



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<br>2. Criação da mensagem setr.029.001.01<br>3. Criação da mensagem setr.030.001.01<br>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.<br>Alterações nas mensagens setr.030.001.01, setr.029.001.01 e setr.027.001.03<br>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.  |
| 02/09/2022 | 1.5    | 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 | 1.6    | 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      | 1.3               |
| 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 | 1.1               |



## 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 - Operações</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.



## 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.

Esta mensagem também pode ser utilizada entre Participante Executor e Carrying para efetuar o batimento de corretagem.

### 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.

Esta mensagem também pode ser utilizada entre Participante Executor e Carrying para informar a situação do batimento de corretagem.

### 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.

Esta mensagem também pode ser utilizada entre Participante Executor e Carrying para solicitar o cancelamento do batimento de corretagem.

### 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 - Operações

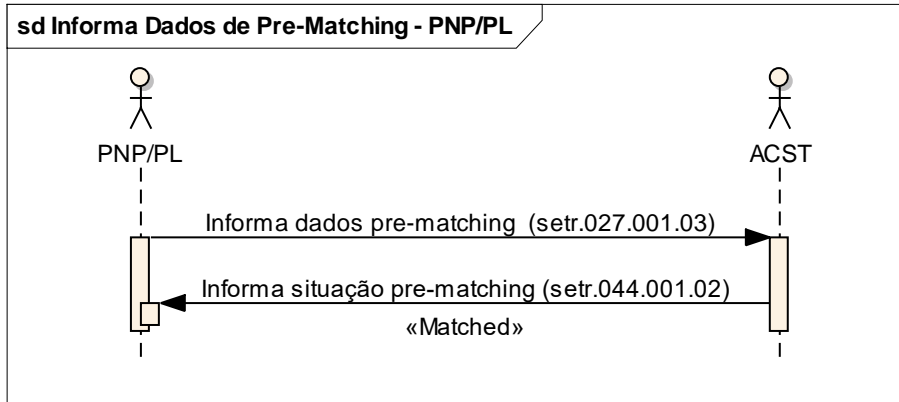
#### Introdução

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.

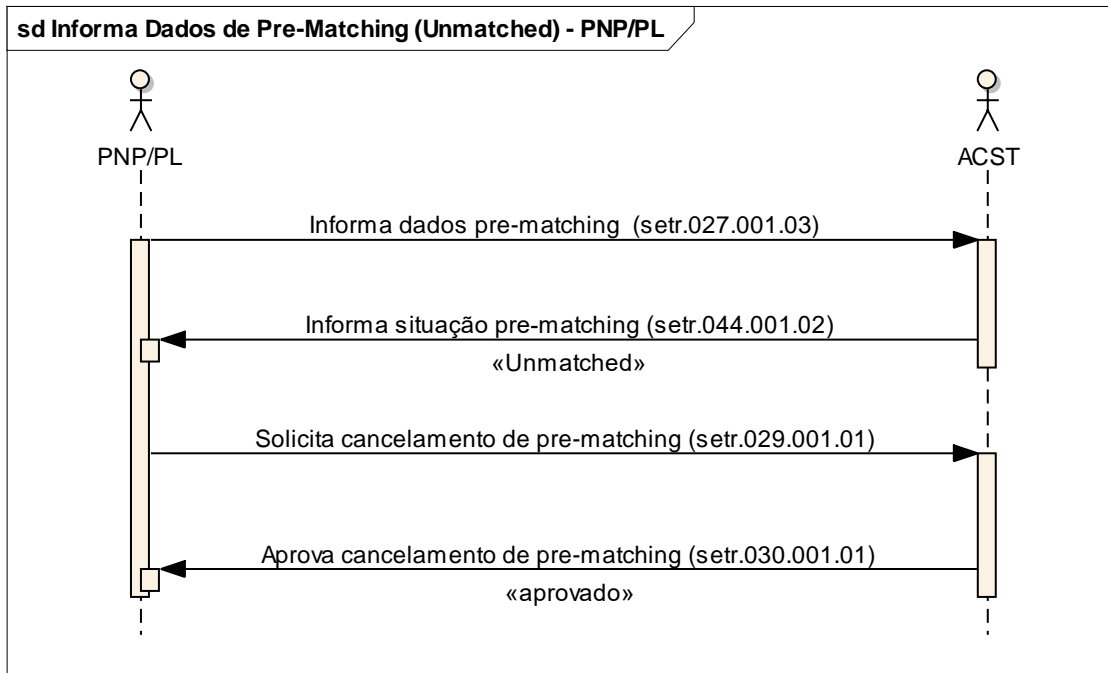


## Cenário 2: Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação informa pre-matching - Unmatched

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.

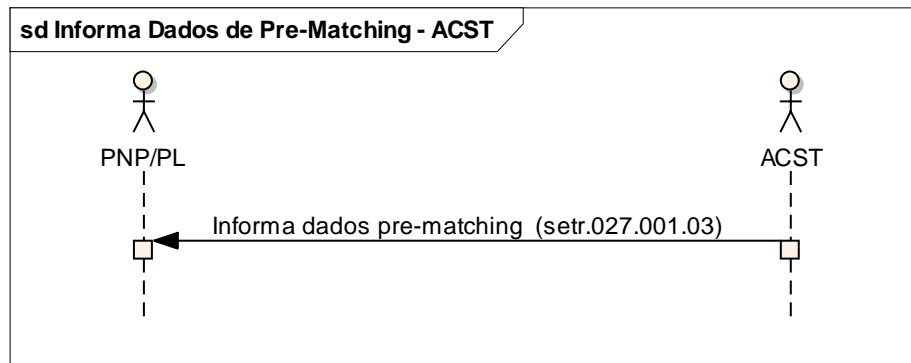




### Cenário 3: Agente de Custódia informa pre-matching

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.



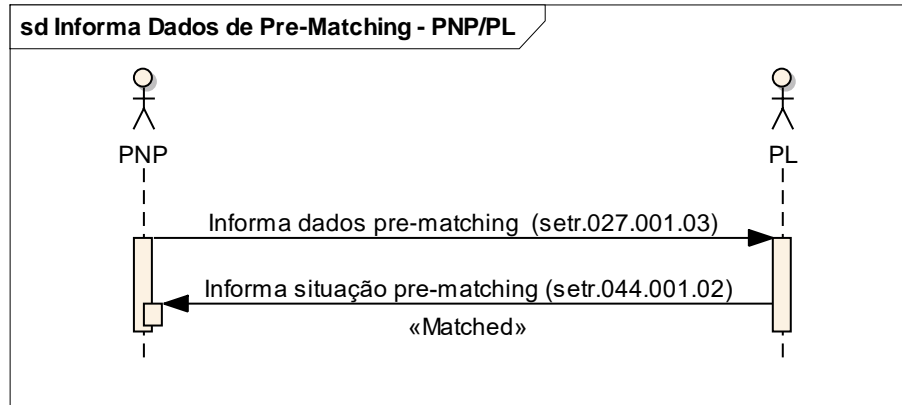
### Cenário 4: Participante de Negociação Pleno informa pre-matching - Matched

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

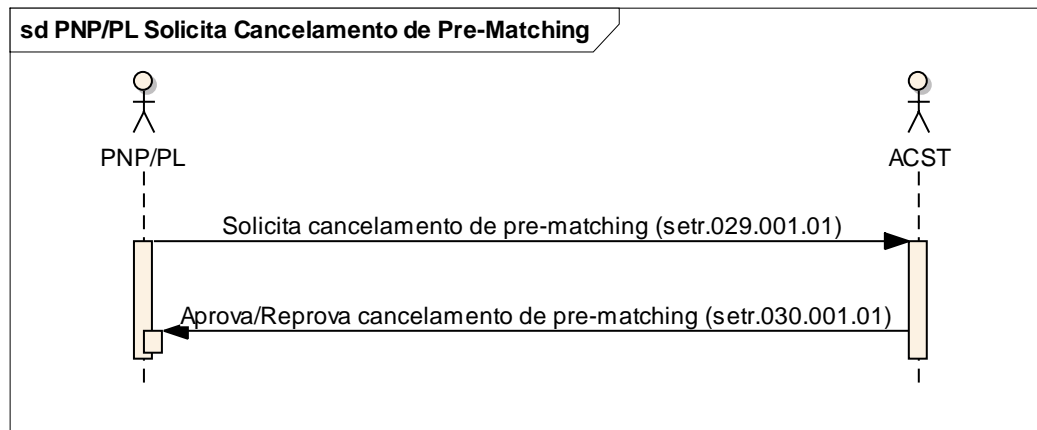
Este fluxo ilustra o uso da mensagem SecuritiesTradeConfirmationCancellation em típicos cenários sequenciais para solicitar cancelamento de Pre-matching.

### 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.

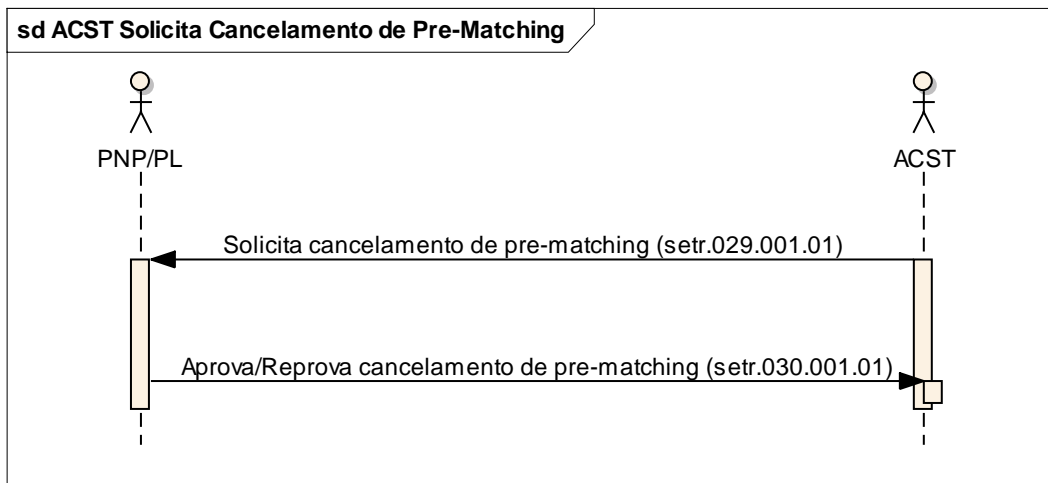


## Cenário 2: Agente de Custódia solicita cancelamento de pre-matching

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

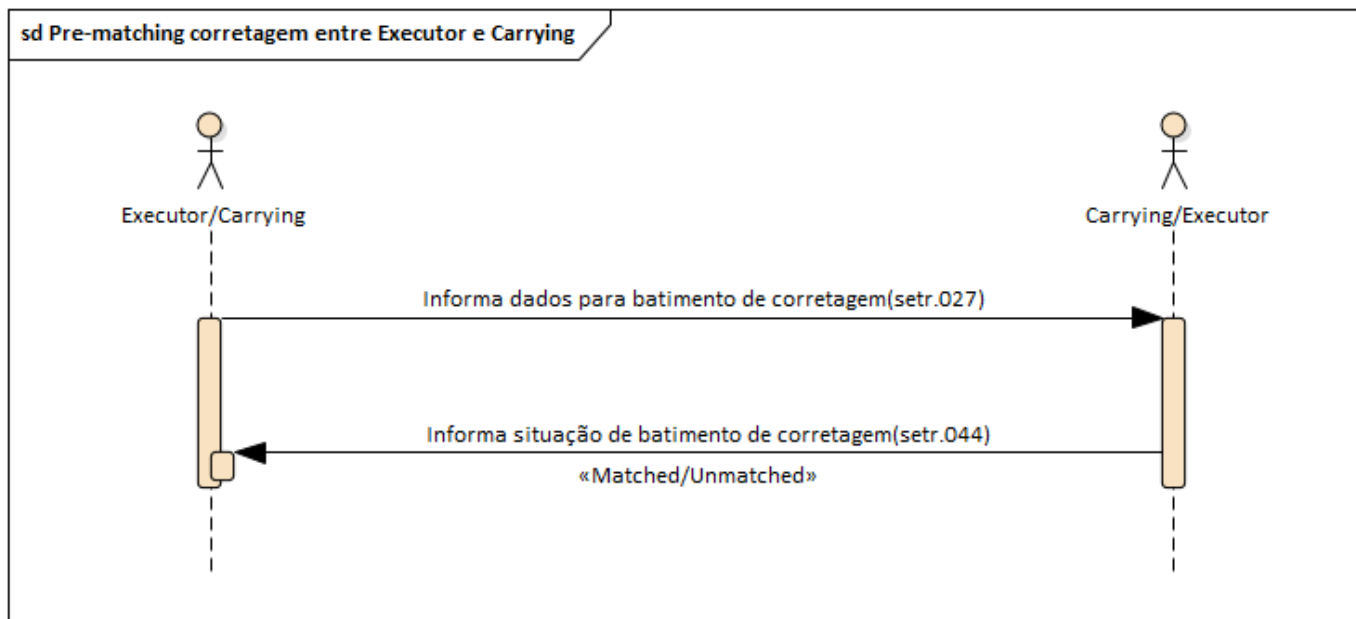
### Introdução

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.



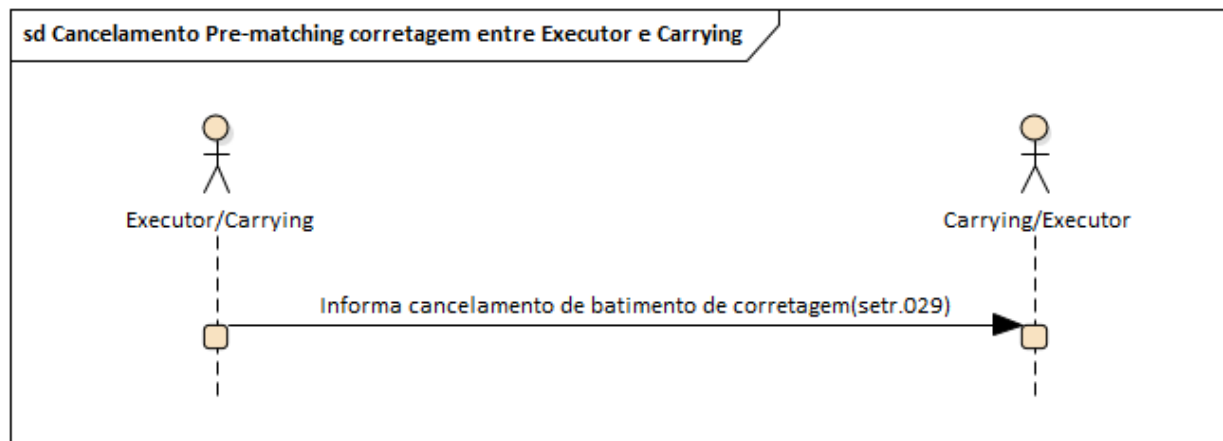
OBS: Caso o batimento seja rejeitado (unmatched) o fluxo deverá ser reiniciado.



## 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.

### 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<br>maxLength = 35<br>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<br>maxLength = 35<br>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   |     | 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.<br><br>Os códigos válidos são BUYI e SELL                     |       |



| INDEX   | OR | Message Item         | Tag          | Mult.  | Data Type                                  | Data Type Details  | Description   | Descrição  | Regra |
|---------|----|----------------------|--------------|--------|--|--|---|--|-------|
| 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<br>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<br>minInclusive = 0<br>totalDigits = 18 | Price expressed as a currency and value.  | Preço expresso em valor e moeda.   |       |
| 3.5.2   |    | CreditDebitIndicator | CdtDblInd    | [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<br>totalDigits = 18                    | Value of the price.   | Valor da cotação negociada.  |       |



| INDEX | OR | Message Item                      | Tag         | Mult.  | Data Type      | Data Type Details                   | Description  | Descrição   | Regra |
|-------|----|-----------------------------------|-------------|--------|----------------|-------------------------------------|--|---|-------|
| 4.0   |    | FinancialInstrumentIdentification | FinInstrmId | [1..1] | +              |                                     | Unique and unambiguous identifier of a financial instrument, assigned under a formal or proprietary identification scheme.   | Fornecer detalhes da identificação do instrumento.  |       |
| 4.1   |    | ISIN                              | ISIN        | [0..1] | ISINIdentifier | string<br>pattern = [A-Z0-9]{12,12} | International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nations 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. | <p>INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER – É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7, onde:</p> <p>a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL;</p> <p>b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor;</p> <p>c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter sequência automática na segunda posição (sequência 1) e na terceira posição (sequência 2) ou não ter qualquer sequência;</p> <p>d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma sequência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias; e</p> <p>e) o último caractere (7) é o dígito de controle.</p> |       |



| INDEX     | OR | Message Item              | Tag       | Mult.  | Data Type | Data Type Details                         | Description   | Descrição  | Regra |
|-----------|----|---------------------------|-----------|--------|-----------|---|---|--|-------|
| 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<br>maxLength = 35<br>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> |       |
| 5.1.1.1.2 |    | Issuer                    | Issr      | [1..1] | Max35Text | string<br>maxLength = 35<br>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<br>maxLength =                     | Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE IMERCADO. This field   | Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE   |       |



| INDEX     | OR | Message Item              | Tag            | Mult.  | Data Type | Data Type Details                         | Description  | Descrição   | Regra |
|-----------|----|---------------------------|----------------|--------|-----------|---|--|---|-------|
|           |    |                           |                |        |           | 35<br>minLength = 1                       | 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.  | 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.   |       |
| 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<br>maxLength = 35<br>minLength = 1 | Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.<br><br>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.<br><br>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. |       |
| 5.2.1.1.2 |    | Issuer                    | Issr           | [1..1] | Max35Text | string<br>maxLength = 35<br>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  | Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas   |       |



| INDEX     | OR | Message Item         | Tag          | Mult.  | Data Type | Data Type Details                         | Description   | Descrição  | Regra |
|-----------|----|----------------------|--------------|--------|-----------|---|---|--|-------|
|           |    |                      |              |        |           |   | the updates requirements. In this case the external is ExternalIssuerCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls  | 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<br>maxLength = 35<br>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. |       |
| 5.2.2     |    | SafekeepingAccount   | SfkpgAccount | [1..1] | +         |   | This block identifies the custodian account.  | Este bloco identifica a conta.   |       |
| 5.2.2.1   |    | Identification       | Id           | [1..1] | Max35Text | string<br>maxLength = 35<br>minLength = 1 | Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g<br><br>115 = Account Number   | Número de identificação da conta.<br><br>Identificação única para a conta do investidor. Ex:<br><br>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.  | Fornecer dados de identificação da conta.  |       |
| 6.1.1     |    | SafekeepingAccount   | SfkpgAccount | [1..1] | Max35Text | string<br>maxLength = 35<br>minLength = 1 | Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g<br><br>115 = Account Number   | Número de identificação da conta.<br><br>Identificação única para a conta do investidor. Ex:   |       |



| INDEX | OR | Message Item          | Tag           | Mult.  | Data Type                         | Data Type Details  | Description   | Descrição   | Regra |
|-------|----|-----------------------|---------------|--------|-----------------------------------|--|---|---|-------|
|       |    |                       |               |        |                                   |  |   | 115 = Número da Conta   |       |
| 7.0   |    | OtherAmounts          | OthrAmt s     | [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.                            |       |
| 7.3   |    | WithholdingTax        | WhldgTax      | [0..1] | +                                 |  | Amount of money that will be withheld by a tax authority.   | Valor do imposto.   |       |
| 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.                            |       |





| INDEX | OR | Message Item             | Tag                | Mult.  | Data Type                         | Data Type Details   | Description   | Descrição                            | Regra |
|-------|----|--------------------------|--------------------|--------|-----------------------------------|---|---|--------------------------------------|-------|
| 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<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0<br>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 | LclTaxCountrySpfc1 | [0..1] | +                                 |   | Registration fee.   | Taxa de registro.                    |       |
| 7.5.1 |    | Amount                   | Amt                | [1..1] | ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount | decimal<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0<br>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. |       |
| 7.6   |    | LocalTaxCountrySpecific2 | LclTaxCountrySpfc2 | [0..1] | +                                 |   | Settlement fee.   | Taxa de liquidação.                  |       |
| 7.6.1 |    | Amount                   | Amt                | [1..1] | ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount | decimal<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0<br>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. |       |



| INDEX | OR | Message Item         | Tag         | Mult.  | Data Type                         | Data Type Details   | Description   | Descrição   | Regra |
|-------|----|----------------------|-------------|--------|-----------------------------------|---|---|---|-------|
| 7.7   |    | Other                | Othr        | [0..1] | +                                 |   | Other tax.  | Outras taxas  |       |
| 7.7.1 |    | Amount               | Amt         | [1..1] | ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount | decimal<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0<br>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<br>maxLength = 350<br>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.<br><br>Neste caso, deve ser usado o XPATH.  |       |
| 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<br>maxLength = 350<br>minLength = 1 | Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance.<br>XPath to the element that is being extended<br>//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<br>//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.<br>Example:<br><br>1 - Equity - Cash<br>2 - Equity derivative<br>3 - Corporate bonds<br>4 - Agribusiness<br>5 - Financial<br>6 - Metal<br>7 - Energy<br>8 - Gov. Bonds<br>9 - FX<br><br>This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external file is ExternalSegmentCode in the file ExternalCodeLists_iMERCADO.xls | Segmento representa o primeiro nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo:<br><br>1 - Ações - Vista<br>2 - Ações - Derivativos<br>3 - Renda fixa privada<br>4 - Agronegócio<br>5 - Financeiro<br>6 - Metais<br>7 - Energia elétrica<br>8 - Títulos públicos<br>9 - Câmbio<br><br>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSegmentCode no arquivo ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. |       |
| 1.4   |    | Market                                   | Mkt                 | [0..1] | ExternalMarketCode  | int  | A Market represents the Second level of market classification in the post trade  | Representa o segundo nível da classificação de mercado no  |       |



| INDEX | OR | Message Item | Tag           | Mult.  | Data Type               | Data Type Details                         | Description   | Descrição   | Regra |
|-------|----|--------------|---------------|--------|-------------------------|---|---|---|-------|
|       |    |              |               |        |                         |   | <p>process.<br/>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>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> |       |
| 1.5   |    | TickerSymbol | TckrSym<br>mb | [0..1] | TickerIdentifier        | string<br>maxLength = 35<br>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.<br>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   | Este atributo identifica a forma de liquidação do negócio.<br><br>Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a   |       |



Definição – Catálogo de Mensagens

Data: 28/08/2023

### *iMercado Pre-Matching*

| INDEX | OR | Message Item | Tag | Mult. | Data Type | Data Type Details | Description  | Descrição   | Regra |
|-------|----|--------------|-----|-------|-----------|-------------------|--|---|-------|
|       |    |              |     |       |           |                   | case the external file is in ExternalPaymentTypeCode ExternalCodeLists_iMERCADO.xls. | 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.

### 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<br>maxLength = 35<br>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. |       |
| 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<br>maxLength =                     | Identification of the confirmation transaction as known by the executing party.   | Identificação única da transação, conhecida pelo participante.  |       |



| INDEX     | OR  | Message Item                | Tag         | Mult.  | Data Type            | Data Type Details                          | Description   | Descrição   | Regra |
|-----------|-----|-----------------------------|-------------|--------|----------------------|--|---|---|-------|
|           |     |                             |             |        |                      | 35<br>minLength = 1                        |   |   |       |
| 2.1.2     | OR} | CommonIdentification        | CmonId      | [1..1] | Max35Text            | string<br>maxLength = 35<br>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              | MtchgSts    | [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 aceite.   | R1    |
| 3.1.1     |     | AdditionalReasonInformation | AddtIRsnInf | [0..1] | Max210Text           | string<br>maxLength = 210<br>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 | AddtIRsnInf | [0..1] | Max210Text           | string<br>maxLength = 210<br>minLength = 1 | Provides additional information about the unmatched reason.<br>Must be filled with the value expected by or the amount expected by the participant. | Este campo contém informações adicionais sobre o unmatched.<br>Deve ser preenchido com o valor esperado pelo participante ou a quantidade esperada pelo participante. |       |
| 3.2.2     | OR} | NoSpecifiedReason           | NoSpcdfRsn  | [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         | ConfPties   | [1..1] | +                    |  | Parties involved in the confirmation of the details of a trade.   | Partes envolvidas na confirmação dos detalhes de um negócio.  |       |
| 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.   |       |



| INDEX     | OR | Message Item              | Tag     | Mult.  | Data Type | Data Type Details                         | Description   | Descrição  | Regra |
|-----------|----|---------------------------|---------|--------|-----------|---|---|--|-------|
| 4.1.1.1   |    | ProprietaryIdentification | Prtryld | [1..1] | +         |   | Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.  | Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.  |       |
| 4.1.1.1.1 |    | Identification            | Id      | [1..1] | Max35Text | string<br>maxLength = 35<br>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> |       |
| 4.1.1.1.2 |    | Issuer                    | Issr    | [1..1] | Max35Text | string<br>maxLength = 35<br>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<br>maxLength = 35<br>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 |
|-----------|----|---------------------------|----------------|--------|-----------|--|--|---|-------|
| 4.2       |    | Investor                  | Invstr         | [0..1] | +         |  | Provides account identification.   | Fornece dados de identificação da conta.  |       |
| 4.2.1     |    | SafekeepingAccount        | SfkpgAccount   | [1..1] |           | Max35Text<br>string<br>maxLength = 35<br>minLength = 1 | Number account identification.<br>Unique identification for the account investors. e.g<br><br>115 = Account Number   | Número de identificação da conta.<br><br>Identificação única para a conta do investidor. Ex:<br><br>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<br>string<br>maxLength = 35<br>minLength = 1 | Unique and unambiguous identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.<br><br>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.<br><br>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. |       |
| 4.3.1.1.2 |    | Issuer                    | Issr           | [1..1] |           | Max35Text<br>string<br>maxLength =                     | Entity that assigns the identification.e.g iMercado. This field requires an external   | Entidade que emitiu a identificação.Ex: iMercado. Este  |       |



| INDEX     | OR | Message Item       | Tag         | Mult.  | Data Type | Data Type Details                         | Description   | Descrição  | Regra |
|-----------|----|--------------------|-------------|--------|-----------|---|---|--|-------|
|           |    |                    |             |        |           | 35<br>minLength = 1                       | 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   | 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<br>maxLength = 35<br>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 | SfkpgAct    | [1..1] | +         |   | This block identifies the custodian account.  | Este bloco identifica a conta.   |       |
| 4.3.2.1   |    | Identification     | Id          | [1..1] | Max35Text | string<br>maxLength = 35<br>minLength = 1 | Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g<br><br>115 = Account Number   | Número de identificação da conta.<br><br>Identificação única para a conta do investidor. Ex:<br><br>115 = Número da Conta  |       |
| 5.0       |    | 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   |       |



| INDEX | OR | Message Item | Tag      | Mult.  | Data Type  | Data Type Details                          | Description  | Descrição  | Regra |
|-------|----|--------------|----------|--------|------------|--|--|--|-------|
|       |    |              |          |        |            |  |  | necessários para o mercado brasileiro.   |       |
| 5.1   |    | PlaceAndName | PlcAndNm | [0..1] | Max350Text | string<br>maxLength = 350<br>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.<br><br>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.<br>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     |    | SecuritiesTradeInformation | SctiesTradInf | [1..1] | +                                 |   | Provides additional trade informations.  | Fornecer informações adicionais do negócio.  |       |
| 1.1     |    | PlaceAndName               | PlcAndNm      | [1..1] | Max350Text                        | string<br>maxLength = 350<br>minLength = 1        | Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance.<br>XPath to the element that is being extended<br>//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<br>//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.   |       |
| 1.2.1.1 |    | Amount                     | Amt           | [1..1] | ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount | decimal<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0 | 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 |
|---------|----|-----------------------|---------------|--------|-----------------------------------|---|---|--------------------------------------|-------|
|         |    |                       |               |        |                                   | totalDigits = 18  |   |                                      |       |
| 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<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0<br>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.                    |       |
| 1.2.3.1 |    | Amount                | Amt           | [1..1] | ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount | decimal<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0<br>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.             |       |
| 1.2.4.1 |    | Amount                | Amt           | [1..1] | ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount | decimal<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0<br>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 |
|---------|----|--------------------------|-----------------|--------|-----------------------------------|---|--|--------------------------------------|-------|
| 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 | LclTaxCtrySpfc1 | [0..1] | +                                 |   | Registration fee.                                  | Taxa de registro.                    |       |
| 1.2.5.1 |    | Amount                   | Amt             | [1..1] | ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount | decimal<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0<br>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 | LclTaxCtrySpfc2 | [0..1] | +                                 |   | Settlement fee.                                    | Taxa de liquidação.                  |       |
| 1.2.6.1 |    | Amount                   | Amt             | [1..1] | ActiveOrHistoricCurrencyAndAmount | decimal<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0<br>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<br>fractionDigits = 5<br>minInclusive = 0<br>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. |       |



## 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<br>maxLength = 35<br>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<br>maxLength = 35<br>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<br>maxLength = 350<br>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.<br><br>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<br>maxLength = 350<br>minLength = 1 | Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance.<br>XPath to the element that is being extended<br>//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<br>//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<br>maxLength = 35<br>minLength = 1  | Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.<br>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.<br>The identification of the party must be informed in the standard below:<br>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.<br><br>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.<br><br>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo:<br><br>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<br>maxLength = 35<br>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<br>maxLength = 35<br>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<br>maxLength = 35<br>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.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<br>maxLength = 35<br>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<br>maxLength = 35<br>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<br>NAFI: Rejection   | AFFI: Aceito<br>NAFI: Rejeitado   |       |
| 3.2   |     | AdditionalReasonInformation             | AddtReasonInf  | [0..1] | Max210Text        | string<br>maxLength = 210<br>minLength = 1 | Provides additional information about the reject reason.  | Informa o motivo da rejeição referente ao valor financeiro.   |       |