LEIAUTES DERIVATIVOS COM CCP

Versão: 09/10/2023
Atualização: 28/10/2024

CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÃO DE VERSÃO 3
2 REGISTRO DE CONTRATO DE SWAP COM CCP 4
3 REGISTRO DE CONTRATO DE OPÇÃO CCP 6
4 REGISTRO DE CONTRATO DE TERMO CCP 8
5 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE TERMO COM CCP 10
6 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE SWAP 11
7 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE OPÇÕES COM CCP 12
8 REGISTRO DE CONTRATO DE BROKER-CCP 14
9 CONCILIAÇÃO DE POSIÇÃO DERIVATIVOS G015_199 15
10 MOVIMENTAÇÃO DE DERIVATIVOS MOVBALCÃO 23
11 CONCILIAÇÃO DE POSIÇÃO DE DERIVATIVOS COM CCP – NEGBALCÃO 30
12 CONCILIAÇÃO DE TARIFAÇÃO 35
13 ARQUIVO DE TARIFAÇÃO TARBALCÃO 36
14 ARQUIVO DE CANCELAMENTO DE REGISTRO DE SCCP E TCCP 38
15 ARQUIVO DE CANCELAMENTO DE REGISTRO DE OPCCP 39
16 CESSÃO E TRANSFERÊNCIA CCP 40
17 CADASTRO DE INVESTIDOR CCP 42
18 DMOVTRANSF 48
19 TABELA 01 DE DOMÍNIO DERIVATIVOS (TXT). 49

1 ATUALIZAÇÃO DE VERSÃO

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
09/10/2023	28/10/2024	Investidor CCP	Ajuste do layout e reorganização da estrutura.
09/10/2023	09/10/2023	Registro de Opção com CCP	Inclusão do campo “Parâmetros em %”, conforme comunicado 041/2023-VPC
24/04/2023	05/10/2023	Registro de Opção com CCP	Inclusão do domínio 06-WMR X PTAX VENDA no campo “Boletim”.
24/04/2023	28/07/2023	DMOVTRANSF	Inclusão do layout referente ao arquivo DMOVTRANSF
24/04/2023	24/04/2023	Conciliação de Posição Derivativos G015_199	Inclusão da linha “Tipo 3” no arquivo “Conciliação de Posição Derivativos G015_199” para disponibilizar dados calculados pelo Risco, como o valor do Delta das Opções Flex Com CCP, conforme divulgado no comunicado 002/2023-VPC.
10/10/2022	11/04/2023	Antecipação com CCP	Atualização do nome dos campos: De “Parte Registradora” para “Titular” e “Contraparte Registradora” para “Lançador” Inclusão de informações nos campos de “Valor a antecipar” e “Percentual a antecipar” para realizar o *matching* das operações a mercado.
10/10/2022	14/03/2023	Antecipação de contrato de Opções com CCP	Mudança dos campos da coluna “Obrigatório” da “**Parte Registradora**” e “**Contraparte Registradora**” de “Sim” para “Não”
10/10/2022	14/03/2023	Antecipação de contrato de Opções com CCP	Mudança dos campos da coluna “Obrigatório” da “**Parte Registradora**” e “**Contraparte Registradora**” de “Sim” para “Não”
10/10/2022	17/11/2022	Movimentação de Derivativos MovBalcão	Inclusão de informações sobre quando o arquivo é gerado pelo sistema.
10/10/2022	10/10/2022	Arquivo de Cessão e Transferência CCP	Inclusão do layout novo do Arquivo de Cessão e Transferência CCP
13/12/2021	13/12/2021	Derivativos CCP – - Conciliação de Posição Derivativos G015_199 - Conciliação de Posição de Derivativos com CCP – Negbalcão - Movimentação de Derivativos Negbalcão	Ampliação do Código de Conta do Investidor na Plataforma Cadastro (SINCAD), conforme divulgado no comunicado 051/2021-VPC
26/07/2021	26/07/2021	Derivativos CCP - Registro de Contrato de Opção CCP	Inclusão do Tipo de Indicador – BDR para Opções Flex, conforme divulgado no comunicado 031/2021-VPC

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
28/09/2020	28/09/2020	Derivativos CCP - Conciliação de Posição Derivativos G015 199	Inclusão do campo Monitoramento de Barreira, conforme divulgado no comunicado 024/2020– VPC.
23/09/2019	10/10/2019	Layouts – Derivativos com CCP	Inclusão dos layouts de derivativos com CCP

Registro - Swap CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo: 285 Posições
2 REGISTRO DE CONTRATO DE SWAP COM CCP	
Descrição: Este arquivo permite ao participante realizar o registro do contrato de swap com CCP.	

Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	X(05)	1 - 5	Sim	SCCP
02	**ID Tipo de Linha**	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	**Código da Operação**	9(04)	7 -10	Sim	Código identificador da operação de Registro – 0001
04	**Participante que gerou o arquivo**	X(20)	11 - 30	Sim	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
05	**Data**	9(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD

Registro – Dados inicias

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	X(05)	1 - 5	Sim	SCCP
02	**ID Tipo de Linha**	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	**Código operação**	9(04)	7 - 10	Sim	Código identificador da operação Registro – 0001
04	**Meu Número**	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	**Parte Registradora**	9(08)	21 - 28	Sim	Código do registrador da parte
06	**Conta Parte**	9(08)	29 - 36	Sim	Código da parte na operação
07	**Codigo do PR**	9(10)	37 - 46	Sim	Código do Participante Registrador da Parte da operação
08	**Conta SINCAD Parte**	9(10)	47 - 56	Sim	Conta SINCAD da Parte
09	**Taxa Operacional Parte**	9(2)	57 - 58	Não	Percentual=00; Valor=01; vazio=02
10	**Valor - Taxa Operacional Parte**	9(13)v9(4)	59 - 75	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
11	**Garantia**	X(1)	76 - 76	Sim	S=Sem; C=Com
12	**Conta Repasse Parte**	X(8)	77 - 84	Não	Código da conta de Repasse da parte (se aplicável)
13	**Contraparte Registradora**	9(08)	85 - 92	Sim	Código do Registrador da contraparte
14	**Conta Contraparte**	9(08)	93 - 100	Não	Código da contraparte na operação
15	**Codigo do PR**	9(10)	101 - 110	Sim	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação
16	**Conta SINCAD ContraParte**	9(10)	111 - 120	Não	Conta SINCAD da Parte
17	**Taxa Operacional Contraparte**	9 (2)	121 - 122	Não	Percentual=00; Valor=01; vazio=02
18	**Valor - Taxa Operacional ContraParte**	9(13)v9(4)	123 - 139	Não	Valor da Taxa Operacional da Contraparte
19	**Garantia**	X(1)	140 - 140	Sim	S=Sem; C=Com
20	**Conta Repasse Contraparte**	X(8)	141 - 148	Não	Código da conta de Repasse da Contraparte (se aplicável)
21	**Data início**	9(08)	149 - 156	Sim	Data de início do contrato. Formato: AAAAMMDD
22	**Data vencimento**	9(08)	157 - 164	Sim	Data de vencimento do contrato. Formato: AAAAMMDD
23	**Valor base**	9(14)v9(02)	165 - 180	Sim	Valor base do contrato
24	**Nº de Controle do PR**	X(32)	181 - 212	Não	Nº de Controle do PR
25	**Percentual**	9(03)v9(02)	213 - 217	Sim	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato da Parte
26	**Curva**	X(03)	218 - 220	Sim	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos
27	**Sinal Taxa**	9(02)	221 - 222	Não	"+" ou "-" da Parte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
28	**Juros(%aa)**	9(03)v9(04)	223 - 229	Não	Taxa de juros atualizada da Parte
29	**Percentual**	9(03)v9(02)	230 - 234	Sim	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato da ContraParte
30	**Curva**	X(03))	235 - 237	Sim	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos
31	**Sinal Taxa**	9(02)	238 - 239	Não	"+" ou "-" da ContraParte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-")
32	**Juros(%aa)**	9(03)v9(04)	240 - 246	Não	Taxa de juros atualizada da ContraParte
33	**Cupom Limpo**	9(06)v9(07)	247 - 259	Não	Cotação Cupom Limpo Moeda Parte
34	**Data de Cotação**	9(02)	260 - 261	Não	Possíveis valores: **01** (D-1)

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
35	**Cupom Limpo**	9(06)v9(07)	262 - 274	Não	Cotação Cupom Limpo Moeda Contraparte
36	**Data de Cotação**	9(02)	275 - 276	Não	Possíveis valores: **01** (D-1)
37	**Trade**	9(09)	277 - 285	Não	Informação da Trade. Campo Usado para Usuário B3.

(fim)

Registro - Opção CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
3 REGISTRO DE CONTRATO DE OPÇÃO CCP	450 Posições
Descrição: Este arquivo permite ao participante realizar o registro do contrato de opção flexível com CCP.	

Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	X(05)	1 - 5	Sim	OCCP
02	**ID Tipo de Linha**	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	**Código da Operação**	9(04)	7 -10	Sim	Código identificador da operação de Registro – 0002
04	**Entidade que gerou o Arquivo**	X(20)	11 - 30	Sim	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
05	**Data**	9(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
06	**Filler**	X(10)	39-48	Sim	Reservado para futuras implementações

Registro

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	X(05)	1 - 5	Sim	OCCP
02	**ID Tipo de Linha**	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	**Código da Operação**	9(04)	7 - 10	Sim	0002
04	**Meu número**	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	**Parte Registradora**	9(08)	21 - 28	Sim	Código do registrador da parte
06	**Parte**	9(08)	29 - 36	Sim	Código da Instituição lançadora da operação
07	**Código do PR**	9(10)	37 - 46	Sim	Código do Participante Registrador da Parte da operação
08	**Conta SINCAD Parte**	9(10)	47 - 56	Sim	Conta no SINCAD da Parte
09	**Taxa Operacional Parte**	9(2)	57 - 58	Não	Domínio: Percentual=00 ; Valor=01
10	**Valor - Taxa Operacional Parte**	9(13)v9(4)	59 - 75	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
11	**Posição do Participante**	9(01)	76 - 76	Sim	Domínio: Posição do participante. 0 – Lançador; 1 – Titular

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
12	**Conta Repasse Parte**	9(08)	77 - 84	Não	Código da conta de Repasse da parte
13	**Contraparte Registradora**	9(08)	85 - 92	Sim	Código do registrador da contraparte.
14	**Contraparte**	9(8)	93 - 100	Comando simples - Sim Duplo Comando - Não	Código da contraparte na operação
15	**Codigo do PR**	9(10)	101 - 110	Sim	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação
16	**Conta SINCAD Contraparte**	9(10)	111 - 120	Comando simples - Sim Duplo Comando – Não	Conta no SINCAD da Contraparte
17	**Taxa Operacional Contraparte**	9(2)	121 - 122	Não	Percentual=00 ; Valor=01
18	**Valor - Taxa Operacional Contraparte**	9(13)v9(4)	123 - 139	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
19	**Conta Repasse Contraparte**	9(08)	140 - 147	Não	Código da conta de Repasse da Contraparte
20	**Data de Início**	9(08)	148 - 155	Sim	Data de início da Opção. Deve ser dia útil Formato: AAAAMMDD
21	**Data de Vencimento**	9(08)	156 - 163	Sim	Data do vencimento da opção. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Formato: AAAAMMDD
22	**Data de Liquidação**	9(08)	164 - 171	Sim	Data de Liquidação da opção. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Deve ser obrigatoriamente D+1 da “Data de Vencimento”. Formato: AAAAMMDD.
23	**Quantidade**	9(15)v9(2)	172 - 188	Sim	Quantidade base do contrato
24	**Nº de Controle do PR**	X(32)	189 - 220	Não	Número de Controle do PR
25	**Tipo Contrato**	X(06)	221 - 226	Sim	Domínio: COMPRA – Contrato de Opção de Call / VENDA – Contrato de Opção de Put
26	**Variável**	X(10)	227 - 236	Sim	Código de referência externa
27	**Tipo de Indicador**	9(02)	237 - 238	Sim	01 - ETF; 02 - ACOES; 03 - PARIDADE; 04 – INDICES; 05 – BDR
28	**Preço Exercício**	9(15),9(7)	239 - 260	Sim	Campo tipo numérico com 22 caracteres
29	**Data de Liquidação do Exercício**	9(01)	261 - 261	Sim	Domínio: **1 – “D+1”**
30	**Tipo Opção**	9(02)	262 - 263	Sim	Domínio: **01- Européia**
31	**Tipo Preço**	9(02)	264 - 265	Sim	Domínio: **01- Último; 02 – Médio**
32	**Nº Dias de Apuração**	9(04)	266 - 269	Sim	Númerico
33	**Data Fixing**	9(01)	270 - 270	Sim	Domínio: **0 – “D0”; 1 – “D-1”; 2 - "D-2"**

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
34	**Boletim**	9(02)	271 - 272	Sim	Domínio: **01 - PTAX Venda; 02 - Fechamento; 03 - Liquidação; 04 - 2005; 05 – 2009; 06-WMR X PTAX VENDA.**
35	**Proteção contra Proventos**	9(02)	273 - 274	Somente ação – Sim	Domínio: **01 – SIM**
36	**Limitador**	9(15),9(7)	275 - 296	Não	Campo Numérico
37	**Prêmio Unitário**	9(15),9(7)	297 - 318	Sim	Campo Numérico
38	**Data de Pagamento de Prêmio**	9(08)	319 - 326	Sim	Campo tipo data AAAAMMDD
39	**ID - Knock In and Down**	9(15)v9(7)	327 - 348	Não	Valor da barreira ID
40	**IU - Knock In and Up**	9(15)v9(7)	349 - 370	Não	Valor da barreira IU
41	**OD - Knock Out and Down**	9(15)v9(7)	371 - 392	Não	Valor da barreira OD
42	**OU - Knock Out and Up**	9(15)v9(7)	393 - 414	Não	Valor da barreira OU
43	**Tipo de Rebate**	9(02)	415 – 416	Não	Domínio: **01 – "Valor" 02 – "Percentual"**
44	**Monitoramento de Barreira**	X(01)	417 - 417	Não	**C – Contínuo; D – Discreto**
45	**Rebate Unitário**	9(15)v9(7)	418 - 439	Não	Valor do Rebate
46	**Data deLiquidação do Rebate**	9(02)	440 - 441	Não	Domínio: **01- D+1**
47	**Trade**	9(09)	442 - 450	Sim	Campo usado para usuário B3. Participante preencher com " " (espaço)
48	**Código Confirmação Lançamento Pendente**	X(15)	451-465	Não	Código de controle atribuído pelo participante
49	**Parâmetros em %**	X(01)	466-466	Sim	" " – Vazio; S – Sim

(fim)

Registro -Termo CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
4 REGISTRO DE CONTRATO DE TERMO CCP	251 Posições
Descrição: Este arquivo permite ao participante realizar o registro do contrato de termo com CCP.	

Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	X(05)	1 - 5	Sim	TCCP
02	**ID Tipo de Linha**	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	**Código da Operação**	9(04)	7 -10x'	Sim	Código identificador da operação de Registro – 0001
04	**Entidade que gerou o Arquivo**	X(20)	11 - 30	Não	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
05	**Data**	9(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

06	**Filler**	X(10)	39-41	Sim	00001 - Versão de Layout.

Registro

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	X(05)	1 - 5	Sim	TCCP
02	**ID Tipo de Linha**	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	**Código da Operação**	9(04)	7 - 10	Sim	0001
04	**Meu número**	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	**Parte Registradora**	9(08)	21 - 28	Sim	Código do registrador da parte
06	**Parte**	9(08)	29 - 36	Sim	Código da Instituição lançadora da operação
07	**Codigo do PR**	9(10)	37 - 46	Sim	Código do Participante Registrador da Parte da operação
08	**Conta SINCAD Parte**	9(10)	47 - 56	Sim	Conta no SINCAD da Parte
09	**Papel (Posição do participante)**	9(01)	57 - 57	Sim	Posição do participante: **0 – Comprador 1 – Vendedor**
10	**Taxa Operacional Parte**	X(1)	58 - 58	Não	Taxa Operacional: **V – Valor P – Percentual**
11	**Valor - Taxa Operacional Parte**	9(13)v9(4)	59 - 75	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
12	**Conta Repasse Parte**	9(08)	76 - 83	Não	Código do Vínculo de Repasse da Parte
13	**Contraparte Registradora**	9(08)	84 - 91	Sim	Código do registrador da contraparte
14	**Contraparte**	9(8)	92 - 99	Não	Código da contraparte na operação
15	**Codigo do PR**	9(10)	100 - 109	Sim	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação
16	**Conta SINCAD Contraparte**	9(10)	110 - 119	Não	Conta no SINCAD da Contraparte
17	**Taxa Operacional Contraparte**	X(1)	120 - 120	Não	Taxa Operacional: **V – Valor P – Percentual**
18	**Valor - Taxa Operacional Contraparte**	9(13)v9(4)	121 - 137	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
19	**Conta Repasse Contraparte**	9(08)	138 - 145	Não	Código do Vínculo de Repasse da Contraparte
20	**Data de Operação**	9(08)	146 - 153	Sim	Data em que o Participante contratou a operação. Pode ser informada com data do dia útil anterior à data do sistema, quando a contraparte na operação é um de seus clientes, tipo conta10. Formato: AAAAMMDD
21	**Data de Vencimento**	9(08)	154 - 161	Sim	Data útil da apuração do resultado. Livremente pactuada entre os Participantes. Formato: AAAAMMDD
22	**Valor Base**	9(14)V9(02)	162 - 177	Sim	Valor do contrato expresso em quantidade de moeda de referência. Preencher com ZEROS os espaços vazios.
23	**Nº de Controle do PR**	X(32)	178 - 209	Não	Número de Controle do PR
24	**Moeda de Referência**	9(03)	210 - 212	Sim	Código da moeda negociada pelos Participantes, utilizada para apuração de saldo do contrato. Consulte o arquivo público: Transf. Arquivo ->

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
					Arquivo -> Arquivos Públicos = IndexadoresCCP.txt
25	**Moeda Cotada**	9(03)	213 - 215	Sim	Código da moeda Cotada
26	**Taxa a Termo (R$/Moeda)**	9(10)V9(08)	216 - 233	Não	Valor da taxa de câmbio contratada entre comprador e vendedor. É utilizada na apuração do resultado.
27	**Fonte de Informação - Moeda Base**	9(02)	234 - 235	Sim	Indica a fonte a ser utilizada para cotação da moeda. **12 – BACEN**
28	**Boletim - Moeda Base**	9(01)	236 - 236	Sim	Boletim que será usado para cotação da moeda base. **3 - PTAX800** de Fechamento
29	**Fonte de Informação - Moeda Cotada**	9(02)	237 - 238	Não	Indica a fonte a ser utilizada para cotação da moeda cotada. **12 – BACEN**
30	**Boletim - Moeda Cotada**	9(01)	239 - 239	Não	Boletim que será usado para cotação da moeda cotada. **3 - PTAX800 de Fechamento**
31	**Tipo de Apuração**	X(01)	240 - 240	Sim	Tipo da Apuração. **U - ÚNICO**.
32	**Data Fixing**	9(01)	241 - 241	Sim	Data Fixing **1 – D-1**
33	**Data de Liquidação**	9(01)	242 - 242	Sim	Data de Liquidação **0 – D0**
34	**Trade**	9(09)	243 - 251	Não	Informação da Trade. Campo usado para usuário B3.

(fim)

Antecipação - Termo CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
5 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE TERMO COM CCP	124 Posições
Descrição: Arquivo a ser utilizado para registro de operação de antecipação de contratos de Termo com CCP.	

Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**Id do sistema**	X(05)	1 - 5	Sim	TCCP
02	**Id tipo linha**	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	**Código operação**	9(04)	7 -10	Sim	0014
04	**Participante**	X(20)	11 - 30	Sim	Nome Simplificado ou conta própria CCP do Participante que gerou o arquivo
05	**Data**	X(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
06	**Controle de Versão**	X(05)	39 - 43	Sim	00001

Registro – Dados Iniciais

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	X(5)	1 - 5	Sim	TCCP

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
02	**ID Tipo de Linha**	X(1)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	**Código operação**	X(4)	7 - 10	Sim	Código identificador da operação. **Operação 0014**
04	**Meu Número**	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	**Conta Registradora Comprador**	9(8)	21 - 28	Sim	Código do registrador do Comprador
06	**Conta Registradora Vendedor**	9(8)	29 - 36	Sim	Código do registrador do Vendedor
07	**Código do Contrato**	9(11)	37 - 47	Sim	Código identificador do instrumento financeiro a ser antecipado.
08	**Valor Base a Antecipar**	9(17)V9(02)	48 - 66	N	Valor a ser antecipado.
09	**Percentual a Antecipar**	9(3)V9(04)	67 - 73	N	Percentual a ser antecipado
10	**Taxa Operacional**	9(02)	74 - 75	**N**	**Percentual=00 ; Valor=01; vazio=02**
11	**Valor**	9(17)V9(04)	76 - 96	N	Valor da Taxa Operacional
12	**Data Antecipação**	9(08)	97 - 104	Sim	Data da antecipação do Contrato. Formato: AAAAMMDD
13	**Valor Financeiro a Antecipar (BR)**	9(17)V9(02)	105 - 123	Sim	Valor a ser antecipado em Reais.
14	**Visão Comprador**	X(1)	124 - 124	Sim	**D - Débito ; C – Crédito**

(fim)

Antecipação – SWAP com CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
6 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE SWAP	131 Posições
Descrição: Arquivo a ser utilizado para registro de operação de antecipação de contratos de Swap com CCP.	

Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**Id do sistema**	X(05)	1 - 5	Sim	SCCP
02	**Id tipo linha**	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	**Código operação**	9(04)	7 -10	Sim	0014
04	**Participante**	X(20)	11 - 30	Sim	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
05	**Data**	X(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

Registro – Dados Iniciais

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	X(5)	1 - 5	Sim	SCCP
02	**ID Tipo de Linha**	X(1)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	**Código operação**	X(4)	7 - 10	Sim	Código identificador da operação. Operação 0014
04	**Código do Contrato**	9(11)	11 - 21	Sim	Código identificador do instrumento financeiro a ser antecipado.
05	**Papel**	9(2)	22 - 23	Sim	Possíveis valores: 00 (Ponta 1) e 01 (Ponta 2)
06	**Meu Número**	9(10)	24 - 33	Sim	Código de controle atribuído pelo Participante
07	**Fator para Antecipação (Ponta1)**	9(10)V9(08)	34 - 51	Sim	Fator para Antecipação (Ponta 1)
08	**Fator para Antecipação (Ponta2)**	9(10)V9(08)	52 - 69	Sim	Fator para Antecipação (Ponta 2)
09	**Data Antecipação**	9(08)	70 - 77	Sim	Data da antecipação do Contrato. Formato: AAAAMMDD
10	**Valor Para Antecipação**	9(17)V9(02)	78 - 96	Não	Valor a ser antecipado.
11	**Percentual Antecipado**	9(4)V9(06)	97 - 106	Não	Percentual a ser antecipado
12	**Taxa Operacional**	9(02)	107 - 108	Não	Percentual=00 ; Valor=01
13	**Valor**	9(17)V9(04)	109 - 129	Não	Valor da Taxa Operacional
14	**Filler**	X(2)	130 - 131	Não	Filler

(fim)

Antecipação - Opções com CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
7 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE OPÇÕES COM CCP	127 Posições
Descrição: Arquivo a ser utilizado para registro de operação de antecipação de contratos de Opções com CCP.	

Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**Id do sistema**	X(05)	1 - 5	Sim	OPCCP
02	**Id tipo linha**	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	**Código operação**	9(04)	7 -10	Sim	Código da operação: 0036 - Antecipação
04	**Participante**	X(20)	11 - 30	Sim	Nome Simplificado ou conta própria CCP do Participante de Registro
05	**Data**	9(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
06	**Filler**	X(10)	39-48	Sim	Reservado para futuras implementações

Registro – Dados Iniciais

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**Id do sistema**	X(5)	1 - 5	Sim	OPCCP
02	**Id tipo linha**	X(1)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	**Código operação**	X(4)	7 - 10	Sim	0036
04	**Meu Número**	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	**Titular**	9(08)	21 - 28	Não	Código da Conta do Titular
06	**Lançador**	9(08)	29 - 36	Não	Código da Conta do Lançador
07	**Contrato**	X (9)	37 - 45	Sim	Código do Contrato.
08	**Valor a Antecipar**	9(17)V9(02)	46 - 64	Sim, caso queira preencher Valor.	Valor base a Antecipar. Formato IIIIIIIIIIIIIIDD 17 inteiros e 2 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto) Deve ser utilizado o campo "Valor a antecipar" OU "Percentual a antecipar" para o lançamento da antecipação. Para contratos a mercado, é necessário que ambas as partes lancem como "Valor" ou "Percentual" para que ocorra o *matching* da operação.
09	**Percentual a Antecipar**	9(04)V9(06)	65 - 74	Sim, caso queira preencher %	Percentual do Valor base a Antecipar. Formato IIIIDDDDDD 4 inteiros e 6 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto) Deve ser utilizado o campo "Valor a antecipar" OU "Percentual a antecipar" para o lançamento da antecipação. Para contratos a mercado, é necessário que ambas as partes lancem como "Valor" ou "Percentual" para que ocorra o *matching* da operação.
10	**Taxa Operacional Parte**	9(2)	75 - 76	Não	Percentual=00 ; Valor=01; vazio=02
11	**Valor - Taxa Operacional**	9(17)v9(4)	77 - 97	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
12	**Data da antecipação**	X(8)	98 - 105	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
13	**Prêmio Unitário**	9(15)V9(07)	106 - 127	Sim	Valor Financeiro da operação. Formato IIIIIIIIIIIIIIDD 15 inteiros e 7 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)

Footer

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	X(05)	1 - 5	Sim	OPCCP
02	**ID Tipo de Linha**	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Footer = 9
03	**Quantidade de Registros**	9(10)	7 - 16	Sim	
04	**Filler**			Sim	Reservado para futuras implementações

(fim)

BROKER - SWAP com CCP

Nome do Arquivo
8 REGISTRO DE CONTRATO DE BROKER-CCP
Descrição: Esse arquivo possibilita a Inclusão de contratos de Broker para SWAP com CCP.

Header

Seq	Campo	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	Sim	SCCP 00643
02	**Separador**	Sim	Ponto e vírgula (;)
03	**Tipo Linha**	Sim	0
04	**Separador**	Sim	Ponto e vírgula (;)
05	**Código do PR**	Sim	Código do PR
06	**Separador**	Sim	Ponto e vírgula (;)
07	**Participante que gerou o arquivo**	Sim	Código da Conta NoMe (formatada)
08	**Separador**	Sim	Ponto e vírgula (;)
09	**Conta Sincad**	Sim	Conta sincad do participante que gerou o arquivo
10	**Separador**	Sim	Ponto e vírgula (;)
11	**Data**	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

Dados Iniciais

Seq	Campo	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	Sim	SCCP 00643
02	**Separador**	Sim	Ponto e vírgula (;)
03	**Tipo Linha**	Sim	1
04	**Separador**	Sim	Ponto e vírgula (;)
05	**Meu Número**	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
06	**Separador**	Sim	Ponto e vírgula (;)
07	**Quantidade de Contratos**	Sim	Quantidade de Contratos

Contratos

Seq	Campo	Obrigatório	Conteúdo
01	**ID do Sistema**	Sim	SCCP 00643
02	**Separador**	Sim	Ponto e vírgula (;)
03	**Tipo Linha**	Sim	2
04	**Separador**	Sim	Ponto e vírgula (;)

05	**Código do Contrato**	Sim	Código do Contrato (um contrato por linha informada no campo "Quantidade de Contratos")

(fim)

Arquivo de conciliação - G015_199
Nome do Arquivo
9 CONCILIAÇÃO DE POSIÇÃO DERIVATIVOS G015_199
Descrição: Esse arquivo possibilita a conciliação de posição em aberto dos Derivativos com CCP.

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio

Seq	Campos	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
01	**Identificação da transação**	N	15		1	15	Seqüência de ident. da transação
02	**Complemento da transação**	N	3		16	18	Seqüência de complementação
03	**Tipo de registro**	N	2		19	20	1 - Dados do negócio
04	**Situação do registro**	N	2		21	22	
05	**Membro de Compensação**	N	6		23	28	
06	**Código da Participante**	N	6		29	34	
07	**Código do cliente**	N	9		35	43	
08	**Número do contrato**	N	9		44	52	
09	**Código do contrato**	A	5		53	57	
10	**Tipo do contrato**	A	1		58	58	
11	**Data da operação**	N	8		59	66	AAAAMMDD
12	**Data-base**	N	8		67	74	AAAAMMDD
13	**Data de vencimento**	N	8		75	82	AAAAMMDD
14	**Código da variável**	A	15		83	97	
15	**Código do tipo da variável**	A	2		98	99	
16	**Código do período da variável**	A	4		100	103	
17	**Código da operação**	A	6		104	109	
18	**Indicador de garantia**	A	1		110	110	S (sem) C (com)
19	**Tipo da Taxa Operacional**	A	1		111	111	P (percentual) V (valor)

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
20	**Valor da Taxa Operacional**	N	17	4	112	128	
21	**Taxa Operacional calculada**	N	15	2	129	143	
22	**Valor dos emolumentos**	N	15	2	144	158	
23	**Valor do Fundo de Garantia**	N	15	2	159	173	
24	**Tamanho-base**	N	17	2	174	190	
25	**Fator de atualização total**	A	22		191	212	
26	**Fator de atualização do índice**	A	22		213	234	
27	**Fator de atualização dos juros**	A	22		235	256	
28	**Tamanho-base atual**	N	17	2	257	273	
29	**Sinal do diferencial das curvas/valor de liquidação**	A	1		274	274	+ / -
30	**Diferencial das curvas/valor de liquidação**	N	17	2	275	291	
31	**Percentual de liq. antec.**	N	10	7	292	301	
32	**Tipo da Taxa Operacional - liquidação**	A	1		302	302	P (percentual) V (valor)
33	**Valor da Taxa Operacional - liquidação**	N	17	4	303	319	
34	**Taxa Operacional calculada - liquidação**	N	15	2	320	334	
35	**Fator de atualização total por dias úteis**	A	22		335	356	
36	**Fator de atualização do índice por dias úteis**	A	22		357	378	
37	**Fator de atualização dos juros por dias úteis**	A	22		379	400	
38	**Tamanho-base atualizado por dias úteis**	N	17	2	401	417	
39	**Sinal diferencial curvas/valor liq. por dias úteis**	A	1		418	418	+ / -

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
40	**Diferencial curvas/valor liquidação por dias úteis**	N	17	2	419	435	
41	**Sinal dos juros**	A	1		436	436	+ / -
42	**Juros**	N	13	7	437	449	
43	**Percentual da taxa da variável**	N	11	7	450	460	
44	**Período da taxa da variável**	A	1		461	461	D (diário) P (período)
45	**Período do limite de variação**	A	1		462	462	D (diário) P (período)
46	**Limite de variação inferior**	N	13	7	463	475	
47	**Limite de variação superior**	N	13	7	476	488	
48	**Número do negócio em pregão**	N	7		489	495	
49	**Data início de valorização - contrato de carteira**	N	8		496	503	AAAAMMDD
50	**Data fim de valorização - contrato de carteira**	N	8		504	511	AAAAMMDD
51	**Indicador de carteira de ações**	A	1		512	512	S (sim)
52	**Tipo da liquidação programada**	A	1		513	513	1, 2, 3, 4 ou 5
53	**Indicador de data automática da programada**	A	1		514	514	S (sim)
54	**Percentual do limite de liquidação programada 4**	N	10	7	515	524	
55	**Variável de desistência**	A	5		525	529	
56	**Valor-base ajustado**	N	17	2	530	546	
57	**Data-base ajustada**	N	8		547	554	AAAAMMDD
58	**Fator de atualização ajustado**	A	22		555	576	
59	**Valor atual ajustado**	N	17	2	577	593	

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
60	**Sinal do valor de liquidação ajustado**	A	1		594	594	+ / -
61	**Valor de liquidação ajustado**	N	17	2	595	611	
62	**Numero do broker**	N	9		612	620	
63	**Data do broker**	N	8		621	628	AAAAMMDD
64	**Sinal da cotação da variável**	A	1		629	629	+ / -
65	**Cotação da variável**	N	3		630	632	0 / 1
66	**Preço de exercício (*)**	N	22	7	633	654	
67	**Tipo da operação (*)**	A	1		655	655	C (compra) V (venda)
68	**Prêmio (*)**	N	22	7	656	677	
69	**Data de pagamento do prêmio (*)**	N	8		678	685	AAAAMMDD
70	**Tipo da opção (*)**	A	1		686	686	A (americana) E (européia)
71	**Tipo de exercício (*)**	A	1		687	687	A (autom.) S (solicit.comprador)
72	**Liquidação de exercício em D+0 (*)**	A	1		688	688	S (D+0) N (D+1)
73	**Tipo de rebate (*)**	A	1		689	689	V (valor) P (percentual)
74	**Valor do rebate (*)**	N	22	7	690	711	
75	**Rebate em D+0 (*)**	A	1		712	712	S (D+0) N (D+1)
76	**Sinal do valor de liquidação do rebate (*)**	A	1		713	713	+ / -
77	**Valor de liquidação do rebate (*)**	N	17	2	714	730	
78	**Valor da taxa de registro**	N	17	2	731	747	
79	**Desconto do Sócio Efetivo sobre taxa de registro**	N	17	2	748	764	

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
80	**Desconto do Sócio Efetivo sobre Taxa Operac. Básica**	N	17	2	765	781	
81	**Valor da Taxa Operacional Básica**	N	17	2	782	798	
82	**Valor da cotação**	N	13	7	799	811	
83	**Indicador de barreiras (*)**	N	1		812	812	1 (possui barreira) 0 (não)
84	**Dados da contraparte**						
85	**Sinal da cotação da variável**	A	1		813	813	+ / -
86	**Cotação da variável cp**	N	3		814	816	0 / 1
87	**Código da Participante**	N	6		817	822	
88	**Código do cliente**	N	9		823	831	
89	**Código da variável**	A	15		832	846	
90	**Código do tipo da variável**	A	2		847	848	
91	**Código do período**	A	4		849	852	
92	**Indicador de garantia**	A	1		853	853	S (sem) C (com)
93	**Sinal dos juros**	A	1		854	854	+ / -
94	**Juros**	N	13	7	855	867	
95	**Percentual da taxa da variável**	N	11	7	868	878	
96	**Período da taxa da variável**	A	1		879	879	D (diário P (período)
97	**Nome do cliente**	A	60		880	939	
98	**Tamanho-base atual**	N	17	2	940	956	
99	**Data início de valorização**	N	8		957	964	AAAAMMDD
100	**Data fim de valorização**	N	8		965	972	AAAAMMDD

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
101	**Indicador de carteira de ações**	A	1		973	973	S(sim)
102	**Fator de atualização total por dias úteis**	A	22		974	995	
103	**Fator de atualização do índice por dias úteis**	A	22		996	1017	
104	**Fator de atualização dos juros por dias úteis**	A	22		1018	1039	
105	**Tamanho-base atualizado por dias úteis**	N	17	2	1040	1056	
106	**Sinal diferencial curvas/valor liq. por dias úteis**	A	1		1057	1057	+ / -
107	**Diferencial curvas/valor Liqui. por dias úteis**	N	17	2	1058	1074	
108	**Valor da cotação**	N	13	7	1075	1087	
109	**Dados complementares**						
110	**Tipo de preço de exercício de liquidação (*)**	A	1		1088	1088	
111	**Numero de dias de apuração de preço (*)**	N	7		1089	1095	
112	**Indicador de bloqueio de exercício (*)**	A	1		1096	1096	S (exercício bloqueado)
Registro Tipo 02 - Dados da Barreira							
113	**Identificação da transação**	N	15		1	15	Seqüência de ident. da transação
114	**Complemento da transação**	N	3		16	18	Seqüência de complementação
115	**Tipo de Registro**	N	2		19	20	2 - Dados da Barreira
116	**Número do Contrato**	N	9		21	29	
117	**Código da Barreira**	A	5		30	34	
118	**Preço da Barreira**	N	22	7	35	56	
121	**Data de Acionamento da Barreira**	N	8		57	64	AAAAMMDD

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
122	**Monitoramento de Barreira**	A	1		65	65	Se aplica para Barreiras KI (IO,IU) e KO (OD,OU) D – Discreta C – Contínua

Seq	Campos	Formato	Tamanho	Decinal	Início	Fim	Observação
123	**Periodicidade de verificação das barreiras**	A	1		66	66	Opções: E - Européia; A-Americana
124	**Data início de verificação das barreiras**	A	8		67	74	Formato: AAAAMMDD
125	**Data fim de verificação das barreiras**	A	8		75	82	Formato: AAAAMMDD

(continua)

Registro Tipo 03 - Dados do Risco							
Seq	**Campos**	**Formato**	**Tamanho**	**Decinal**	**Início**	**Fim**	**Observação**
126	Identificação da transação	N	15		1	15	Sequência do código identificador da transação
127	Complemento da transação	N	3		16	18	Sequência do código complementação
128	Tipo de Registro	N	2		19	20	Identifica o tipo de linha. Conteúdo: “3” = Dados do Risco
129	Número do Contrato	N	9		21	29	Código do contrato
130	Delta	N	14	7	30	43	Valor do Delta do contrato, calculado pelo MINICORE. Disponível apenas para contratos de Opções Flex Com CCP.

131	MtM	N	22	7	44	65	Campo reservado para implementação futura do valor do MtM do contrato. Será populado como “0” para todos os contratos (Termo, Swap e Opções Com CCP)

(fim)

Arquivo de conciliação de movimentação - Movbalcão
Nome do Arquivo
10 MOVIMENTAÇÃO DE DERIVATIVOS MOVBALCÃO
Descrição: Esse arquivo possibilita a conciliação da movimentação de Derivativos com CCP. Este arquivo é gerado somente quando ocorre operação de Anulação de Antecipação, Anulação de Registro, Exclusão, Antecipação, ou Transferência.

Registro Tipo 01 - Dados da Operação

Seq	Arquivo TXT POSICIONAL - MovBalcão	Formato	Tamanho	Decimal	Inicio	Fim	Observação
01	**Tipo de registro**	N	1		1	1	1 - Exclusão de Posição (Transferência Origem - com todos os dados de negócio) 2 - Recebimento de Posição (Transferência: Destino - com todos os dados de negócio) 7 - Atualização de Eventos Corporativos (Ações - Importação de novo Registro com todos os dados de negócios)
02	**Membro de Compensação**	N	6		2	7	
03	**Código da Corretora**	N	6		8	13	
04	**Código do cliente**	N	9		14	22	
05	**Número do contrato**	N	9		23	31	
06	**Código do contrato**	A	5		32	36	
07	**Tipo do contrato**	A	1		37	37	1 - SWAP 2 - OPÇÃO COMPRA 3 - OPÇÃO VENDA 4 - TERMO
08	**Data da operação**	N	8		38	45	AAAAMMDD
09	**Data-base**	N	8		46	53	AAAAMMDD
10	**Data de vencimento**	N	8		54	61	AAAAMMDD
11	**Código da variável**	A	15		62	76	
12	**Código opção da variável**	A	2		77	78	

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
13	**Código do período da variável**	A	4		79	82	
14	**Tamanho-base**	N	17	2	83	99	
15	**Tamanho-base atualizado**	N	17	2	100	116	
16	**Fator de atualização**	A	22		117	138	
17	**Fator de atual. - índice**	A	22		139	160	
18	**Fator de atual. - juros**	A	22		161	182	
19	**Valor de liquidação**	N	17	2	183	199	
20	**Sinal do valor de liquidação**	A	1		200	200	
21	**Prêmio (*)**	N	22		201	222	
22	**Preço de exercício**	N	22	7	223	244	
23	**Código da operação**	A	6		245	250	
24	**Sinal dos juros**	A	1		251	251	+ / -
25	**Juros**	N	13	7	252	264	
26	**Percentual da taxa da variável**	N	11	7	265	275	
27	**Período da taxa da variável**	A	1		276	276	
28	**Indicador de garantia**	A	1		277	277	S (sem) C (com)
29	**Tipo da operação**	A	1		278	278	C (compra) V (venda)
30	**Tipo da Taxa Operacional**	A	1		279	279	P (percentual) V (valor)
31	**Valor da Taxa Operacional**	N	17	4	280	296	

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
32	**Data de pagamento do prêmio**	N	8		297	304	AAAAMMDD
33	**Tipo da opção**	A	1		305	305	A (americana) E (européia)
34	**Limite da variação inferior**	N	13	7	306	318	
35	**Limite da variação superior**	N	13	7	319	331	
36	**Número do negócio em pregão**	N	7		332	338	
37	**Liquidação de exercício**	A	1		339	339	S (liquid. D+0) N (liquid. D+1)
38	**Tipo de exercício**	A	1		340	340	A (autom.)/S (solicit.comprador)
39	**Tamanho-base atualizado du**	N	17	2	341	357	
40	**Fator de atualização du (dias úteis)**	A	22		358	379	
41	**Fator de atual. - índice du (dias úteis)**	A	22		380	401	
42	**Fator de atual. - juros du (dias úteis)**	A	22		402	423	
43	**Valor de liquidação du (dias úteis)**	N	17	2	424	440	
44	**Sinal do valor de liquidação du (dias úteis)**	A	1		441	441	
45	**Tipo de rebate**	A	1		442	442	V (valor)/P (percentual)
46	**Valor do rebate (*)**	N	22	7	443	464	

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
47	**Rebate em D+0**	A	1		465	465	S (D+0)/N (D+1)
48	**Sinal da cotação da variável**	A	1		466	466	+ / -
49	**Cotação da variável**	N	3		467	469	0 / 1
50	**Tipo da liquidação progr.**	A	1		470	470	1, 2, 3 ou 4
51	**Percentual do limite de liquidação programada 4**	N	10	7	471	480	
52	**Variável de desistência**	A	5		481	485	
53	**Data início da valorização**	N	8		486	493	AAAAMMDD
54	**Data fim da valorização**	N	8		494	501	AAAAMMDD
55	**Numero do broker**	N	9		502	510	
56	**Data do broker**	N	8		511	518	AAAAMMDD
57	**Valor da cotação**	N	13	7	519	531	
58	**Dados da contraparte**						
59	**Sinal da cotação da variável**	A	1		532	532	+ / -
60	**Cotação da variável**	N	3		533	535	0 / 1
61	**Código da Corretora**	N	6		536	541	
62	**Código da variável**	A	5		542	556	
63	**Código opção da variável**	A	2		557	558	Tabela 2.

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
64	**Código do período da variável**	A	4		559	562	
65	**Indicador de garantia**	A	1		563	563	S (sem) C (com)
66	**Sinal dos juros**	A	1		564	564	+ / -
67	**Juros**	N	13	7	565	577	
68	**Percentual da taxa da variável**	N	11	7	578	588	
69	**Período da taxa da variável**	A	1		589	589	
70	**Limite da variação inferior**	N	13	7	590	602	
71	**Limite da variação superior**	N	13	7	603	615	
72	**Nome do cliente contraparte**	A	60		616	675	
73	**Data início da valorização**	N	8		676	683	AAAAMMDD Data Início Contrato
74	**Data fim da valorização**	N	8		684	691	AAAAMMDD Data Vencimento
75	**Tamanho-base atualizado cp**	N	17	2	692	708	
76	**Fator de atualização cp**	A	22		709	730	
77	**Fator de atual. - índice cp**	A	22		731	752	
78	**Fator de atual. - juros cp**	A	22		753	774	
79	**Valor de liquidação cp**	N	17	2	775	791	

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
80	**Sinal do valor de liquidação cp**	A	1		792	792	
81	**Valor-base atual du cp (dias úteis)**	N	17	2	793	809	
82	**Fator de atualização du cp (dias úteis)**	A	22		810	831	
83	**Fator de atual. - índice du cp (dias úteis)**	A	22		832	853	
84	**Fator de atual. - juros du cp (dias úteis)**	A	22		854	875	
85	**Valor de liquidação du cp (dias úteis)**	N	17	2	876	892	
86	**Sinal do valor de liquidação du cp (dias úteis)**	A	1		893	893	+ / -
87	**Valor da cotação cp**	N	13	7	894	906	
88	**Dados complementares**						
89	**Tipo de preço de exercício de liquidação**	A	1		907	907	
90	**Numero de dias de apuração de preço**	N	7		908	914	
91	**Indicador de bloqueio de exercício**	A	1		915	915	S (exercício bloqueado)

Registro Tipo 03 - Dados da Barreira							
Seq	**Campo**	**Formato**	**Tamanho**	**Decimal**	**Início**	**Fim**	**Observação**

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
92	**Tipo de Registro**	N	1		1	1	3 - Dados da Barreira
93	**Número do Contrato**	N	9		2	10	
94	**Código da Barreira**	A	5		11	15	
95	**Preço da Barreira**	N	22	7	16	37	

Registro Tipo 04 - Liquidação Antecipada							
Seq	**Campo**	**Formato**	**Tamanho**	**Decimal**	**Início**	**Fim**	**Observação**
96	**Tipo de Registro**	N	1		1	1	4 - Liquidação Antecipada
97	**Número do Contrato**	N	9		2	10	
98	**Código da Corretora**	N	6		11	16	
99	**Código do cliente Parte**	N	9		17	25	
100	**Tamanho-base**	N	17	2	26	42	
101	**Tamanho-base de Liquidação**	N	17	2	43	59	
102	**Prêmio Unitário de Liquidação**	N	22		60	81	
103	**Tipo da Tx Operacional de Liq. Antecipada**	A	1		82	82	P (percentual)/V (valor)
104	**Valor da Tx Operacional de Liq. Antecipada**	N	17		83	99	4 decimais para Percentual e 2 decimais para valor
105	**Numero do broker**	N	9		100	108	
106	**Sinal do valor de liquidação**	A	1		109	109	+ ou -
107	**Valor de Liquidação Finceira**	N	17	2	110	126	

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
110	**Data de Operação**	N	8		127	134	AAAAMMDD

Registro Tipo 05 - Anulação de Registro/ Anulação de Liq. Antecipada (D+0)							
Seq	**Campo**	**Formato**	**Tamanho**	**Decimal**	**Início**	**Fim**	**Observação**
111	**Tipo de Registro**	N	1		1	1	5 - anulação (intradiária)
112	**Número do Contrato**	N	9		2	10	
113	**Justificativa**	A	100		11	110	Justificativa informada pelo Participante.

Registro Tipo 06 - Cancelamento (D+n)							
Seq	**Campo**	**Formato**	**Tamanho**	**Decimal**	**Início**	**Fim**	**Observação**
114	**Tipo de Registro**	N	1		1	1	6 - anulação (intradiária)
115	**Número do Contrato**	N	9		2	10	
116	**Justificativa**	A	100		11	110	Justificativa informada pelo Participante.

(fim)

Conciliação de Posição – NegBalcão
Nome do Arquivo
11 CONCILIAÇÃO DE POSIÇÃO DE DERIVATIVOS COM CCP – NEGBALCÃO
Descrição: Esse arquivo possibilita a conciliação dos Derivativos com CCP (situação: “em aberto” ou “aprovados”)

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
Seq	**Campo**	**Formato**	**Tamanho**	**Decimal**	**Início**	**Fim**	**Observação**
01	**Identificação da transação**	N	15		1	15	Fixo: "1"- Dados do Negócio
02	**Tipo de registro**	N	2		16	17	
03	**Membro de Compensação**	N	6		18	23	
04	**Código da Corretora Parte**	N	6		24	29	

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
05	**Código do cliente Parte**	N	9		30	38	
06	**Número do contrato**	N	9		39	47	
07	**Código do contrato**	A	5		48	52	Tabela 1
08	**Tipo do contrato**	A	1		53	53	
09	**Data do Registro**	N	8		54	61	
10	**Data da operação**	N	8		62	69	
11	**Data base**	N	8		70	77	
12	**Data de vencimento**	N	8		78	85	
13	**Código da variável Parte**	A	15		86	100	
14	**Código opção da variável Parte**	A	2		101	102	
15	**Indicador de garantia**	A	1		103	103	
16	**Tipo da Taxa Operacional**	A	1		104	104	
17	**Valor da Taxa Operacional**	N	17	4	105	121	
18	**Taxa Operacional calculada**	N	15	2	122	136	
19	**Tamanho-base**	N	17	2	137	153	
20	**Fator de atualização**	A	22		154	175	
21	**Fator de atualização do índice**	A	22		176	197	
22	**Fator de atualização dos juros**	A	22		198	219	
23	**Tamanho-base atualizado**	N	17	2	220	236	
24	**Sinal do diferencial das curvas/valor de liquidação**	A	1		237	237	

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
25	**Diferencial das curvas/valor de liquidação**	N	17	2	238	254	
26	**Sinal dos juros**	A	1		255	255	
27	**Juros**	N	13	7	256	268	
28	**Percentual da taxa da variável**	N	11	7	269	279	
29	**Fixing Vencimento**	N	2		280	281	Tabela 1
30	**Tipo de Exercício**	A	1		282	282	
31	**Sinal**	A	1		283	283	*Válido somente para percentual (-) Menor que o spot (+) Maior que o spot
32	**Preço de exercício**	N	22	7	284	305	*Se percentual, informar em fator.
33	**Tipo da operação**	A	1		306	306	C (Compra) ou V (Venda)
34	**Sinal Pagamento Prêmio**	A	1		307	307	
35	**Prêmio**	N	22	7	308	329	
36	**Data de pagamento do prêmio**	N	8		330	337	
37	**Tipo da opção**	A	1		338	338	
38	**Liquidação de exercício D+0**	A	1		339	339	
39	**Tipo de rebate**	A	1		340	340	
40	**Valor do rebate**	N	22	7	341	362	
41	**Rebate em D+0**	A	1		363	363	
42	**Valor da cotação**	N	13	7	364	376	
43	**Numero do broker**	N	9		377	385	
44	**Data do broker**	N	8		386	393	
45	**Indicador de barreiras**	N	1		394	394	

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
46	**Código da Corretora Contraparte**	N	6		395	400	
47	**Código do cliente Contraparte**	N	9		401	409	
48	**Código da variável Contraparte**	A	15		410	424	
49	**Código do tipo da variável Contraparte**	A	2		425	426	
50	**Indicador de garantia**	A	1		427	427	
51	**Sinal dos juros**	A	1		428	428	
52	**Juros**	N	13	7	429	441	
53	**Percentual da taxa da variável**	N	11	7	442	452	
54	**Nome do cliente**	A	60		453	512	
55	**Tamanho-base atualizado**	N	17	2	513	529	
56	**Valor da cotação**	N	13	7	530	542	
57	**Tipo de preço de exercício de liquidação**	A	1		543	543	
58	**Número de dias de apuração de preço**	N	7		544	550	
59	**Tipo Mercadoria**	A	3		551	553	
60	**Unidade Negociação Mercadoria**	A	3		554	556	
61	**Mês Vencimento Mercadoria**	N	2		557	558	
62	**Ano Vencimento Mercadoria**	N	4		559	562	
63	**Valor do Limitador Inferior**	N	13	6	563	575	
64	**Valor do Limtador Superior**	N	13	6	576	588	
65	**Tipo Atualização**	A	1		589	589	

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
66	**Valor/Percentual de Atualização**	N	13	6	590	602	
67	**Fixing Início**	N	2		603	604	Tabela 1
68	**Tipo de Apuração**	A	1		605	605	U - ÚLTIMO A - Asiático
69	**Fonte Informação Variável Base**	A	5		606	610	
70	**Boletim Variável Base**	A	15		611	625	
71	**Câmbio Cruzado**	A	1		626	626	
72	**Fonte Informação Moeda Cotada**	A	5		627	631	
73	**Boletim Moeda Cotada**	A	15		632	646	
74	**Data De Liquidação**	N	1		647	647	0 - D+0 1 - D+1
75	**Indicação de Proventos**	**A**	1		648	648	S - Sim *Aplicável apenas para FCA e FPA

Registro Tipo 02 - Dados da Barreira							
Seq	**Campo**	**Formato**	**Tamanho**	**Decimal**	**Início**	**Fim**	**Observação**
76	**Identificação da Transação**	N	15		1	15	
77	**Tipo de Registro**	N	2		16	17	2 - Dados da Barreira
78	**Número do Contrato**	N	9		18	26	
79	**Código da Barreira**	A	5		27	31	Tabela 1
80	**Tipo da Barreira**	A	1		32	32	V = Valor P = Percentual
81	**Sinal**	A	1		33	33	*Válido somente para percetual (-) Menor que o spot (+) Maior que o spot
82	**Preço da Barreira**	N	22	7	34	55	*Se percentual, informar em fator.
83	**Monitoramento de Barreira**	A	1		56	56	Para discreta = “D”; Para Continua = “C”

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
							*Somente Barreiras KI(IO,IU) e KO(OD,OU) possuem este atributo.
84	**Periodicidade de verificação das barreiras**	A	1		57	57	E - Européia; A- Americana Até nova comunicação, este campo não terá conteúdo
85	**Data início de verificação das barreiras**	A	8		58	65	Formato: AAAAMMDD Até nova comunicação, este campo não terá conteúdo
86	**Data fim de verificação das barreiras**	A	8		66	73	Formato: AAAAMMDD Até nova comunicação, este campo não terá conteúdo

Registro Tipo 03 - Dados Média Asiática							
Seq	**Campo**	**Formato**	**Tamanho**	**Decimal**	**Início**	**Fim**	**Observação**
87	**Identificação da transação**	N	6		1	6	
88	**Tipo de registro**	N	2		7	8	3 - Dados Média Asiática
89	**Número do contrato**	N	9		9	17	
90	**Data Início Apuração**	N	8		18	25	
91	**Data Fim Apuração**	N	8		26	33	
92	**Data Discreta**	N	8		34	41	
93	**Peso Data Discreta**	N	7	4	42	48	

(fim)

Arquivo de Tarifação – TarAnalitico
Nome do Arquivo
12 CONCILIAÇÃO DE TARIFAÇÃO
Descrição: Esse arquivo demonstra o detalhamento analítico da Tarifação aplicada, no D+1 da data referência da operação.

Seq	Campo	Formato	Conteúdo	Conteúdo
01	**Nº Operação**	X	Número da Operação Ibalcão	
02	**Conta Cliente**	N	Conta do Cliente	
03	**CPF/CNPJ**		CPF/CNPJ	
04	**Produto**	X	82 = Termo 83 = Swap 84 = Opções	

Seq	Campo	Formato	Conteúdo	Conteúdo
05	**Contrato**	X	0 - Sem 1 - Com	
06	**Funcionalidade**	X	Bullet	
07	**Brokeragem**	N	8 inteiros e 2 decimais	
08	**Garantia**	X	0 - Sem 1 - Com	
09	**Nome da tarifa**	X	Taxa de Registro Taxa de Permanência Taxa de Liquidação Antecipada Taxa de Cancelamento D+1 a D+3 Taxa de Cancelamento D+4 a V-1 Taxa de Correção D+0 Taxa de Correção D+1 a D+3 Taxa de Correção D+4 a V-1 Taxa de Transferência - Origem Taxa de Cessão de Direito - Cedente Taxa de Cessão de Direito - Cessionário Taxa de Transferência - Destino	
10	**Valor Aplicado em BRL**	N	Valor Base para Cobrança	
11	**Valor Cobrado**	N	Valor cobrado	

(fim)

Arquivo de Tarifação - TarBalcão
Nome do Arquivo
13 ARQUIVO DE TARIFAÇÃO TARBALCÃO
Descrição: Esse arquivo demonstra os valores de cobranças das tarifas referentes aos Derivativos com CCP.

Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Inicio	Fim	Observação
01	**Data do Pregão**	N	8		1	8	Aaaammdd
02	**Código da Mercadoria**	A	5		9	13	
03	**Funcionalidade**	X	10		14	23	
04	**Tipo de Mercado**	N	1		24	24	1= Swap 2= Opção de Call; 3= Opção de Put; 4= Termo;
05	**Taxa de Registro Com Garantia (Percentual)**	N	10	7	25	34	
06	**Taxa de Registro Sem Garantia (Percentual)**	N	10	7	35	44	
07	**CAP Taxa de Registro Com Garantia**	N	10	02	45	54	
08	**CAP Taxa de Registro Sem Garantia**	N	10	2	55	64	
09	**FLOOR Taxa de Registro Com Garantia**	N	10	2	65	74	

Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Inicio	Fim	Observação
10	**FLOOR Taxa de Registro Sem Garantia**	N	10	2	75	84	
11	**Taxa de Liquidação Antecipada COM Garantia**	N	10	2	85	94	
12	**Taxa de Liquidação Antecipada SEM Garantia**	N	10	7	95	104	
13	**Taxa de Permanência COM Garantia (Percentual)**	N	10	7	105	114	
14	**Taxa de Permanência SEM Garantia (Percentual)**	N	10	7	115	124	
15	**CAP Taxa de Permanência Com Garantia**	N	10	2	125	134	
16	**CAP Taxa de Permanência Sem Garantia**	N	10	2	135	144	
17	**FLOOR Taxa de Permanência Com Garantia**	N	10	2	145	154	
18	**FLOOR Taxa de Permanência Sem Garantia**	N	10	2	155	164	
19	**Taxa de Transferência de Titularidade - Cedente**	N	10	2	165	174	
20	**Taxa de Transferência de Titularidade Cessionário Com Garantia (Percentual)**	N	10	7	175	184	
21	**Taxa de Transferência de Titularidade Cessionário Sem Garantia (Percentual)**	N	10	7	185	194	
22	**Desconto Registro Brokerage (Percentual)**	N	10	7	195	204	
23	**Desconto Permanência Brokerage (Percentual)**	N	10	7	205	214	
24	**Taxa de Correção D1 a D3 (Percentual)**	N	10	7	215	224	
25	**Taxa de Cancelamento entre D1 a D3**	N	10	2	225	234	
26	**Taxa de Correção D+3**	N	10	2	235	244	
27	**Taxa de Cancelamento D+3**	N	10	2	245	254	

Arquivo de Cancelamento de Registro de SCCP e TCCP
Nome do Arquivo
14 ARQUIVO DE CANCELAMENTO DE REGISTRO DE SCCP E TCCP
Descrição: Esse Arquivo será utilizado para realizar o cancelamento de registro de Swap e Termo CCP

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
1	**Id do sistema**	X(05)	1–5	CCP
2	**Id tipo linha**	9(01)	6–6	Linha de Header = 0
3	**Código operação**	X(04)	7–10	Código da operação: 0101 – Cancelamento de Registro
4	**Nome Simplificado do Participante**	X(20)	11–30	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
5	**Data**	9(08)	31–38	Ano, mês e dia da Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
6	**Versão do Layout**	9(05)	39–43	00001

Registro – Dados Iniciais

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
1	**Id do Sistema**	X(05)	1–5	CCP
2	**Id tipo linha**	9(01)	6–6	Linha de Dados = 1
3	**Código operação**	X(04)	7–10	0101
4	**Meu Número**	9(10)	11 - 20	Código de controle atribuído pelo participante no momento de Registro. Obrigatório
5	**Código do Contrato IF**	9(11)	21-31	Código identificador do instrumento financeiro a ser cancelado. Obrigatório
6	**Código do PR (Parte)**	9(10)	32-41	Código do Participante Registrador da Parte da operação. Obrigatório
7	**Código do PR (Contraparte)**	9(10)	42-51	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação. Obrigatório

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
8	Data	9(08)	52-59	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

Arquivo de Cancelamento de Registro de OPCCP
Nome do Arquivo
15 ARQUIVO DE CANCELAMENTO DE REGISTRO DE OPCCP
Descrição: Esse Arquivo será utilizado para realizar o cancelamento de registro de Opções CCP

Header (Registro):

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
1	**Id do sistema**	X(05)	1–5	OPCCP
2	**Id tipo linha**	9(01)	6–6	Linha de Header = 0
3	**Código operação**	X(04)	7–10	Código da operação: 0102 – Cancelamento de Registro
4	**Nome Simplificado do Participante**	X(20)	11–30	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
5	**Data**	9(08)	31–38	Ano, mês e dia da Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
6	**Versão do Layout**	9(05)	39–43	00001

Registro – Dados Iniciais:

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
1	**Id do sistema**	X(05)	1–5	OPCCP
2	**Id tipo linha**	9(01)	6–6	Linha de Dados = 1
3	**Código operação**	X(04)	7–10	0102
4	**Meu Número**	9(10)	11 - 20	Código de controle atribuído pelo participante no momento de Registro. Obrigatório
5		9(11)	21-31	Código identificador do instrumento financeiro a ser

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
	Código do Contrato			cancelado. Obrigatório
6	**Código do PR**	9(10)	32-41	Código do Participante Registrador da Parte da operação. Obrigatório
7	**Código do PR**	9(10)	42-51	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação. Obrigatório
8	**Data**	9(08)	52-59	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

Footer:

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
1	**Id do sistema**	X(05)	1–5	OPCCP
2	**Id tipo linha**	9(01)	6–6	Linha de Footer = 9
3	**Quantidade de Registros**	9(10)	7–16	Número total de linhas do arquivo.
4	**Filler**			Reservado para futuras implementações

(fim)

Arquivo de Cessão e Transferência CCP
Nome do Arquivo
16 CESSÃO E TRANSFERÊNCIA CCP
Descrição: Este arquivo permite ao Participante a cessão e a transferência de contratos CCP (Termo, Swap e Opção)

Header (Registro):

Seq.	Campo	Descrição
1	Id do sistema	CCP___0000
2	Separador	Ponto e vírgula (;)
3	**Id tipo linha**	Linha de Header = 0
4	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
5	**Data**	Ano, mês e dia da Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
6	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
7	**Versão do Layout**	0001

Registro – Dados Iniciais

Seq.	Campo	Descrição
1	**Id do sistema**	CCP___0000
2	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
3	**Id tipo linha**	Linha de Dados = 1
4	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
5	**Código operação**	0020 – Cessão 0642 – Transferência Obrigatório
6	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
7	**Código do Contrato**	Código identificador do instrumento financeiro. Obrigatório
8	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
9	**Meu Número**	Código de controle atribuído pelo participante. Obrigatório
10	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
11	**Conta Registradora Cedente**	Código B3 do Registrador cedente do contrato. Obrigatório
12	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
13	**Conta Cedente**	Código B3 do Participante cedente. Obrigatório
14	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
15	**Código PR Cedente**	Código do Participante Registrador do Cedente. Obrigatório
16	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
17	**Conta SINCAD Cedente**	Conta SINCAD do Cedente. Para Transferência entre Contas é obrigatório. Para Transferência entre Participantes ou Contas Registradoras distintas (mercado) não deve ser preenchido pelo Adquirente
18	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
19	**Conta Registradora Adquirente**	Código B3 do Registrador adquirente do contrato. Obrigatório
20	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
21	**Conta Adquirente**	Código B3 do Participante adquirente. Obrigatório
22	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
23	**Código PR Adquirente**	Código do Participante Registrador do Adquirente. Obrigatório
24	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
25	**Conta SINCAD Adquirente**	Conta SINCAD do Adquirente. Para Transferência entre Contas é obrigatório. Para Transferência entre Participantes ou Contas Registradoras distintas (mercado) não deve ser preenchido pelo Cedente
26	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
27	**Valor do Prêmio**	Valor do Prêmio da operação. Obrigatório para Cessão. Preencher o valor com duas casas decimais
28	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
29	**Controle B3**	Campo reservado para uso da B3.

Seq.	Campo	Descrição
		Não deve ser preenchido
30	**Separador**	Ponto e vírgula (;)
31	**Titular do Prêmio**	C – Cedente A – Adquirente

Arquivo de Cadastramento
Nome do Arquivo
17 CADASTRO DE INVESTIDOR CCP
Descrição: Este layout permite que os participantes cadastrem Investidores CCP. Obs.: Todos os campos são de preenchimento obrigatório.

Header		
Seq	**Campo**	**Descrição/conteúdo**
01	SAP	“SAP” seguido de 2 espaços
02	Separador	Ponto e vírgula (;)
03	ICCP	ICCP

Registro		
Seq	**Campo**	**Descrição/conteúdo**
01	Identificador	INCL
02	Separador	Ponto e vírgula (;)
03	Razão Social	Razão Social do Investidor CCP
04	Separador	Ponto e vírgula (;)
05	CNPJ	CNPJ do Investidor CCP (sem pontuação)
06	Separador	Ponto e vírgula (;)
07	Id da Natureza Econômica	Id da Natureza Econômica (lista abaixo)
08	Separador	Ponto e vírgula (;)
09	Id da Natureza Jurídica	Id da Natureza Jurídica (lista abaixo)
10	Separador	Ponto e vírgula (;)
11	Nome da Família CCP	Nome da Família CCP
12	Separador	Ponto e vírgula (;)
13	CNPJ do Titular da Família	CNPJ do Titular da Família (sem pontuação)

NATUREZAS JURIDICAS

1	SOCIEDADE CIVIL
2	SOCIEDADE COMERCIAL
3	SOCIEDADE EM NOME COLETIVO N/C
4	FIRMA INDIVIDUAL
5	SOCIEDADE DE CAPITAL E INDUSTRIA C/I
6	SOCIEDADE EM CONTA DE PARTICIPACAO
7	SOCIEDADE COMANDITA SIMPLES
8	SOCIEDADE COMANDITA POR ACOES
9	SOCIEDADE POR COTAS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA
10	SOCIEDADE ANONIMA DE CAPITAL ABERTO
11	GRUPOS DE SOCIEDADES
12	SOCIEDADE COLIGADA
13	SOCIEDADE CONTROLADORA
14	SOCIEDADE COOPERATIVA
15	CONSORCIO
16	SUBSIDIARIA INTEGRAL
17	AUTARQUIA
18	SOCIEDADE DE ECONOMIA MISTA
19	FUNDACAO
20	EMPRESA PUBLICA
21	ORGAOS PUBLICOS
22	FUNDO ABERTO
23	FUNDO FECHADO
24	SOCIEDADE ANONIMA DE CAPITAL FECHADO
25	VARA
26	SEM PERSONALIDADE JURIDICA

NATUREZAS ECONOMICAS

169	PESSOA JURIDICA NAO FINANCEIRA
180	COOPERATIVA DE CREDITO RURAL
181	COOPERATIVA DE ECONOMIA E CREDITO MUTUO
182	SOCIEDADE DE CREDITO AO MICROEMPREENDEDOR
681	ACUCAR E ALCOOL
682	ADMINISTRADORAS DE CONSORCIO
683	AGENCIAS DE VIAGENS
684	AGRICULTURA E PECUARIA
685	ARMAZENAGEM E ABASTECIMENTO
686	ARTEFATOS DE AMIANTO
687	ASSOCIACAO DE POUPANCA E EMPRESTIMO
688	AUDIOVISUAL
689	AUTOPECAS
690	BANCO COMERCIAL
691	BANCO COOPERATIVO
692	BANCO DE DESENVOLVIMENTO
693	BANCO DE INVESTIMENTO
694	BANCO MULTIPLO 01
695	BANCO MULTIPLO 10
696	BANCO MULTIPLO 11
697	BANCO MULTIPLO 12
698	BANCO MULTIPLO 13
699	BANCO MULTIPLO 14
700	BANCO MULTIPLO 15
701	BANCO MULTIPLO 16
702	BANCO MULTIPLO 17
703	BANCO MULTIPLO 18

704	BANCO MULTIPLO 19
705	BANCO MULTIPLO 02
706	BANCO MULTIPLO 20
707	BANCO MULTIPLO 21
708	BANCO MULTIPLO 22
709	BANCO MULTIPLO 03
710	BANCO MULTIPLO 04
711	BANCO MULTIPLO 05
712	BANCO MULTIPLO 06
713	BANCO MULTIPLO 07
714	BANCO MULTIPLO 08
715	BANCO MULTIPLO 09
716	BCB
717	BEBIDA
718	BOLSA DE VALORES
719	BOLSAS DE MERCADORIAS E FUTUROS
720	BORRACHA
721	CAIXA ECONOMICA
722	CAIXAS DE LIQUIDACAO E CUSTODIA
723	CALCADOS E SIMILARES
724	CARTEIRA DE INVESTIDORES ESTRANGEIROS
725	CARTEIRA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS - ANEXO III
726	CARVAO
727	CETIP
728	CERAMICA, VIDRO E CRISTAL
729	CIMENTO E CAL
730	CINE-FOTO-SOM
731	CLUBES DE INVESTIMENTO
732	COMERCIO DE ARTIGOS DIVERSOS
733	COMPANHIA HIPOTECARIA
734	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS FINANCEIROS
735	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CREDITOS IMOBILIARIOS
736	COMPONENTES ELETRONICOS
737	CONSTRUCAO CIVIL
738	CONSTRUCAO PESADA
739	COOPERATIVA DE CREDITO
740	CURTUMES
741	CVM
742	DEFENSIVOS AGRICOLAS
743	DISTRIBUIDORA DE COMBUSTIVEIS
744	DIVERSOS
745	DIVERSOS PRODUTOS QUIMICOS
746	DOCES E CONSERVAS
747	EDITORIAL
748	ELETRODOMESTICOS (COMERCIO)
749	ELETRODOMESTICOS
750	EMBALAGENS
751	EMPRESAS COMERCIAIS EXPORTADORAS
752	EMPRESAS DE ADMINISTRACAO E PARTICIPACAO
753	ENGENHARIA CONSULTIVA
754	EQUIPAMENTOS DIVERSOS DE MECANICA
755	FERTILIZANTAS E ADUBOS
756	FRIGORIFICOS
757	FUMO
758	FUNDO DE APLICACAO EM QUOTAS DE FIF
759	FUNDO DE CONVERSAO
760	FUNDO DE INVESTIMENTO CULTURAL E ARTISTICO - FICART
761	FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FMIA

762 FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO
763 FUNDO DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR - FIEX
764 FUNDO DE PRIVATIZACAO - CP
765 FUNDO DE PRIVATIZACAO - DIVIDA SECURITIZADA
766 FUNDO DE PRIVATIZACAO - FGTS
767 FUNDO DE RENDA FIXA
768 FUNDO MUTUO DE INVESTIMENTO EM ACOES - CARTEIRA LIVRE
769 FUNDO MUTUO DE INVESTIMENTO EM EMPRESAS EMERGENTES
770 FUNDO SETORIAL DE INVESTIMENTO EM ACOES
771 FUNDOS DE INVESTIMENTO FINANCEIRO - FIF
772 GESSO E CIMENTO
773 GRAFICO
774 HOTEIS
775 IMOBILIARIAS
776 INDUSTRIA DE INFORMATICA
777 INDUSTRIA DE PAPEL E CELULOSE
778 INSTITUTOS DE PESQUISA
779 LATICINIOS
780 LOJAS DE DEPARTAMENTO
781 MADEIRAS
782 MAQUINAS AGRICOLAS
783 MAQUINAS E MOTORES
784 MAQUINAS PESADAS
785 MASSAS
786 MATERIAL DE CONSTRUCAO
787 MATERIAL DE CONSTRUCAO E FERRAGENS
788 MATERIAL DE TRANSPORTE
789 METALURGIA
790 MINERAIS DIVERSOS
791 MINERAIS METALICOS
792 MOBILIARIO
793 MOINHOS E CEREAIS
794 OLEOS VEGETAIS
795 OUTRAS ATIVIDADES INDUSTRIAIS
796 PESCA
797 PETROQUIMICA E PLASTICOS
798 PREVIDENCIA SOCIAL
799 PROCESSAMENTO DE DADOS
800 PRODUTO DE PERFUMARIA E HIGIENE
801 PRODUTOS DIVERSOS DE ALIMENTACAO
802 PRODUTOS FARMACEUTICOS
803 PRODUTOS VETERINARIOS
804 PRODUTOS ELETRO-ELETRONICOS
805 PROSPECCAO E REFINO DE PETROLEO
806 RADIO E TELEVISAO
807 REFLORESTAMENTO
808 REVENDA DE AUTOMOVEIS
809 REVENDA DE MAQUINAS
810 SANEAMENTO E GAS
811 SELIC
812 SERVICOS ADMINISTRATIVOS DIVERSOS
813 SERVICOS AEROPORTUARIOS
814 SERVICOS DE AGUA
815 SERVICOS DE ELETRICIDADE
816 SERVICOS DE PLANEJAMENTO E DESENVOLVIMENTO
817 SERVICOS DIVERSOS
818 SERVICOS PORTUARIOS
819 SIDERURGIA

820 SOCIEDADE CORRETORA DE CAMBIO
821 SOCIEDADE CORRETORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS
822 SOCIEDADE DE ARRENDAMENTO MERCANTIL
823 SOCIEDADE DE CAPITALIZACAO
824 SOCIEDADE DE CREDITO IMOBILIARIO
825 SOCIEDADE DE CREDITO, FINANCIAMENTO E INVESTIMENTO
826 SOCIEDADE DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS
827 SOCIEDADE SEGURADORA
828 SOCIEDADES SEGURADORAS ESPECIALIZADAS EM SAUDE
829 PREVIC
830 SUPERMERCADOS
831 SUSEP
832 TELECOMUNICACOES
833 TESOURO ESTADUAL
834 TRANSPORTE AEREO
835 TRANSPORTE COLETIVO
836 TRANSPORTE MARITIMO E FLUVIAL
837 TRANSPORTE RODOVIARIO E DE CARGA
838 VESTUARIO
839 ENTIDADE ABERTA DE PREVIDENCIA PRIVADA
840 ENTIDADE FECHADA DE PREVIDENCIA PRIVADA
841 AGENCIA DE FOMENTO
842 BOLSA DE MERCADORIAS
843 SOCIEDADE CORRETORA DE MERCADORIAS
844 SOCIEDADE CORRETORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS E CAMBIO
845 TESOURO NACIONAL
851 ASSOCIACAO DE CLASSES
852 FACTORING
861 INVESTIDOR NAO RESIDENTE
862 TESOURO MUNICIPAL
863 FUNDO DE APOSENTADORIA PROGRAMADA INDIVIDUAL - FAPI
864 FUNDO DE INVESTIMENTO EM TITULOS E VALORES MOBILIARIOS - FITVM
865 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM TITULOS E VALORES MOBILIARIOS-FIQFITVM
866 COMERCIO DE ARTIGOS TEXTEIS
867 OPERADORAS DE PLANOS DE ASSISTENCIA A SAUDE
868 ANS
869 FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS
870 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPACOES
871 FUNDO DE INVESTIMENTO DE CURTO PRAZO
872 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO DE CURTO PRAZO
873 FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO
874 FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DE LONGO PRAZO
875 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADOS
876 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADOS DE LONGO PRAZO
877 FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA
878 FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA DE LONGO PRAZO
879 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO DE RENDA FIXA
880 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO DE RENDA FIXA DE LONGO PRAZO
881 FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES
882 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES
883 FUNDO DE INVESTIMENTO CAMBIAL

884 FUNDO DE INVESTIMENTO CAMBIAL DE LONGO PRAZO
885 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO CAMBIAL
886 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO CAMBIAL DE LONGO PRAZO
887 FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIVIDA EXTERNA
888 FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIVIDA EXTERNA DE LONGO PRAZO
889 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIVIDA EXTERNA
890 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIVIDA EXTERNA DE LONGO PRAZO
891 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO
892 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO DE LONGO PRAZO
893 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO
894 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO DE LONGO PRAZO
895 COMPANHIA SECURITIZADORA DE DIREITOS CREDITORIOS DO AGRONEGOCIO
896 COOPERATIVA DE PRODUTORES RURAIS
897 FUNDO DE INVESTIMENTO PREVIDENCIARIO
898 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FIDC - FIQFIDC
899 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE PARTICIPAÇÕES - FICFIP
900 FUNDO DE INVESTIMENTO DO FUNDO DE GARANTIA DO TEMPO DE SERVICO
901 COOPERATIVA DE CREDITO - SEGMENTO RURAL
902 COOPERATIVA DE CREDITO RURAL - SEGMENTO RURAL
903 COOPERATIVA DE ECONOMIA E CREDITO MUTUO - SEGMENTO RURAL
904 BANCO DE CAMBIO
905 BANCO MULTIPLO COM RESERVA BANCARIA SEM CARTEIRA COMERCIAL
906 CARTORIO DE NOTAS
907 CARTORIO DE REGISTRO CIVIL DE PESSOAS NATURAIS
908 CARTORIO DE REGISTRO CIVIL DE PESSOAS JURIDICAS
909 CARTORIO DE REGISTRO DE TÍTULOS E DOCUMENTOS
910 CARTORIO DE REGISTRO DE IMOVEIS
911 CARTORIO DE REGISTRO DE TITULOS
912 FUNDO GARANTIDOR DE OPERACOES
913 FUNDO DE INVESTIMENTO EM ÍNDICE DE MERCADO
915 FUNCINE FUNDO DE FINANCIAMENTO DA INDUSTRIA CINEMATOGRAFICA NACIONAL
916 ASSOCIACAO CIVIL SEM FINS LUCRATIVOS
917 COOPERATIVA DE CREDITO SINGULAR PLENA
918 COOPERATIVA DE CREDITO SINGULAR CLASSICA
919 COOPERATIVA DE CREDITO SINGULAR CAPITAL E EMPRESTIMO
920 COOPERATIVA DE CREDITO CENTRAL
921 CONFEDERACAO DE COOPERATIVA DE CREDITO
922 COOPERATIVA DE CREDITO CENTRAL - SEGMENTO RURAL
923 COMPANHIA SECURITIZADORA DE DIREITOS CREDITÓRIOS IMOBILIÁRIOS E DO AGRONEGÓCIO

Arquivo de Retorno DMOVTRANSF
Nome do Arquivo
18 DMOVTRANSF
Descrição: Arquivo de Retorno dos registros por Transferências de Arquivo.

Header (Registro):

Seq.	Campo	Descrição
01	Número da Linha Original	Número da Linha do Arquivo Original
02	Separador	Ponto e vírgula (;)
03	Código IF	Código do Certificado de Operação Estruturada
04	Separador	Ponto e vírgula (;)
05	Código da Operação	Código identificador da operação.
06	Separador	Ponto e vírgula(;)
07	Descrição da Mensagem	Mensagem do Resultado do Processamento
08	Separador	Ponto e vírgula (;)
09	Texto da Linha Original	Texto da Linha do Arquivo Original

19 TABELA 01 DE DOMÍNIO DERIVATIVOS (TXT).

	Codigo do contrato		Tipo de contrato		Liquidação de Exercicio	Variavel	Preço	Fonte	Boletim	Data Fixing	Top de Opção	Barreiras	
	Compra	Venda	Compra	Venda	Com Garantia					Com Garantia		Permitidas	Preço de Verificação
Opçoes Flexiveis	OFC	OFV	2	3	N (T+1)	DOL - (Dolar)	T1 - PTAX VENDA	BCB	PTAX Venda	001 (T-1)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up PB - Limitador"	T1 - Ptax Venda
	FCB	FPB	2	3	N (T+1)	IBX - (IBRX50)	2 - PF 3 - PL	BVMF	Preço Fechamento Preço Liquidação	0 (T-0) 001 (T1)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up PB - Limitador"	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
	FCI	FPI	2	3	N (T+1)	IBOV - (IBOVESPA)	02 - PF 03 - PL	BVMF	Preço Fechamento Preço Liquidação	0 (T-0) 001 (T1)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up PB - Limitador"	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
	FCS	FPS	2	3	N (T+1)	IDI - (ÍNDICE CDI)	5	CETIP	2009	0 (T-0) 001 (T1)	E - Europeia	IU - Knock in and Up OU - Knock Out and Up PB - Limitador"	2009
	FCS	FPS	2	3	N (T+1)	ISE - (ÍNDICE SELIC)	4	BCB	2005	0 (T-0) 001 (T1)	E - Europeia	IU - Knock in and Up OU - Knock Out and Up PB - Limitador"	2005
	FBC	FBP	2	3	N (T+1)	BOV - (BOVA11)	2 - PF	BVMF	Preço Fechamento	0 (T-0) 001 (T1) 002 (T2)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
	FFC	FFP	2	3	N (T+1)	FIND - (FIND11)	2 - PF	BVMF	Preço Fechamento	0 (T-0) 001 (T1) 002 (T2)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
	FGC	FGP	2	3	N (T+1)	GOV - (GOV11)	2 - PF	BVMF	Preço Fechamento	0 (T-0) 001 (T1) 002 (T2)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
	FIC	FIP	2	3	N (T+1)	ISUS - (ISUS11)	2 - PF	BVMF	Preço Fechamento	0 (T-0) 001 (T1) 002 (T2)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
	FCA	FPA	2	3	N (T+1)	Consultar Tabeça Auxiliar - Opçã o Flexivel	PF - PREÇO DE FECHAMENTO PM - PREÇO DE LIQUIDAÇÃO	BVMF	PF - PREÇO DE FECHAMENTO PM PREÇO MEDIO	0 (T-0) 001 (T1) 002 (T2)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up PB - Limitador"	UP - Preço Max DOWN - Preço Min

	Contrato		Variavel		Preço de Referencia	
	Codigo	Tipo de Contrato	Variável 1	Variável 2	Variável 1	Variável 2
Swap	SCE	1	DOL (DOLAR)	REU (EUR)	T1 - (Ptax de Venda)	T1 - (Ptax de Venda)
	SCJ	1	DOL (DOLAR)	TJL (TJLP)	T1 - (Ptax de Venda)	N/A
	SCL	1	DOL (DOLAR)	IAP (IPCA)	T1 - (Ptax de Venda)	N/A
	SCM	1	DOL (DOLAR)	IGM (IGPM)	T1 - (Ptax de Venda)	N/A
	SCP	1	DOL (DOLAR)	PRE (PRE)	T1 - (Ptax de Venda)	N/A
	SCY	1	DOL (DOLAR)	JPY (IENE)	T1 - (Ptax de Venda)	T1 - (Ptax de Venda)
	SDC	1	DI1 (CDI)	DOL (DOLAR)	N/A	T1 - (Ptax de Venda)
	SDE	1	DI1 (CDI)	REU (EUR)	N/A	T1 - (Ptax de Venda)
	SDJ	1	DI1 (CDI)	TJL (TJLP)	N/A	N/A
	SDL	1	DI1 (CDI)	IAP (IPCA)	N/A	N/A
	SDM	1	DI1 (CDI)	IGM (IGPM)	N/A	N/A
	SDP	1	DI1 (CDI)	PRE (PRE)	N/A	N/A
	SDT	1	DI1 (CDI)	TR (TR)	N/A	N/A
	SDY	1	DI1 (CDI)	IEN (IENE)	N/A	T1 - (Ptax de Venda)
	SEP	1	PRE (PRE)	REU (EUR)	N/A	T1 - (Ptax de Venda)
	SJP	1	PRE (PRE)	TJL (TJLP)	N/A	N/A
	SLE	1	REU (EUR)	IAP (IPCA)	T1 - (Ptax Venda)	N/A
	SLP	1	IAP (IPCA)	PRE (PRE)	N/A	N/A
	SMP	1	IGM (IGPM)	PRE (PRE)	N/A	N/A
	SRP	1	IBX (IBRX-50)	PRE (PRE)	PF - (Preço Fechamento)	N/A
	SNP	1	IBV (IBOVESPA)	PRE (PRE)	PF - (Preço Fechamento)	N/A
	SDN	1	IBV (IBOVESPA)	DI1 (CDI)	PF - (Preço Fechamento)	N/A