

LAYOUT EM IMPLEMENTAÇÃO
SWAP SEM CCP
ANTECIPAÇÃO - JUN/24

CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÕES.....	3
2. ENVIAR ARQUIVOS.....	4
2.1 Swap - Registro de Antecipação de Contrato.....	4

1 ATUALIZAÇÕES

Atualizado em	Referência	Atualização
07/03/2024	Enviar Arquivos	Inclusão do campo “Data de Liquidação” para agendamento da liquidação da Antecipação de Swap, conforme divulgado no comunicado externo.

Legendas obrigatórias:

- Novos domínios
- Alteração de regra ou detalhamento
- Novo campo – Preenchimento opcional
- Novo campo – Preenchimento obrigatório condicional
- Novo campo – Preenchimento obrigatório

2. ENVIAR ARQUIVOS

2.1 Swap - Registro de Antecipação de Contrato

SWAP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Registro: 111 caracteres
Registro de Antecipação de Contrato	
Descrição: Este layout permite aos Participantes realizar a antecipação parcial ou total de contrato de swap.	

Header				
Seq	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
1	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	SWAP
2	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Linha de Header = 0
3	Código da Operação	9(04)	7 - 10	Código identificador da operação. Operação 0014
4	Participante que gerou o arquivo	X(20)	11 - 30	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
5	Data	9(08)	31 - 38	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
6	Versão do Layout	9(05)	39 - 43	00001
7	Filler	X(60)	44 - 103	Reservado para futuras implementações

Registro				
Seq	Campo	Formato	Posição	Descrição/conteúdo
1	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	SWAP
2	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Linha de Dados = 1
3	Código operação	9(04)	7 - 10	Código identificador da operação. Operação 0014
4	Código do Contrato	X(11)	11 - 21	Código identificador do instrumento financeiro a ser antecipado.
5	Papel	9(02)	22 - 23	Possíveis valores: 00 (Ponta 1) e 01 (Ponta 2)
6	Meu Número	9(10)	24 - 33	Código de controle atribuído pelo Participante
7	Fator para Antecipação (Ponta1)	9(10)v9(08)	34 - 51	Fator para Antecipação (Ponta 1)
8	Fator para Antecipação (Ponta2)	9(10)v9(08)	52 - 69	Fator para Antecipação (Ponta 2)
9	Data Antecipação	9(08)	70 - 77	Data da antecipação do Contrato. Formato: AAAAMMDD
10	Banco Liquidante	9(08)	78 - 85	Banco Liquidante
11	Valor Para Antecipação	9(14)v9(02)	86 - 101	Valor a ser antecipado.
12	Mantém Prêmios	9(02)	102 - 103	Indica se após antecipação se prêmios deverão ser mantidos. Possíveis valores: 00 (sim) e 01 (não)
13	Data de Liquidação	9(08)	104 - 111	Data de Liquidação da Antecipação do Contrato. Formato: AAAAMMDD