



18 de dezembro de 2013  
027/2013-DI

## COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da BM&FBOVESPA – Segmentos BOVESPA e BM&F

**Ref.: Alteração na Identificação de Estratégias Forward Points e Forward Rate Agreement e Divulgação de Chaves de Identificação de Instrumentos via Security List.**

Visando preparar a unificação da identificação dos instrumentos entre o PUMA Trading System BM&FBOVESPA e nova plataforma da clearing integrada, informamos que será implantada alteração na geração da identificação de determinadas estratégias.

A cada expiração de um de seus componentes (pontas que formam a estratégia), será gerado um novo número de identificação (SecurityID) para os instrumentos das seguintes estratégias:

- FRC – Forward Rate Agreement de Cupom Cambial;
- FRO – Forward Rate Agreement de Cupom Cambial Baseado em Operações Compromissadas de Um Dia;
- FRP – Forward Points com Contrato Futuro de Dólar Comercial (FRP0 e FRP1);
- FRM – Forward Rate Agreement de Cupom de DI x IGP-M;
- FRG – Forward Rate Agreement de IGP-M;
- FRI – Forward Rate Agreement de IPCA;
- FWI – Forward Points com Futuro de Ibovespa.

No final do mês corrente (dezembro/2013), ocorrerá a primeira aplicação dessa nova abordagem por conta do vencimento de pontas das estratégias acima.

Ressalta-se que não será alterado o código de negociação. Portanto, não haverá impacto para interface de entrada de ordens.



027/2013-DI

.2.

Os documentos contendo a especificação do PUMA Trading System BM&FBOVESPA estão disponíveis em [www.bmfbovespa.com.br/PUMA](http://www.bmfbovespa.com.br/PUMA).

### **Chaves de Identificação dos Instrumentos Divulgados via Security List**

A Security List divulgada pela BM&FBOVESPA contém as definições de todos os instrumentos presentes na plataforma de negociação, inclusive sua identificação para fins de recepção de Market Data.

Para o Market Data que utiliza o padrão FIX – Financial Information eXchange, essa identificação é uma chave tripla formada pelos campos SecurityExchange, SecurityID e SecurityIdSource.

A implantação da primeira fase da clearing integrada levará à unificação de identificação de instrumentos do **segmento BM&F**, tanto na negociação como na pós-negociação. Porém, isso ainda não ocorrerá com os instrumentos do segmento BOVESPA.

Dessa forma, no lançamento da clearing integrada o comportamento será o seguinte:

- Não haverá alteração das chaves de identificação dos instrumentos BM&F na plataforma de negociação. Ou seja, as chaves de identificação permanecerão as mesmas e serão iguais às divulgadas nos arquivos externos de instrumentos da clearing integrada (Arquivos ISO BVBG 028, BVBG 029 e CONTRCAD\_IPN).
- Não haverá unificação de identificação para os instrumentos do segmento BOVESPA. Dessa forma, a chave tripla de identificação de equities – divulgada nos arquivos ISO e PAPD, PAPT e PAPH – não coincidirá com a chave tripla divulgada na Security List do PUMA Trading System BM&FBOVESPA.

Em ambos os segmentos, os códigos de negociação dos instrumentos não serão alterados e **não haverá impacto** para a entrada de ordens, na qual o único campo de identificação obrigatório é o próprio código de negociação.

Com a implantação da primeira fase da clearing integrada, para os consumidores de Security List pelo Market Data BM&FBOVESPA, haverá os impactos a seguir relacionados.

**Segmento BOVESPA**

- **Market Data UMDF PUMA 2.0**  
Os valores que compõem a trinca de identificação dos instrumentos permanecerão os mesmos. Entretanto, os valores de SecurityID divulgados por esse sinal não corresponderão aos divulgados nos arquivos de instrumentos da clearing integrada.
- **Market Data ProxyDiff**  
Esse sinal não contém a chave tripla do FIX. A identificação dos instrumentos é feita por seus códigos de negociação. Não há impacto.
- **Market Data UMDF Mega (Legado)**  
É um sinal convertido a partir do ProxyDiff. Não contém a chave tripla. Contém os campos da chave tripla, mas o SecurityID é preenchido com o código de negociação e seu valor não será alterado.

**Segmento BM&F**

- **Market Data UMDF PUMA 1.6**  
Os valores que compõem a trinca de identificação dos instrumentos permanecerão os mesmos.
- **Market Data BELL**  
É um sinal padrão FIX e convertido a partir do sinal nativo. Contém a chave tripla de identificação. Os valores de SecurityID não serão alterados com a implantação da clearing integrada.

Atenciosamente,

  
Luis Otávio Saliba Furtado  
Diretor Executivo de Tecnologia e Segurança da Informação