



Definição – Anexo I - Catálogo de Mensagens

Data: 29/08/2023

iMercado – Pre-Matching

Anexo I - iMercado – Pre-Matching

Cenários de Negócio

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



Definição – Anexo I - Catálogo de Mensagens

Data: 29/08/2023

iMercado – Pre-Matching

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição
13/07/2018	1.0	Versão inicial.
06/09/2018	1.1	Sugestão da composição do Pre-Match Id e ajustes nos Cenários.
15/03/2019	1.2	Ajustes nos cenários.
09/05/2019	1.3	Inclusão de de/para de códigos de erro.
27/05/2019	1.4	Atualização de de/para de códigos de erro.
28/08/2023	1.5	Inclusão de considerações para o atributo “CommonIdentification” no tópico “Pre-Match Identification” e comentários nos cenários que envolvam cancelamento de solicitações de batimento.
29/08/2023	1.6	Inclusão das mensagens <setr.029> e <setr.030> solicitação e aprovação/reprovação de cancelamento de pre-matching no cenário 5.



Conteúdo

Histórico de Revisão	2
Visão geral	4
<i>Escopo</i>	4
<i>Lista de Mensagens</i>	5
Cenários de Negócio.....	6
<i>Cenário 1: Modelo de batimento total – situação matched</i>	6
<i>Cenário 2: Modelo de batimento total - situação unmatched e depois matched</i>	8
<i>Cenário 3: Modelo de batimento incremental – situação matched (acrécimo de quantidade)</i>	12
<i>Cenário 4: Modelo de batimento incremental – situação matched (decrécimo de quantidade)</i>	15
<i>Cenário 5: Modelo de batimento incremental – situação unmatched e depois matched</i>	19
<i>Cenário 6: Agente de Custódia informa dados de pre-matching</i>	23
<i>Cenário 7: Pre-matching entre PNP e PL</i>	24
Pre-Match Identification	26
De/Para de Códigos de Erros.....	27



Definição – Anexo I - Catálogo de Mensagens

Data: 29/08/2023

iMercado – Pre-Matching

Visão geral

Escopo

Este documento descreve alguns cenários referentes ao fluxo de pre-matching com a utilização de mensagens desenvolvidas pela B3 para o iMercado.



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. SecuritiesTradeConfirmationReponse <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.



Cenários de Negócio

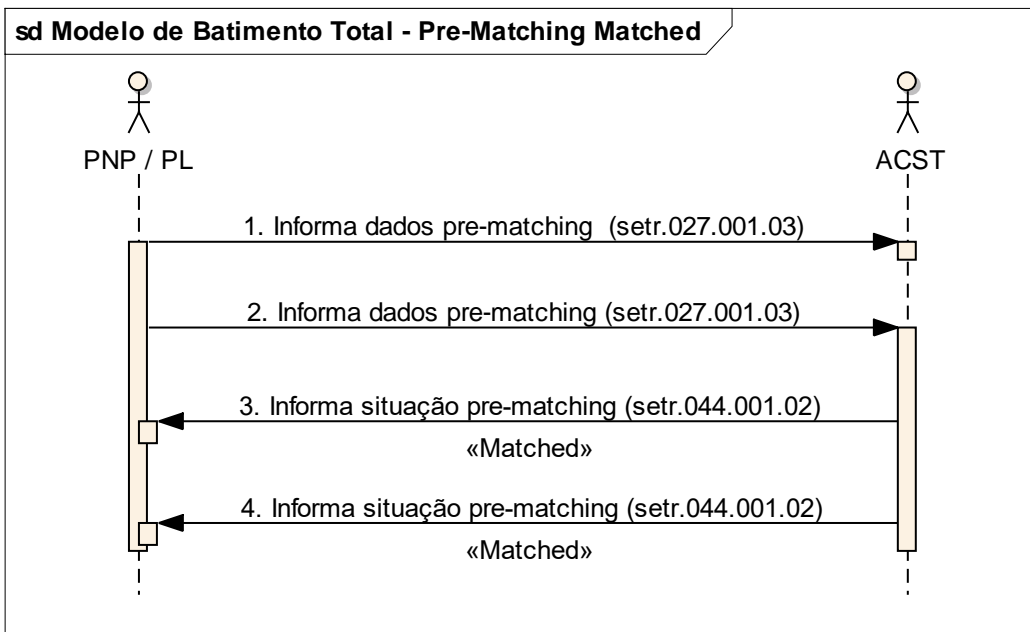
Cenário 1: Modelo de batimento total – situação matched

Descrição:

O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) possui **duas contas** em titularidade do cliente.

O Agente de Custódia (ACST) possui **uma conta de custódia** em titularidade do cliente.

1. e 2. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia duas mensagens (uma para cada conta) SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia, informando dados de pre-matching;
3. e 4. O Agente de Custódia envia duas mensagens SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação, informando a situação da conciliação de dados do pre-matching – MATCHED.



1. e 2. PNP/PL informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T123456799	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE1	V	18/02/2019	21/02/2019	1000	10.00	10.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-10.300,00	1515	84	1516	22	VALE5
T123456791	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE2	V	18/02/2019	21/02/2019	2000	10.00	20.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-20.300,00	1515	85	1516	22	VALE5



3. e 4. ACST informa situação pre-matching (setr.044.001.02-SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice)

Transaction Id	PreMatch Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Matched	AdditionalReasonInformation
T9876543212	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE1	T123456799	Mtchd	Texto livre opcional
T9876543211	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE2	T123456791	Mtchd	Texto livre opcional

Cenário 2: Modelo de batimento total - situação unmatched e depois matched**Descrição:**

O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) possui **uma conta** em titularidade do cliente.

O Agente de Custódia (ACST) possui **uma conta de custódia** em titularidade do cliente.

1. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia, informando dados de pre-matching;
2. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno, informando a situação da conciliação de dados do pre-matching – UNMATCHED;
3. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01> ao Agente de Custódia, solicitando cancelamento de pre-matching;
4. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação, confirmando o cancelamento de pre-matching;



O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação realiza os ajustes necessários;

5. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma nova mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia, informando novos dados de pre-matching;
6. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação com situação de dados do pre-matching – MATCHED.

sd Modelo de Batimento Total Pre-Matching - Unmatched e depois Matched



1. PNP/PL informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T123456709	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE3	V	18/02/2019	21/02/2019	1000	10.00	10.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-10.300,00	1515	84	1516	22	VALE5

2. ACST informa situação pre-matching (setr.044.001.02-SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice)

Transaction Id	PreMatch Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	UnmatchedReason	AdditionalReasonInformation
T098765412	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE3	T123456709	DQUA (Financial Instrument Quantity)	Texto livre opcional

3. PNP/PL solicita cancelamento de pre-matching (setr.029.001.01-SecuritiesTradeConfirmationCancellation)

Transaction Id	Pre Match Id
T547890007	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE3

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 componham 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."



4. ACST aprova cancelamento de pre-matching

Transaction Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Pre Match Id	Aceitação/Reprovação
T663021343	T547890007	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE3	AFFI - Aceito

5. PNP/PL informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T345234333	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE4	V	18/02/2019	21/02/2019	2000	10.00	20.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-20.300,00	1515	84	1516	22	VALE5

6. ACST informa situação pre-matching (setr.044.001.02-SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice)

Transaction Id	PreMatch Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Matched	AdditionalReasonInformation
T654709766	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE4	T345234333	Mtchd	Texto livre opcional

Cenário 3: Modelo de batimento incremental – situação matched (acréscimo de quantidade)

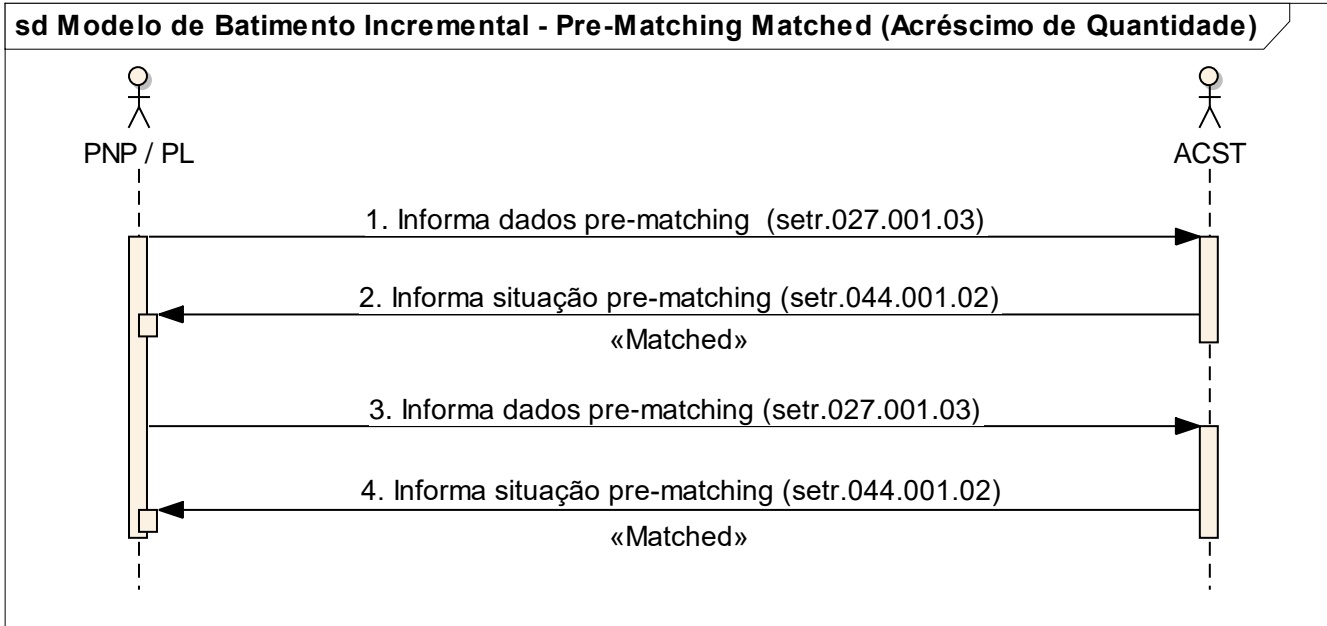
Descrição:

O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) possui **uma conta** em titularidade do cliente.

O Agente de Custódia (ACST) possui **uma conta de custódia** em titularidade do cliente.

1. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia, informando dados de pre-matching;

2. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação, informando a situação da conciliação de dados do pre-matching – MATCHED;
3. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia, informando dados de pre-matching;
4. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação, informando a situação da conciliação de dados do pre-matching – MATCHED.





Anexo I – Cenários de Negócio

Data: 29/08/2023

iMercado Pre-Matching

1. PNP/PL informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T123456799	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE5	V	18/02/2019	21/02/2019	1000	10.00	10.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-10.300,00	1515	84	1516	22	VALE5

2. ACST informa situação pre-matching (setr.044.001.02-SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice)

Transaction Id	PreMatch Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Matched	AdditionalReasonInformation
T9876543212	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE5	T123456799	Mtchd	Texto livre opcional

3. PNP/PL informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T123456791	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE6	V	18/02/2019	21/02/2019	2000	10.00	20.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-20.300,00	1515	84	1516	22	VALE5

4. ACST informa situação pre-matching (setr.044.001.02-SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice)

Transaction Id	PreMatch Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Matched	AdditionalReasonInformation
T9876543211	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE6	T123456791	Mtchd	Texto livre opcional

Quantidade total de ativos matched: 3.000.

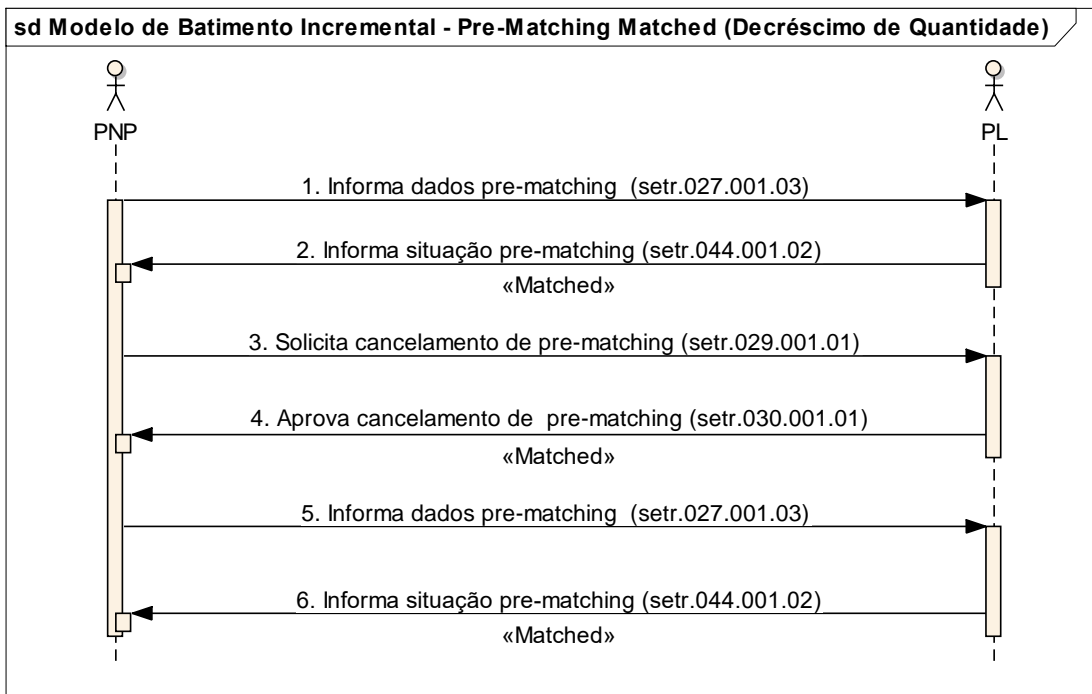
Cenário 4: Modelo de batimento incremental – situação matched (decrécimo de quantidade)

Descrição:

O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) possui **uma conta** em titularidade do cliente.

O Agente de Custódia (ACST) possui **uma conta de custódia** em titularidade do cliente.

1. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia, informando dados de pre-matching;
2. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação, informando a situação da conciliação de dados do pre-matching – MATCHED;
3. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.01> ao Agente de Custódia, solicitando cancelamento de pre-matching;
4. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação, confirmando o cancelamento de pre-matching;
5. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia, informando dados de pre-matching;
6. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação, informando a situação da conciliação de dados do pre-matching – MATCHED.



1. PNP/PL informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T123456799	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRELIVRES	V	18/02/2019	21/02/2019	1000	10.00	10.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-10.300,00	1515	84	1516	22	VALE5



2. ACST informa situação pre-matching (setr.044.001.02-SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice)

Transaction Id	PreMatch Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Matched	AdditionalReasonInformation
T9876543212	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE5	T123456799	Mtchd	Texto livre opcional

3. PNP/PL solicita cancelamento de pre-matching (setr.029.001.01-SecuritiesTradeConfirmationCancellation)

Transaction Id	Pre Match Id
T547890007	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE5

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 componham 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."

4. ACST aprova cancelamento de pre-matching

Transaction Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Pre Match Id	Aceitação/Reprovação
T663021343	T547890007	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE5	AFFI - Aceito



Anexo I – Cenários de Negócio

Data: 29/08/2023

iMercado Pre-Matching

5. PNP/PL informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T123456799	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE9	V	18/02/2019	21/02/2019	700	10.00	10.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-10.300,00	1515	84	1516	22	VALE5

6. ACST informa situação pre-matching (setr.044.001.02-SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice)

Transaction Id	PreMatch Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Matched	AdditionalReasonInformation
T9876543212	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE9	T123456799	Matched	Texto livre opcional

Quantidade total de ativos matched: 700.

Cenário 5: Modelo de batimento incremental – situação unmatched e depois matched

Descrição:

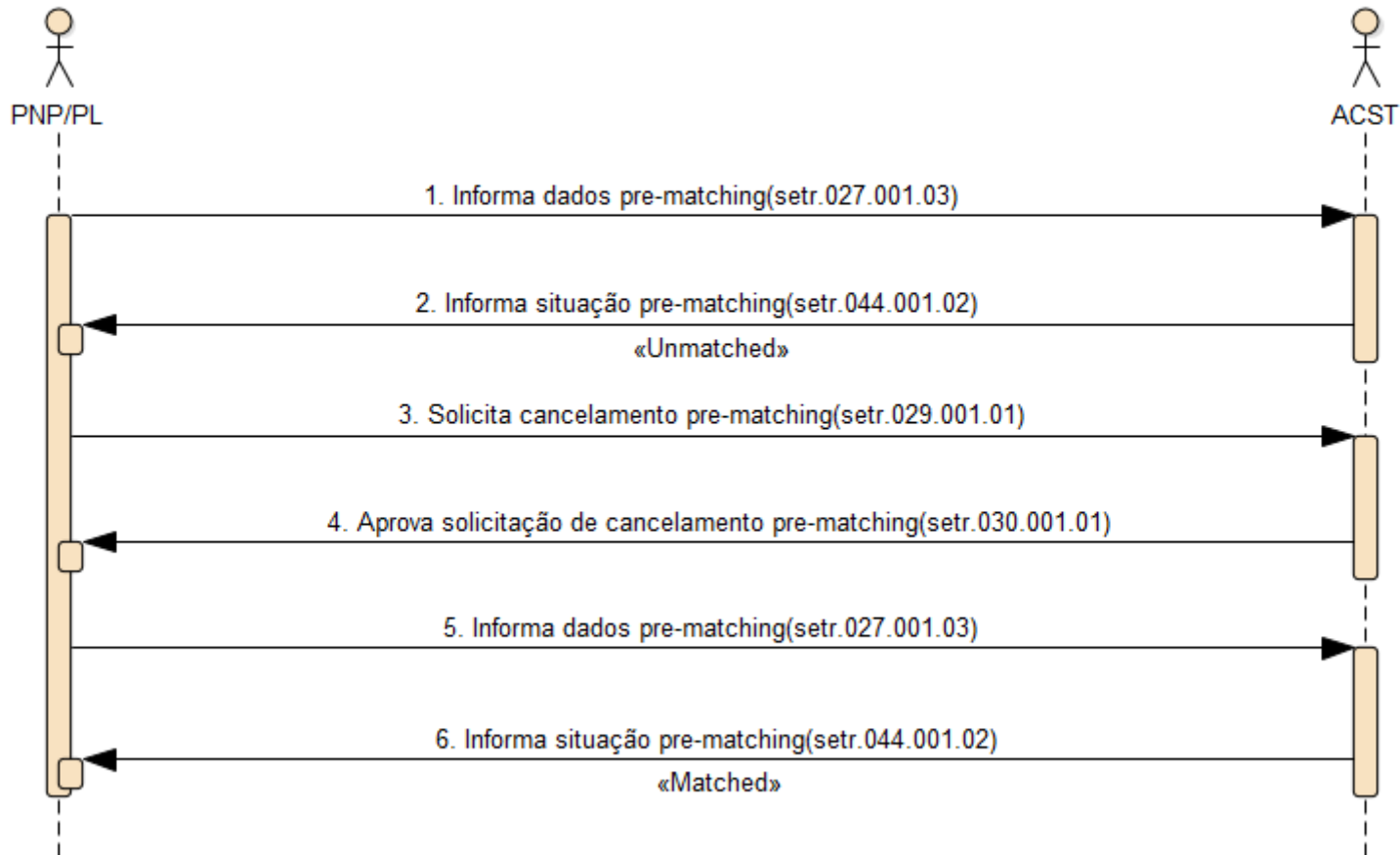
O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) possui **uma conta** em titularidade do cliente.

O Agente de Custódia (ACST) possui **uma conta de custódia** em titularidade do cliente.

1. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia, informando dados de pre-matching;
2. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno, informando a situação da conciliação de dados do pre-matching – **UNMATCHED**;
3. O participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation <setr.029.001.001> ao Agente de Custódia, solicitando o cancelamento do pre-matching.
4. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationResponse <setr.030.001.01> ao participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação aprovando a solicitação de cancelamento do pre-matching.

O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação realiza os ajustes necessários;

5. O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia uma nova mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Agente de Custódia, informando novos dados de pre-matching,
6. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação com situação de dados do pre-matching – **MATCHED**.

sd Modelo de Batimento Incremental Pre-Matching - Unmatched e depois Matched



1. PNP/PL informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T123456709	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE7	V	18/02/2019	21/02/2019	1000	10.00	10.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-10.300,00	1515	84	1516	22	VALE5

2. ACST informa situação pre-matching (setr.044.001.02-SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice)

Transaction Id	PreMatch Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	UnmatchedReason	AdditionalReasonInformation
T098765412	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE7	T123456709	DQUA (FinancialInstrumentQuantity)	Texto livre opcional

3. PNP/PL solicita o cancelamento do pre-matching (setr.029.001.01- SecuritiesTradeConfirmationCancellation)

Transaction Id	Pre Match Id
T547890009	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE7

4. ACST aprova cancelamento de pre-matching (setr.030.001.01 – SecuritiesTradeConfirmationResponse)

Transaction Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Pre Match Id	Aceitação/Reprovação
T663021355	T547890009	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE7	AFFI - Aceito

5. PNP/PL informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T345234333	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVREO	V	18/02/2019	21/02/2019	3000	10.00	20.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-20.300,00	1515	84	1516	22	VALE5



Anexo I – Cenários de Negócio

Data: 29/08/2023

iMercado Pre-Matching

5. ACST informa situação pre-matching (setr.044.001.02-SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice)

Transaction Id	PreMatch Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Matched	AdditionalReasonInformation
T654709766	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVREO	T345234333	Mtchd	Texto livre opcional

Quantidade total de ativos matched: 3.000.

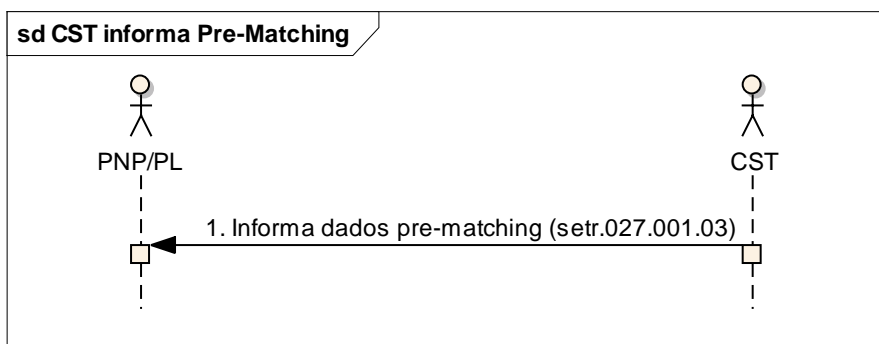
Cenário 6: Agente de Custódia informa dados de pre-matching

Descrição:

O Participante de Negociação Pleno (PNP) ou Participante de Liquidação (PL) possui duas contas em titularidade do cliente.

O Agente de Custódia (ACST) possui uma conta de custódia em titularidade do cliente.

1. O Agente de Custódia envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação, informando dados de pre-matching;



1. ACST informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T123456709	1515000000015160000022VALE5C060918A	C	06/09/2018	12/09/2018	1000	10.00	10.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-10.300,00	1515	N/A	1516	22	VALE5

Cenário 7: Pre-matching entre PNP e PL

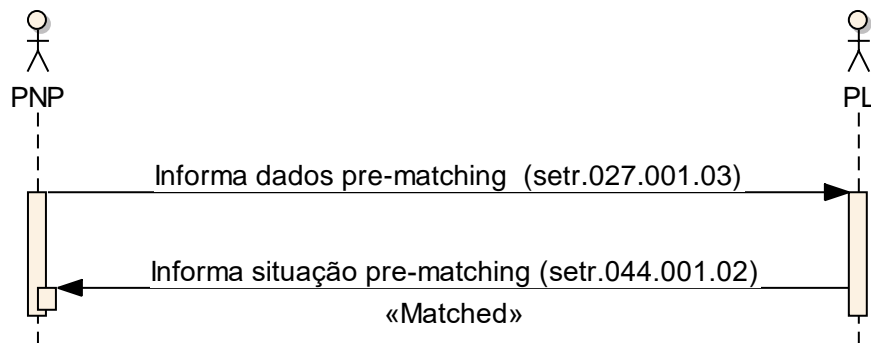
Descrição:

O Participante de Negociação Pleno (PNP) possui uma conta em titularidade do cliente.

O Agente de Custódia (ACST) possui uma conta de custódia em titularidade do cliente.

1. O Participante de Negociação Pleno envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmation <setr.027.001.03> ao Participante de Liquidação, informando dados de pre-matching;
2. O Participante de Liquidação envia uma mensagem SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice <setr.044.001.02> ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação, informando a situação da conciliação de dados do pre-matching – MATCHED.

sd Informa Dados de Pre-Matching - PNP/PL





Anexo I – Cenários de Negócio

Data: 29/08/2023

iMercado Pre-Matching

1. PNP informa dados pre-matching (setr.027.001.03-SecuritiesTradeConfirmation)

Transaction Id	PreMatch Id	Side	Trade Date	Settlement Date	Quant.	Price	Gross Amount	Corretagem	Emolumento	Outros	Net Amount	Broker	Broker Acc	ACST	ACST Acc	Symbol
T123456799	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE1	V	18/02/2019	21/02/2019	1000	10.00	10.000,00	-100,00	-100,00	-100,00	-10.300,00	1515	84	1516	22	VALE5

3. PL informa situação pre-matching (setr.044.001.02-SecuritiesTradeConfirmationStatusAdvice)

Transaction Id	PreMatch Id	ExecutingPartyTransactionIdentification	Matched	AdditionalReasonInformation
T9876543212	1515LIVRELIVRELIVRELIVRELIVRE1	T123456799	Mtchd	Texto livre opcional

Obs.: Os modelos de batimento total e incremental são aplicáveis também ao pre-matching entre PNP e PL.



Pre-Match Identification

Nas mensagens de pre-matching do iMercado, o campo CommonIdentification é utilizado como identificador da transação de pre-matching. A composição sugerida para uso desse campo contém nas primeiras quatro posições a identificação do participante que envia a mensagem e as demais posições são de preenchimento livre.

- Código do Participante (PNP/PL ou ACST). Caso o número de identificação do participante seja menor do que 4 dígitos, devem ser adicionados zeros à esquerda.
- Posição livre, alfanumérica.
- O atributo “CommonIdentification” (tag:CmonId) é único e, não deve ser repetido a cada SETR.027 enviadas, mesmo que a composição para a formação do Pre-Matching seja a mesma. Isso é de suma importância para garantir que não haja batimento repetido erroneamente e para assegurar eventual identificação e cancelamento do negócio, se necessário.

Composição do CommonIdentification	Posição Inicial	Posição Final	Total de Caracteres	Exemplo de Conteúdo
Código do participante que envia a mensagem (PNP/PL ou ACST)	1	4	4	0012
Posição livre	5	35	31	0030142018091020161104114539369

Exemplo de Pre-Match Identification: **00120030142018091020161104114539369**



De/Para de Códigos de Erros

De/para de códigos de erros internos do Agente de Custódia e códigos de erro ISO20022.

Descrição do erro interno	UnmatchedReason4Code (ISO20022)
Insufficient funds	MTCH
Short shares to deliver	MTCH
Multiple fail reasons	CMIS
Discrepancy with c/p - BRL difference	DMON
Discrepancy with c/p - share difference	DQUA
Trade confirmed by a different broker	CPCA
Discrepancy with c/p - security difference	OTHI
Discrepancy with c/p - transaction type difference	SETS
Discrepancy with c/p - date difference	DDAT
Discrepancy with c/p - account number difference	SAFE
Counterparty missing instructions	LATE
Pre-match in process	DBNM
Instruction received late	ADEA
Awaiting client cancellation	OLID
Possible duplicate instruction	PODU
Prematched	MTCH
Client wants to cancel and match another trade	MCAN
Prematch not attempted	NARR