[1..1]	+		Specifies the reason why the instruction has an unmatched status.	Informa o motivo do status estar unmatched.	
3.2.1.1.1		Code	Cd	[1..1]	UnmatchedReason4Code	string	Specifies the reason why the instruction has an unmatched status.	Informa o motivo do status estar unmatched.	
3.2.1.2		AdditionalReasonInformation	AddtReasonInf	[0..1]	Max210Text	string maxLength = 210 minLength = 1	Provides additional information about the unmatched reason. Must be filled with the value expected by or the amount expected by the participant.	Este campo contém informações adicionais sobre o unmatched. Deve ser preenchido com o valor esperado pelo participante ou a quantidade esperada pelo participante.	
3.2.2	OR}	NoSpecifiedReason	NoSpecifiedRsn	[1..1]	NoReasonCode	string	Indicates that there is no reason available or to report.	Este campo deve ser preenchido quando o participante não deseja informar o motivo pela qual não concorda com os dados informados.	
4.0		ConfirmationParties	ConfParties	[1..1]	+		Parties involved in the confirmation of the details of a trade.	Partes envolvidas na confirmação dos detalhes de um negócio.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
4.1		ExecutingBroker	ExctgBrkr	[1..1]	+		This block contains the participant identification.	Este bloco contém a identificação do participante.	
4.1.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
4.1.1.1		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 schema de identificação proprietária.	
4.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.  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 identification 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.	
4.1.1.1.2		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 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.	
4.1.1.1.3		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	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	





INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
							requirements. In this case the external is ExternalIdentificationTypeCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações. Neste caso o externo é ExternalIdentificationTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.2		Investor	Invstr	[0..1]	+		Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
4.2.1		SafekeepingAccount	SfkpgAccount	[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	
4.3		TradeBeneficiaryParty	TradBnf cryPty	[1..1]	+		Identifies the Custodian ID code and the Custodian Account ID.	Contém as informações do agente de custódia executor ou carrying e respectiva conta.	
4.3.1		Identification	Id	[1..1]	+		Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
4.3.1.1		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 schema de identificação proprietária.	
4.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.  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 identification 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	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
								arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls.	
4.3.1.1.2		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 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.	
4.3.1.1.3		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 external 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.	
4.3.2		SafekeepingAccount	SfkpgAccount	[1..1]	+		This block identifies the custodian account.	Este bloco identifica a conta.	
4.3.2.1		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	
5.0		Supplementary Data	Splmtry Data	[1..1]	+		Additional information that cannot be captured in the structured elements and/or any other specific block.	Elemento opcional, que permite que dados adicionais sejam localizados em algum ponto específico na mensagem se necessário (PlaceAndName).	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
								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.	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 that specifies the supplementary data. Must be included the supplementary data XML structure in this point.	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	

**Estrutura da Mensagem SUPL.setr.044.001.02 – SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice**

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		SecuritiesTrade Information	SctiesTradInf	[1..1]	+		Provides additional trade informations.	Fornecer informações adicionais do negócio.	
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/SctiesTradConfStsAdv	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/SctiesTradConfStsAdv	
1.2		OtherAmounts	OthrAmts	[1..1]	+		This block contains the trade taxes.	Este bloco contém informações das taxas referente a um negócio.	
1.2.1		ChargesFees	ChrgsFees	[0..1]	+		Amount of money paid for the provision of financial services that cannot be categorised by another qualifier.	Valor da taxa de emolumento.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.2.1.1		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.	
1.2.1.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.2		LocalBrokerCommission	LclBrkrComssn	[0..1]	+		Amount of commission paid to a local broker.	Valor da taxa de corretagem.	
1.2.2.1		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.	
1.2.2.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.3		WithholdingTax	WhldgTax	[0..1]	+		Amount of money that will be withheld by a tax authority.	Valor do imposto.	R5
1.2.3.1		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.	
1.2.3.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.4		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.	Valor do volume líquido.	R3, R4
1.2.4.1		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.	
1.2.4.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.5		LocalTaxCountrySpecific1	LclTaxCountrySpfc1	[0..1]	+		Registration fee.	Taxa de registro.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.2.5.1		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.	
1.2.5.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.6		LocalTaxCountrySpecific2	LclTaxCountrySpfc2	[0..1]	+		Settlement fee.	Taxa de liquidação.	
1.2.6.1		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.	
1.2.6.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.2.7		Other	Othr	[0..1]	+		Other tax.	Outras taxas	
1.2.7.1		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.	
1.2.7.2		CreditDebitIndicator	CdtDbtInd	[0..1]	CreditDebitCode	string	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Indica se é um crédito ou um débito.	
1.3		ConfirmationQuantity	ConfQty	[1..1]	+		Identifies the trade quantity.	Quantidade negociada.	R3, R4
1.3.1		Quantity	Qty	[1..1]	+		Quantity of financial instrument in units, original face amount or current face amount.	Quantidade de instrumentos financeiros em unidades, quantia original ou quantia atual.	
1.3.1.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	decimal fractionDigits = 17 totalDigits = 18	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	



## setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation

### Funcionalidade da mensagem

A mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation é enviada pelo Agente de Custódia (ACST), Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) por meio do iMercado para solicitar o cancelamento do pre-matching.

**Importante:** No cenário de envio da mensagem de cancelamento (029) por parte do Agente de Custódia (ACST), Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) por meio do iMercado de uma mensagem que componha um bloco (ou seja, mesmo cliente, papel, pregão, liquidação, compra/venda) é necessário enviar todas as mensagens de cancelamento que compoam este bloco. Isso é importante pois não é possível 'desbater' parcialmente o bloco e, portanto, os cancelamentos devem ser feitos com o bloco todo e depois batidos novamente.

Caso a corretora/carrying não envie o cancelamento de todas as instruções, alguns custodiantes poderão enviar a solicitação de cancelamento de outras solicitações de batimento que compõe determinado bloco."

### Regras

**R1.** Opção única para este bloco.

### Estrutura da mensagem - setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[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 Pre Match identifier.	Referência à identificação do Pre Match.	



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	
2.1.1	OR}	CommonIdentification	CmonId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	The "Pre-Matching ID" is unique reference (generated by the Broker) linked to a matching request to be agreed between the parties.	O "Pre-matching ID" é uma referência única (gerada pela Corretora) vinculada a uma solicitação de batimento a ser acordado entre as partes.	R1
3.0		Supplementary Data	Splmtry Data	[1..1]	+		Additional information that cannot be captured in the structured elements and/or any other specific block.	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.	
3.1		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.	Referência única para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem.  Neste caso, deve ser usado o XPATH.	
3.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+		Technical element wrapping the supplementary data.	Elemento técnico que especifica os dados complementares.	
3.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+		Technical element that specifies the supplementary data. Must be included the supplementary data XML structure in this point.	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	



**Estrutura da mensagem SUPL.setr.029.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationCancellation**

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		ParticipantInformation	PtcptInf	[1..1]	+		Provides information about the Participant who requested the cancellation.	Fornecer informações sobre o Participante que solicitou o cancelamento.	
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/SctiesTradConfCxl	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O XPath do elemento que está sendo estendido é //Document/SctiesTradConfCxl	
1.2		ParticipantIdentification	PtcptId	[1..1]	+		Identification of the Participant.	Identificação do Participante.	
1.2.1		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 schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1		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 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).	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).	





INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.2.1.2		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.	
1.2.1.3		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 external 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.	



## setr.030.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationResponse

### Funcionalidade da mensagem

A mensagem SecuritiesTradeConfirmationResponse é enviada pelo Agente de Custódia (ACST), Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) por meio do iMercado para confirmar a solicitação de cancelamento de pre-matching.

### Regras

**R1.** Os atributos "ExecutingPartyTransactionIdentification" e "CommonIdentification" são obrigatórios e devem ser informados nesta ordem de preenchimento no XML.

### Estrutura da mensagem - setr.030.001.01 - SecuritiesTradeConfirmationResponse

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[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	[2..2]	+		Reference to the transaction identifier issued by a business party. it may also be used to refence a previous transaction. Transaction number assigned by the participant who sent the message setr.029.001.01.	Referência à identificação da transação feito por um participante. usado para fazer referência a uma transação anterior. Número da transação atribuída pelo participante que enviou a mensagem setr.029.001.01.	
2.1		Reference	Ref	[1..1]	+		Reference to the linked transaction.	Referência de uma transação.	R1



INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Data Type Details	Description	Descrição	Regra
2.1.1	{OR	ExecutingPartyTransactionIdentification	ExctgPartyTxId	[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.	
2.1.2	OR}	CommonIdentification	CmonId	[1..1]	Max35Text	string maxLength = 35 minLength = 1	The "Pre-Matching ID" is unique reference(generated by the Broker) linked to a matching request to be agreed between the parties.	O "Pre-matching ID" é uma referência única (gerada pela Corretora) vinculada a uma solicitação de batimento a ser acordado entre as partes.	
3.0		Status	Sts	[1..1]	+		This block contains the details about accepting or rejecting Pre Match cancellation.	Este bloco contém os detalhes sobre o aceite ou rejeição do cancelamento do Pre Match.	
3.1		AffirmStatus	AffirmSts	[1..1]	+		This block contains information on acceptance or rejection of the transaction.	Este bloco contém informação do aceite ou rejeição da transação.	
3.1.1		Code	Cd	[1..1]	AffirmStatus1Code	string	AFFI: Acceptance NAFI: Rejection	AFFI: Aceito NAFI: Rejeitado	
3.2		AdditionalReasonInformation	AddtReasonInf	[0..1]	Max210Text	string maxLength = 210 minLength = 1	Provides additional information about the reject reason.	Informa o motivo da rejeição referente ao valor financeiro.	