

Administração de Colaterais

Relatório de Definições de Mensagens

Este documento descreve um conjunto de definições de mensagens desenvolvidas pela BM&FBOVESPA, a serem utilizadas no processo de administração de colaterais.

A implantação da integração das clearings da BM&FBOVESPA e do novo sistema de risco CORE (Closeout Risk Evaluation) depende de prévia autorização dos órgãos reguladores.

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição	Responsável
17/10/2014	1.2	Versão em produção na Clearing BM&FBOVESPA	

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
bvmf.111.01	1.0
bvmf.112.01	1.2
bvmf.113.01	1.0
bvmf.114.01	1.2

Descrição detalhada no documento "Manual Técnico".

Status das Mensagens e Arquivos no Projeto IPN

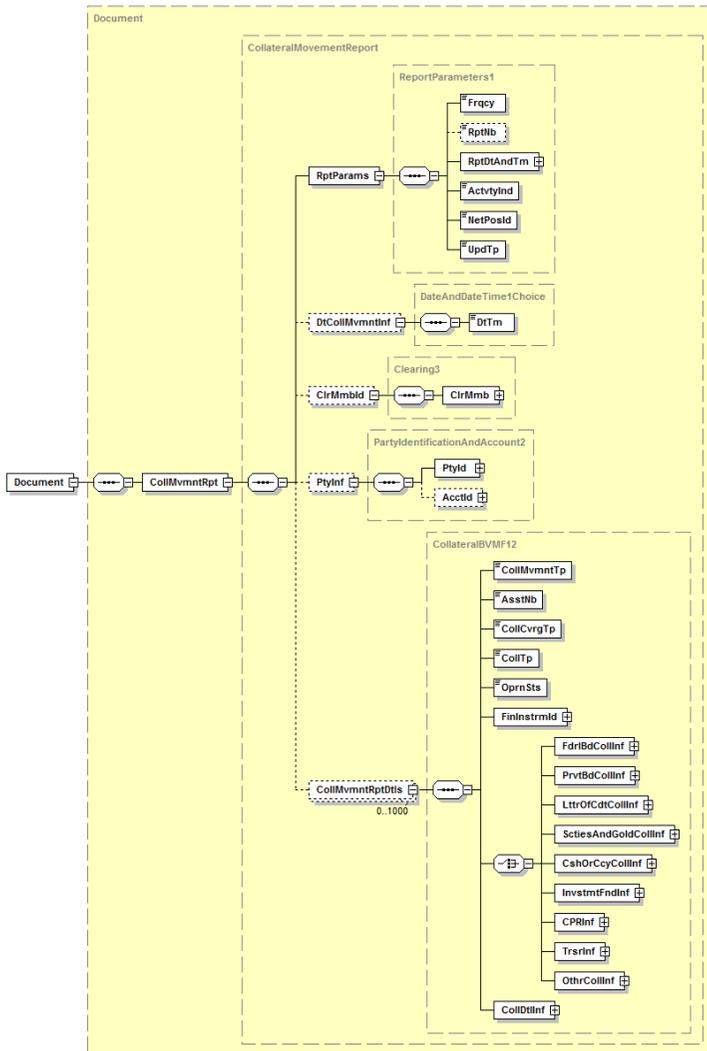
Mensagem somente atendem a Clearing de Derivativos (V1 IPN)	Mensagem pode sofrer ajuste para atender Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada (V2 do IPN)	Mensagem revisada para atender V2 do IPN	Novas Mensagens para Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada
	bvmf.086.01 SummarizedIntradayRiskResponse		
	BVBG.030.01 MaximumTheoreticalMarginResponse		
	BVBG.034.01 MasterAccountAndInvestorIntradayRiskResponse		
	BVBG.032.01 InvestorsCloseoutStrategyResponse		

Conteúdo

Histórico de Revisão	2
Versão de Schema	3
<i>Status das Mensagens e Arquivos no Projeto IPN</i>	4
Visão geral	10
<i>Escopo</i>	10
<i>Lista de Mensagens e Arquivos</i>	10
<i>Como Ler</i>	12
Fluxos de Mensagens	13
<i>Requisita Consulta de Garantias</i>	13
Introdução	13
Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Consulta de Garantias	13
Cenário2: BM&FBOVESPA Informa Consulta de Garantias	14
<i>Solicita Consulta de Movimentação de Garantia</i>	15
Introdução	15
Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Consulta de Movimentação de Garantias	15
Cenário2: BM&FBOVESPA Informa Consulta de Movimentação de Garantias	16
bvmf.111.01 - CollateralValuationRequest	18

<i>Funcionalidade da Mensagem</i>	18
<i>Escopo</i>	18
<i>Uso</i>	18
<i>Diagrama da Mensagem</i>	19
<i>Regras</i>	19
<i>Estrutura da mensagem “CollateralValuationRequest” (bvmf.111.01)</i>	20
bvmf.112.01 – CollateralValuationReport	23
<i>Funcionalidade da Mensagem</i>	23
<i>Escopo</i>	23
<i>Uso</i>	23
<i>Diagrama da Mensagem</i>	24
<i>Regras</i>	26
<i>Estrutura da mensagem “CollateralValuationReport” (bvmf.112.01)</i>	26
bvmf.113.01 – CollateralMovementRequest	38
<i>Funcionalidade da Mensagem</i>	38
<i>Escopo</i>	38
<i>Uso</i>	38
<i>Diagrama da Mensagem</i>	39
<i>Regras</i>	39
<i>Estrutura da mensagem “CollateralMovementRequest” (bvmf.113.01)</i>	40

bvmf.114.01 – CollateralMovementReport	43
<i>Funcionalidade da Mensagem</i>	43
<i>Escopo</i>	43
<i>Uso</i>	44
<i>Diagrama da Mensagem</i>	45



<i>Regras</i>	47
<i>Estrutura da mensagem “CollateralMovementReport” (bvmf.114.01)</i>	47

Visão geral

Escopo

Este documento descreve o conjunto de definições de mensagens desenvolvidas pela BM&FBOVESPA que serão utilizadas nos fluxos de administração de colaterais.

Os cenários de negócio 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 normalizadas.

Lista de Mensagens e Arquivos

1. CollateralValuationRequest < bvmf.111.01 >

A mensagem CollateralValuationRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação à BM&FBOVESPA para solicitar a consulta de garantias depositadas das contas de clientes, Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Copensação.

2. CollateralValuationReport < bvmf.112.01 >

A mensagem CollateralValuationReport é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação com a consulta de garantias das contas de clientes, Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação, Membro de compensação.

3. CollateralMovementRequest < bvmf.113.01 >

A mensagem CollateralMovementRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação à BM&FBOVESPA para solicitar a consulta de movimentação de garantia.

4. CollateralMovementReport < bvmf.114.01>

A mensagem CollateralMovementReport é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação com a consulta de movimentação de garantia.

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

Requisita Consulta de Garantias

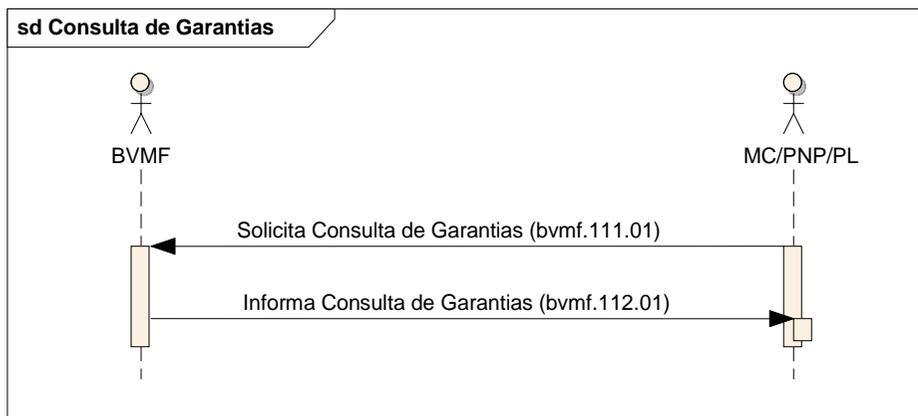
Introdução

Este fluxo ilustra o uso das mensagens CollateralValuationRequest e CollateralValuationReport em típicos cenários sequenciais para informar a consulta de garantias.

Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Consulta de Garantias

Este cenário é utilizado para informar consulta de garantias.

- O Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação envia uma mensagem CollateralValuationRequest **<bvmf.111.01>** à BM&FBOVESPA para solicitar a consulta de garantias de conta de cliente, Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação;
- A BM&FBOVESPA envia uma mensagem CollateralValuationReport **< bvmf.112.01>** informando as garantias do participante.

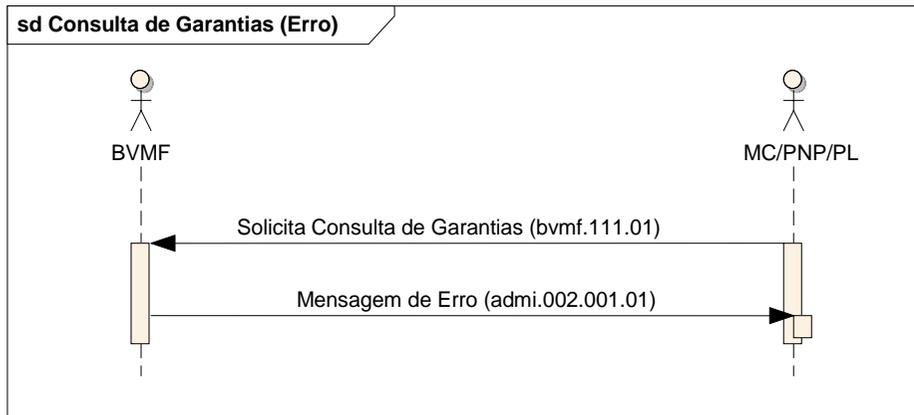


Cenário2: BM&FBOVESPA Informa Consulta de Garantias Cenário de Erro

Este cenário trata da ocorrência de erro durante o processamento da solicitação de limite de risco intradiário.

O Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação envia uma mensagem CollateralValuationRequest (**bvmf.111.01**) à BM&FBOVESPA para solicitar a consulta de garantias com alguma não conformidade.

A BM&FBOVESPA envia uma mensagem de erro (**admi.002.001.01**) com o código de motivo da rejeição.



Solicita Consulta de Movimentação de Garantia

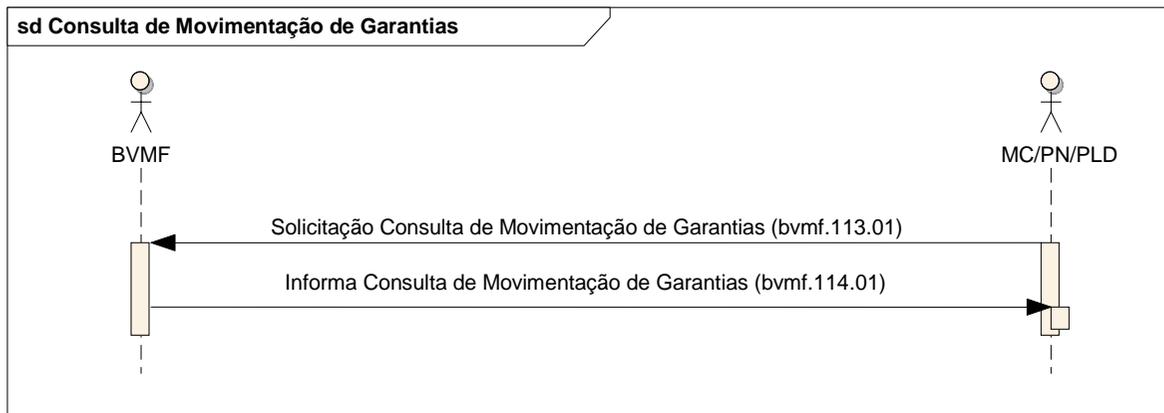
Introdução

Este fluxo ilustra o uso das mensagens CollateralMovementRequest e CollateralMovementReport para informar a movimentação de garantia.

Cenário1: BM&FBOVESPA Informa Consulta de Movimentação de Garantias

Este cenário é utilizado para informar consulta de movimentação de garantias.

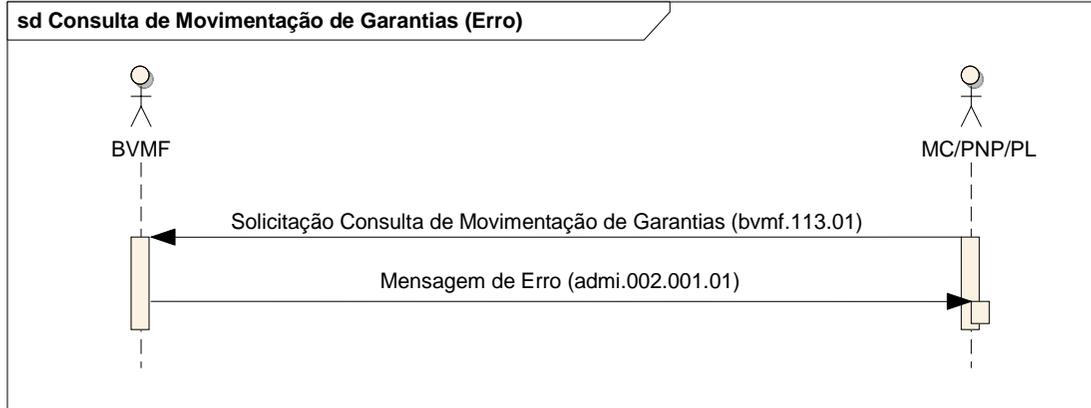
- O Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação envia uma mensagem CollateralMovementRequest < **bvmf.113.01**> à BM&FBOVESPA para solicitar a consulta de movimentação de garantia.
- A BM&FBOVESPA envia uma mensagem CollateralMovementReport < **bvmf.114.01**> informando a movimentação de garantias do participante.



Cenário2: BM&FBOVESPA Informa Consulta de Movimentação de Garantias Cenário de Erro

Este cenário é utilizado para informar consulta de movimentação de garantia.

- O Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação envia uma mensagem CollateralMovementRequest < **bvmf.113.01**> à BM&FBOVESPA com alguma não conformidade.
- A BM&FBOVESPA envia uma mensagem de erro (**admi.002.001.01**) com o código de motivo da rejeição.



bvmf.111.01 - CollateralValuationRequest

Funcionalidade da Mensagem

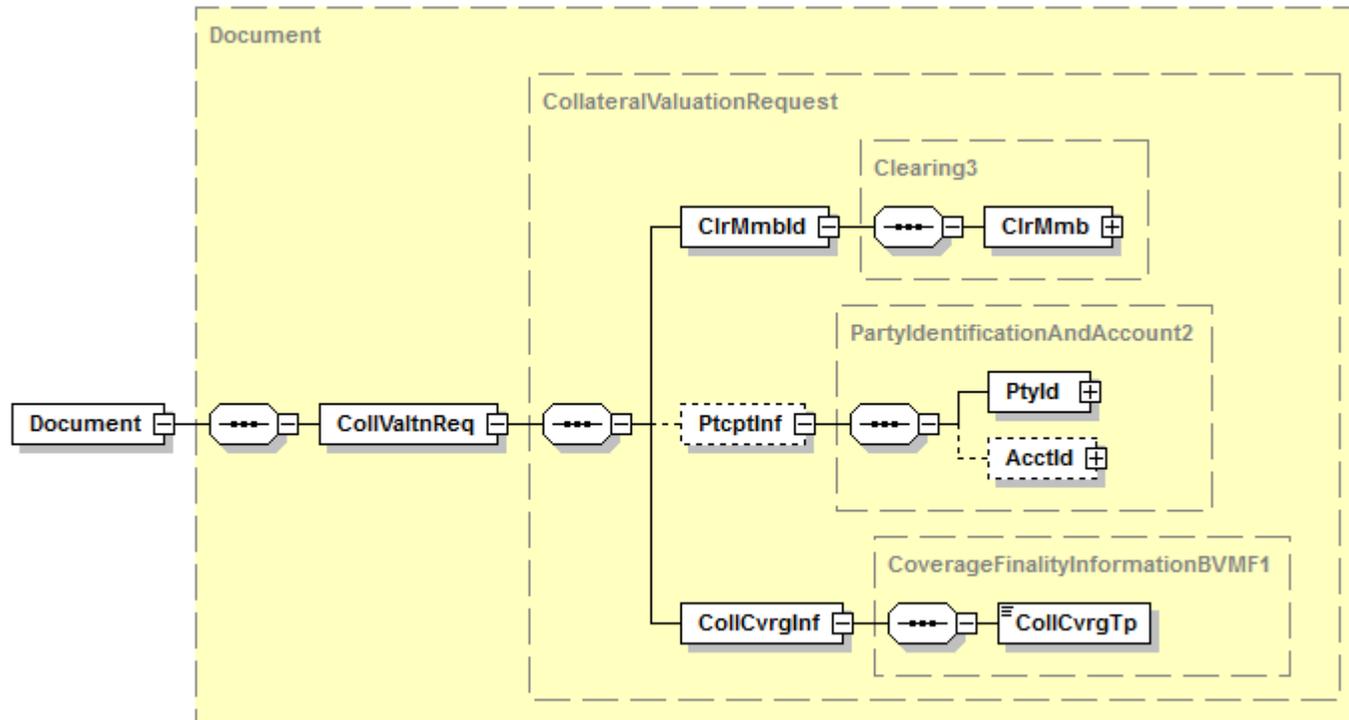
Escopo

Mensagem de requisição para consultar as garantias depositadas de uma conta específica, participante de negociação pleno, participante de liquidação ou de um Membro de Compensação.

Uso

Esta mensagem é de uso exclusivo de participante da BMFBovespa: membro de compensação, participante de negociação pleno e participante de liquidação.

Diagrama da Mensagem



Generated by XmlSpy

www.altova.com

Regras

- R1** - Somente é permitida a consulta de movimentações do dia.
- R2** – O preenchimento do campo MC é sempre obrigatório.
- R3** – Se a consulta é de garantias de um MC, deve ser preenchido somente o campo MC.
- R4** – Se a consulta é de garantias de um Participante de negociação ou de liquidação, devem ser preenchidos somente os campos MC e Negociador.
- R5** – Se a consulta é de garantias de um cliente, devem ser preenchidos os campos MC, Negociador e conta.
- R6** – A finalidade de cobertura deve ser informada conforme tabela abaixo. No caso de preenchimento indevido será retornada uma mensagem de erro.

ID	Descrição	Categoria
0	Todos	Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e Investidor
1	Garantias de Operações	Participante de Negociação Pleno e Investidor
2	Limite Operacional	Membro de Compensação e Participante de Negociação Pleno
11	Fundo de Liquidação - C1	Membro de Compensação
31	Garantia Mínima não Operacional	Membro de Compensação
40	Ampliação de Limite de Emissão	Emissor de Garantias
42	Depósito	Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno e Participante de Liquidação

Estrutura da mensagem “CollateralValuationRequest” (bvmf.111.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbld	[1..1]	+	This block provides information about clearing member identification.	Este bloco possui informações de identificação do membro de compensação.	
1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornecer detalhes da identificação do membro de compensação.	
1.1.1		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.	
1.1.1.1		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.	

1.1.1.1.1	Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: 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. 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 ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).
1.1.1.1.2	Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.
1.1.1.1.3	SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.
2.0	ParticipantInformation	PtcptInf	[0..1]	+	This block provides information about participant and account identification.	Este bloco possui as informações de identificação do participante e conta.
2.1	PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.
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.

2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: 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. 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 ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.
2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.
2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
3.0		CollateralCoverageInformation	CollCvrgInf	[1..1]	+	This block provides the collateral coverage information.	Este bloco possui a identificação da finalidade de cobertura.

 BM&F BOVESPA A Nova Bolsa	Definição – Catálogo de Mensagens	Administração de Colaterais
	Data: 17/10/2014	

3.1		CollateralCoverageType	CollCvrgTp	[1..1]	ExternalCollateralCoverageTypeCode	Collateral coverage identification 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 is ExternalCollateralCoverageTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Identificação da finalidade de cobertura de garantias. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCollateralCoverageTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	R6
------------	--	------------------------	------------	--------	------------------------------------	--	--	----

bvmf.112.01 – CollateralValuationReport

Funcionalidade da Mensagem

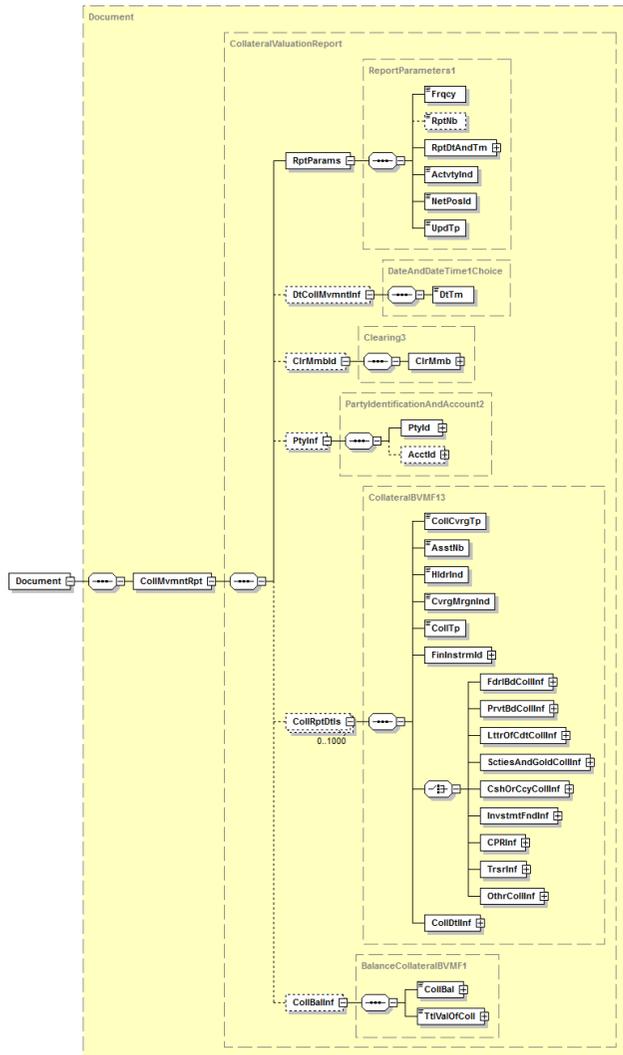
Escopo

Mensagem de resposta a solicitação de um MCs, PNPs ou PLs através da bmf.111, contendo todas as garantias depositadas na BM&FBOVESPA, no momento solicitação, conforme filtro solicitado.

Uso

Esta mensagem é de uso exclusivo de participante da BMFBovespa: membro de compensação, participante de negociação pleno e participante de liquidação.

Diagrama da Mensagem



Generated by XmiSpy www.altova.com

Regras

Não há regra.

Estrutura da mensagem “CollateralValuationReport” (bvmf.112.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Provides the parameters of the report.	Este bloco possui as informações específicas da geração do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		DateCollateralMovementInformation	DtCollMvmntInf	[0..1]	+	Provides data and time the movement collateral.	Fornece a data e hora do movimento de garantias.	
2.1		DateTime	DtTm	[1..1]	ISODateTime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.	
3.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbld	[0..1]	+	This block identifies the clearing member.	Este bloco possui informações de identificação do membro de compensação.	
3.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member	Fornece detalhes da identificação do	

						identification.	membro de compensação.	
3.1.1		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.	
3.1.1.1		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.	
3.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: 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. 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 ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		PartyInformation	PtyInf	[0..1]	+	This block identifies the party (Trade Participant / Direct Participant identification).	Este bloco possui informações do participante (Participante do Negócio / Participante Direto).	
4.1		PartyIdentification	Ptyld	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
4.1.1		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		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: 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. 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 ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).
4.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.
4.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.
4.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.
4.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.
4.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
5.0		CollateralReportDetails	CollRptDtls	[0..1000]	+	This block contains information about participant collateral movement.	Este bloco possui informações referentes a movimentação de garantias do participante (Participante do Negócio / Participante Direto).

5.1		CollateralCoverageType	CollCvrgTp	[1..1]	ExternalCollateralCoverageTypeCode	Collateral coverage identification 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 is ExternalCollateralCoverageTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação da finalidade de cobertura de garantias. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCollateralCoverageTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.2		AssetNumber	AsstNb	[1..1]	Max35Text	A number that unambiguously identifies the collateral.	Fornece o número do registro do depósito.	
5.3		HolderIndicator	HldrInd	[1..1]	YesNoIndicator	Identifies if the deposit was made by the collateral holder.	Identifica se o depósito foi feito pelo titular da garantia.	
5.4		CoverageMarginIndicator	CvrgMrgnInd	[1..1]	YesNoIndicator	Identifies if the collateral covers the margin.	Identifica se a garantia cobre a margem.	
5.5		CollateralType	CollTp	[1..1]	ExternalCollateralTypeCode	Provides collateral type code. 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 is ExternalCollateralTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Fornece o tipo de garantia. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCollateralTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
5.6		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides Financial Instrument Identification	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
5.6.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
5.6.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
5.6.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
5.6.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
5.6.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	

5.6.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
5.7	{OR	FederalBondCollateralInformation	FdrIBdCollInf	[1..1]	+	This block provides information about federal bond collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre os títulos privados federais deixados como garantia.	
5.7.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.	
5.7.2		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of federal bond collateral.	Fornece a data de vencimento do título público federal deixado como garantia.	
5.7.2.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.7.3		AssignerAccount	AssgnrAcct	[1..1]	+	Provides assigner account identification.	Fornece a identificação da conta cedente.	
5.7.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.7.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.7.4		AssigneeAccount	AssgncAcct	[1..1]	+	Provides identification about assignee account.	Fornece a identificação da conta cessionária.	
5.7.4.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.7.4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.7.5		CustodianIdentification	CtdnId	[1..1]	+	This block provides the custodian identification.	Identificação do custodiante.	
5.7.5.1		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.	

5.7.5.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: 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. 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 ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).
5.7.5.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.
5.7.5.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.
5.8	OR	PrivateBondCollateralInformation	PrvtBdCollInf	[1..1]	+	Provides private bond collateral information.	Este bloco possui informações sobre os títulos privados (CDB) deixados como garantia.
5.8.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.
5.8.2		DepositoryType	DpstryTp	[1..1]	ExternalCollateralDepositoryTypeCode	Provides type of custodian. 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 is ExternalCollateralDepositoryTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Fornece os tipos de custódia. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalDepositoryTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls
5.8.3		IssuerBank	IssrBk	[1..1]	+	This block provides information about issuer document of credit.	Este bloco possui informações do documento do emissor da fiança.

5.8.3.1		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.
5.8.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. CNPJ Number.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Número do CNPJ.
5.8.3.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g RECEITA FEDERAL This field should be filled with default value = 1.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: RECEITA FEDERAL. Este campo deve assumir o valor default = 1.
5.8.3.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CNPJ This field should be filled with default value = 1.	Código do tipo de documento. Ex: CNPJ. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 1.
5.8.4		IssueDate	IsseDt	[1..1]	+	Provides issue date of private bond collateral.	Fornecer a data de emissão do título público privado (CDB) deixado como garantia.
5.8.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.
5.8.5		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of private bond collateral.	Fornecer a data de vencimento do título privado federal (CDB) deixado como garantia.
5.8.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.
5.8.6		CorrectionType	CrrctnTp	[0..1]	ExternalCorrectionTypeCode	Type of CDB correction. Eg.: Pré or Pós 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 is ExternalCorrectionTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de correção do CDB. Exemplo: Pré ou Pós 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCorrectionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls

5.8.7		InterestRateIndex	IntrstRateIndx	[0..1]	ExternalIndexTypeCode	Interest Rate Index. 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 is ExternalIndexTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Indexador de correção. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalIndexTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls
5.8.8		AssignerAccount	AssgnrAcct	[1..1]	+	Provides assigner account identification.	Fornece a identificação da conta cedente.
5.8.8.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.
5.8.8.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
5.8.9		AssigneeAccount	AssgneAcct	[1..1]	+	Provides identification about assignee account.	Fornece a identificação da conta cessionária.
5.8.9.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.
5.8.9.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
5.9	OR	LetterOfCreditCollateralInformation	LttrOfCdtCollnf	[1..1]	+	This block contains information regarding the letter of credit collateral.	Este bloco possui informações sobre a carta fiança deixada como garantia.
5.9.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.
5.9.2		IssuerBank	IssrBk	[1..1]	+	This block provides information about issuer document.	Este bloco possui informações do documento do emissor da fiança.
5.9.2.1		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.
5.9.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. CNPJ Number.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Número do CNPJ.

5.9.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g RECEITA FEDERAL This field should be filled with default value = 1.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: RECEITA FEDERAL. Este campo deve assumir o valor default = 1.	
5.9.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CNPJ This field should be filled with default value = 1	Código do tipo de documento. Ex: CNPJ. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 1.	
5.9.3		IssueDate	IsseDt	[1..1]	+	Provides issue date of collateral.	Fornece a data de emissão da carta fiança deixada em garantia.	
5.9.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.9.4		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of collateral.	Fornece a data de vencimento da carta fiança deixada em garantia.	
5.9.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.9.5		LetterOfCreditIdentification	LtrOfCdtId	[0..1]	Max35Text	Letter of credit control number.	Número de controle da carta fiança	
5.10	OR	SecuritiesAndGoldCollateralInformation	SctiesAndGoldCollInf	[1..1]	+	Provides securities and gold collateral information.	Este bloco possui informações sobre as ações e ouro deixados como garantia.	
5.10.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.	
5.10.2		CustodianInformation	CtdnInf	[1..1]	+	This block identifies the custodian and account identification.	Este bloco possui a identificação e a conta do custodiante.	
5.10.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
5.10.2.1.1		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.	

5.10.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: 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. 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 ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).
5.10.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.
5.10.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.
5.10.2.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.
5.10.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.
5.10.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
5.10.3		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Identification of the sub account.	Identificação da carteira.
5.11	OR	CashOrCurrencyCollateralInformation	CshOrCcyCollnfnf	[1..1]	+	Provides information cash collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre os valores monetários deixados em garantia.
5.11.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.

5.12	OR	InvestmentFundInformation	InvstmtFndInf	[1..1]	+	This block provides information about funds collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre fundo de investimento deixado como garantia.
5.12.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.
5.13	OR	CPRInformation	CPRInf	[1..1]	+	This block provides information about CPR collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre os CPRs deixados como garantia.
5.13.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.
5.13.2		CPRTYPE	CPRTp	[1..1]	ExternalCollateralCPRTYPECode	Provides CPR type information. 1 - Física, 2 - Preço Fixo, 3 - Ajuste Futuro BVMF	Fornece os tipos de CPR: 1 - Física, 2 - Preço Fixo, 3 - Ajuste Futuro BVMF
5.13.3		IssueDate	IsseDt	[1..1]	+	Provides issue date of collateral.	Fornece a data de emissão do CPR.
5.13.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.
5.13.4		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of collateral.	Fornece a data de vencimento do CPR.
5.13.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.
5.14	OR	TreasuryInformation	TrsrInf	[1..1]	+	This block provides information about Treasuries collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre ativo treasury deixado como garantia.
5.14.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.
5.14.2		IssueDate	IsseDt	[1..1]	+	Provides issue date of collateral.	Fornece a data de emissão do ativo deixado em garantia.
5.14.2.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.
5.14.3		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of collateral.	Fornece a data de vencimento do ativo deixado em garantia.
5.14.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.
5.15	OR}	OtherCollateralInformation	OthrCollInf	[1..1]	+	This block provides information about others collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre outros ativos deixados como garantia.
5.15.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.
5.15.2		CollateralDetail	CollDtl	[1..1]	Max35Text	Provides details of collateral.	Fornece detalhes da garantia.
5.15.3		IssueDate	IsseDt	[1..1]	+	Provides issue date of collateral.	Fornece a data de emissão do ativo deixado em garantia.
5.15.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.
5.15.4		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of collateral.	Fornece a data de vencimento do ativo deixado em garantia.
5.15.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.
5.16		CollateralDetailInformation	CollDtlInf	[1..1]	+	This block provides summary information about the collateral.	Este bloco possui informações sobre os valores e quantidades das garantias.

5.16.1		DepositedQuantity	DpsdQty	[0..1]	+	Deposited quantity	Quantidade depositada	
5.16.1.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
5.16.2		ValuedQuantity	ValdQty	[0..1]	+	Accepted collateral quantity.	Quantidade valorizada para garantia.	
5.16.2.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
5.16.3		DeliveryQuantity	DlvryQty	[0..1]	+	Distributed collateral quantity to another account.	Quantidade distribuída para outra conta.	
5.16.3.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
5.16.4		BlockedQuantity	BckdQty	[0..1]	+	Blocked quantity by clearing.	Quantidade bloqueada pela Clearing.	
5.16.4.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
5.16.5		CollateralValue	CollVal	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	Accepted value in the deposited collateral.	Accepted value in the deposited collateral.	
5.16.6		WithdrawalBlockedValue	WdrwlBckdVal	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	Blocked value by clearing.	Valor bloqueado para retirada pela clearing.	
6.0		CollateralBalanceInformation	CollBalInf	[0..1]	+	This block provides information about collateral balance.	Este bloco provê as informações de saldo das garantias.	
6.1		CollateralBalance	CollBal	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	Remaining value (positive value) or debit (negative value) of collateral.	Valor remanescente (valor positivo) ou devedor (valor negativo) de garantias.	
6.2		TotalValueOfCollateral	TtlValOfColl	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	Total value of the collateral (post-haircut) held by the exposed party	Somatória de todas as garantias que cobrem margem.	

bvmf.113.01 – CollateralMovementRequest

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

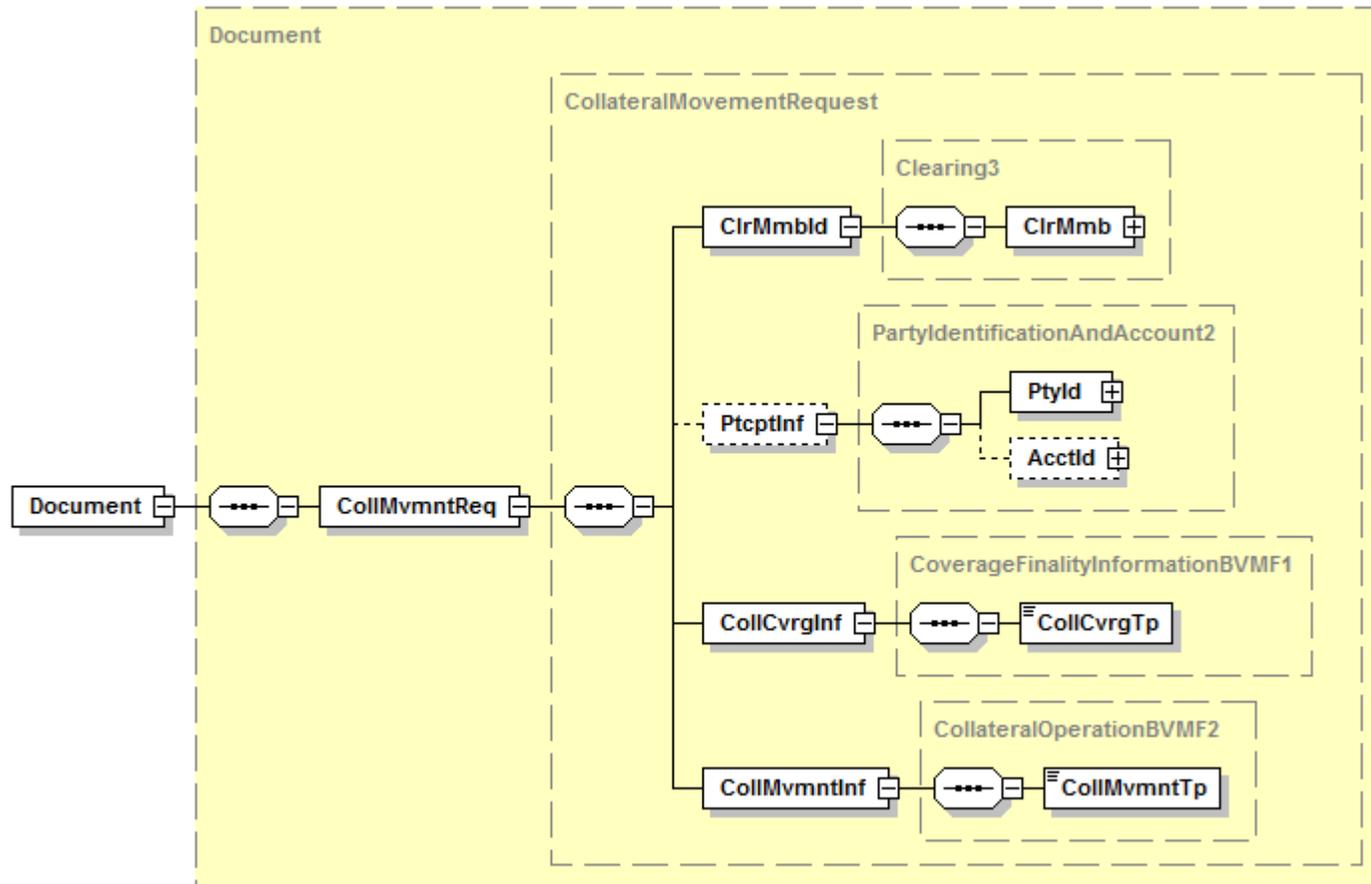
Mensagem de requisição para consultar as movimentações realizadas no dia de uma conta específica, participante de negociação pleno, participante de liquidação ou de um Membro de Compensação.

Uso

Esta mensagem permite filtros por tipo de movimentação dependendo da necessidade do participante. Pode-se filtrar por depósito, retirada, distribuição, transferência ou todos os movimentos do dia. Também é possível filtrar por tipo de participante.

Esta mensagem é de uso exclusivo de participante da BMFBovespa: membro de compensação, participante de negociação pleno e participante de liquidação.

Diagrama da Mensagem



Generated by XmlSpy

www.altova.com

Regras

R1 - Somente é permitida a consulta de movimentações do dia.

R2 – O preenchimento do campo MC é sempre obrigatório.

R3 – Se a consulta é de garantias de um MC, deve ser preenchido somente o campo MC.

R4 – Se a consulta é de garantias de um Participante de negociação ou de liquidação, devem ser preenchidos somente os campos MC e Negociador.

R5 – Se a consulta é de garantias de um cliente, devem ser preenchidos os campos MC, Negociador e conta.

R6 – A finalidade de cobertura deve ser informada conforme tabela abaixo. No caso de preenchimento indevido será retornada uma mensagem de erro.

ID	Descrição	Categoria
0	Todos	Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e Investidor
1	Garantias de Operações	Participante de Negociação Pleno e Investidor
2	Limite Operacional	Membro de Compensação e Participante de Negociação Pleno
11	Fundo de Liquidação - C1	Membro de Compensação
31	Garantia Mínima não Operacional	Membro de Compensação
40	Ampliação de Limite de Emissão	Emissor de Garantias
42	Depósito	Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno e Participante de Liquidação

Estrutura da mensagem “CollateralMovementRequest” (bvmf.113.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbld	[1..1]	+	This block provides clearing member identification.	Este bloco contém a identificação do membro de compensação.	
1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornecer detalhes da identificação do membro de compensação.	
1.1.1		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.	
1.1.1.1		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.	

1.1.1.1.1	Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	<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&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.</p> <p>A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo:</p> <p>Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).</p>
1.1.1.1.2	Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.
1.1.1.1.3	SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.
2.0	ParticipantInformation	PtcptInf	[0..1]	+	This block provides information about participant and account identification.	Este bloco possui as informações de identificação do participante e conta.
2.1	PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.
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.

2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: 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. 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 ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.
2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornecer dados de identificação da conta.
2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
3.0		CollateralCoverageIn formation	CollCvrgInf	[1..1]	+	This block provides collateral coverage identification.	Informações de identificação da finalidade da cobertura.

3.1		CollateralCoverageType	CollCvrgTp	[1..1]	ExternalCollateralCoverageTypeCode	Collateral coverage identification 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 is ExternalCollateralCoverageTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação da finalidade de cobertura de garantias. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCollateralCoverageTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	R6
4.0		CollateralMovementInformation	CollMvmntInf	[1..1]	+	This block provides collateral movement type identification.	Este bloco é usado para filtrar as informações de movimentação de garantias, usando o tipo de movimentação da cobertura.	
4.1		CollateralMovementType	CollMvmntTp	[1..1]	ExternalCollateralMovementTypeCode	Provides information about the type collateral movement. 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 is ExternalCollateralMovementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Fornecer informações sobre o tipo de movimentação de garantia. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCollateralMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	

bvmf.114.01 – CollateralMovementReport

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

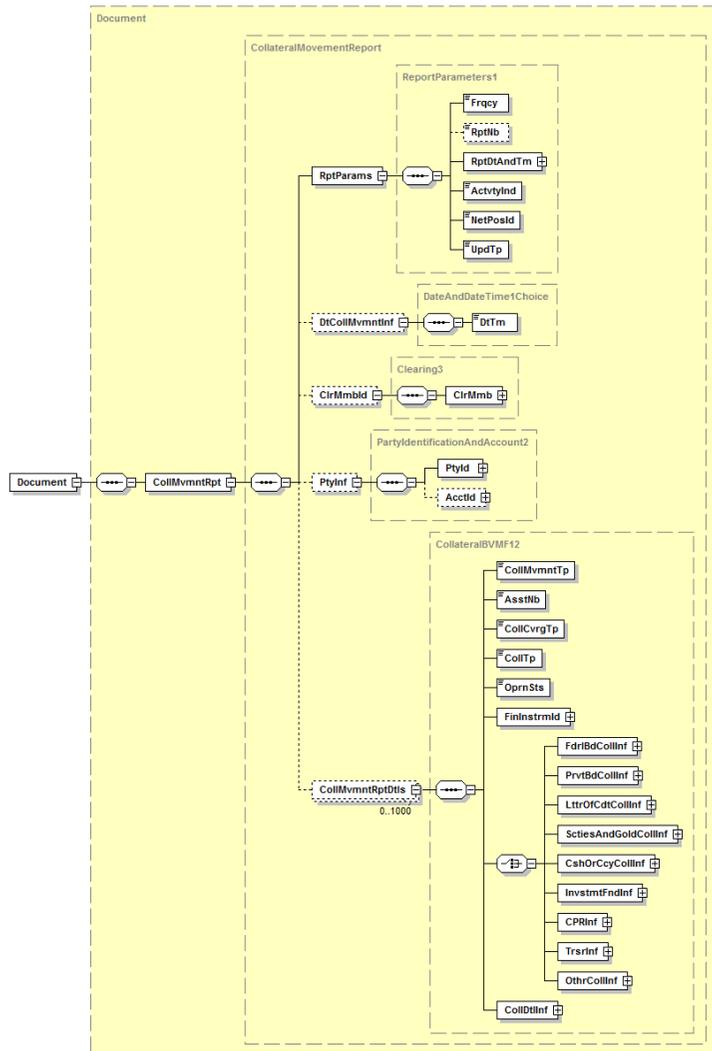
Mensagem de resposta a solicitação da mensagem bmf.113 enviada por um MCs, PNP, PL, contendo toda movimentação realizada no dia, até o momento da solicitação, conforme filtro solicitado.

Uso

Esta mensagem retorna informações sobre as garantias movimentadas até o momento da chegada da mensagem de solicitação bvmf.113, conforme filtros informados.

Esta mensagem é de uso exclusivo de participante da BM&FBovespa: membro de compensação, participante de negociação pleno e participante de liquidação.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – Sempre será retornada informações referente a movimentações do dia até o momento da requisição.

Regra 2 – sempre será retornada informações de operações rejeitadas ou viabilizadas.

Estrutura da mensagem “CollateralMovementReport” (bvmf.114.01)

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Provides the parameters of the report.	Este bloco possui as informações específicas da geração do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		DateCollateralMovementInformation	DtCollMvmntInf	[0..1]	+	Provides data and time the movement collateral.	Fornece a data e hora do movimento de garantias.	
2.1		DateTime	DtTm	[1..1]	ISODatetime	Numeric representation of time of the day and the day of the month and year.	Representação de data e hora no formato ISO.	
3.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmblId	[0..1]	+	This block identifies the clearing member.	Este bloco possui informações de identificação do membro de compensação.	

3.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
3.1.1		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.	
3.1.1.1		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.	
3.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: 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. 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 ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		PartyInformation	PtyInf	[0..1]	+	This block identifies the party (Trade Participant / Direct Participant identification).	Este bloco possui informações do participante (Participante do Negócio / Participante Direto).	
4.1		PartyIdentification	Ptyld	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
4.1.1		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		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: 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. 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 ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).
4.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.
4.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.
4.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.
4.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.
4.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
5.0		CollateralMovementReportDetails	CollMvmntRptDtls	[0..1000]	+	This block contains information about participant collateral movement.	Este bloco possui informações referentes a movimentação de garantias do participante (Participante do Negócio / Participante Direto).

5.1		CollateralMovementType	CollMvmntTp	[1..1]	ExternalCollateralMovementTypeCode	Provides information about the type collateral movement. 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 is ExternalCollateralMovementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Fornece informações sobre o tipo de movimentação de garantia. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCollateralMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.2		AssetNumber	AsstNb	[1..1]	Max35Text	A number that unambiguously identifies the collateral.	Fornece o número do registro do depósito.	
5.3		CollateralCoverageType	CollCvrgTp	[1..1]	ExternalCollateralCoverageTypeCode	Collateral coverage identification 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 is ExternalCollateralCoverageTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação da finalidade de cobertura da garantia. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCollateralCoverageTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.4		CollateralType	CollTp	[1..1]	ExternalCollateralTypeCode	Provides collateral type code. 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 is ExternalCollateralTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Fornece o tipo de garantia. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCollateralTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
5.5		OperationStatus	OprnSts	[1..1]	ExternalApprovalStatusCode	Provides operation status of collateral. 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 is ExternalApprovalStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Fornece informações sobre a situação final da operação de garantia. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalApprovalStatusCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
5.6		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides Financial Instrument Identification	Informação de identificação do instrumento financeiro.	

5.6.1		OtherIdentification	OthrlId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
5.6.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
5.6.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
5.6.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
5.6.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
5.6.2.1		MarketIdentifierCode	MktldrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
5.7	{OR	FederalBondCollateralInformation	FdrIBdCollInf	[1..1]	+	This block provides information about federal bond collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre os títulos privados federais deixados como garantia.	
5.7.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.	
5.7.2		SELICOperationCode	SELICOpnCd	[1..1]	Max6Text	Identification assigned to a SELIC Security	Número de operação de transferência no SELIC.	
5.7.3		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of federal bond collateral.	Fornecer a data de vencimento do título público federal deixado como garantia.	
5.7.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.7.4		AssignerAccount	AssgnrAcct	[1..1]	+	Provides assigner account identification.	Fornecer a identificação da conta cedente.	
5.7.4.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.7.4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.7.5		AssigneeAccount	AssgncAcct	[1..1]	+	Provides identification about assignee account.	Fornecer a identificação da conta cessionária.	

5.7.5.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.
5.7.5.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
5.8	OR	PrivateBondCollateralInformation	PrvtBdCollInf	[1..1]	+	Provides private bond collateral information.	Este bloco possui informações sobre os títulos privados (CDB) deixados como garantia.
5.8.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.
5.8.2		DepositoryType	DpstryTp	[1..1]	ExternalCollateralDepositoryTypeCode	Provides type of custodian. 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 is ExternalCollateralDepositoryTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Fornecer os tipos de custódia. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalDepositoryTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls
5.8.3		CETIPOperationCode	CETIPOprnCd	[1..1]	Max10Text	Identification assigned to a CETIP Security	Número de operação de transferência na CETIP.
5.8.4		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of private bond collateral.	Fornecer a data de vencimento do título público federal deixado como garantia.
5.8.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especificar uma data.
5.8.5		IssuerBank	IssrBk	[1..1]	+	This block provides information about issuer document of credit.	Este bloco fornece informações sobre o documento de identificação do emissor da fiança.
5.8.5.1		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.
5.8.5.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. CNPJ Number.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Número do CNPJ.
5.8.5.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g RECEITA FEDERAL This field should be filled with default value = 1.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: RECEITA FEDERAL. Este campo deve assumir o valor default = 1.
5.8.5.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CNPJ	Código do tipo de documento. Ex: CNPJ.

						This field should be filled with default value = 1.	Este campo deve ser preenchido com o valor default = 1.	
5.8.6		AssignerAccount	AssgnrAcct	[1..1]	+	Provides assigner account identification.	Fornece a identificação da conta cedente.	
5.8.6.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.8.6.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.8.7		AssigneeAccount	AssgneAcct	[1..1]	+	Provides identification about assignee account.	Fornece a identificação da conta cessionária.	
5.8.7.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.8.7.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.9	OR	LetterOfCreditCollateralInformation	LtrOfCdtCollnf	[1..1]	+	This block contains information regarding the letter of credit collateral.	Este bloco possui informações sobre a carta fiança deixada como garantia.	
5.9.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.	
5.9.2		IssuerBank	IssrBk	[1..1]	+	This block provides information about issuer document.	Este bloco possui informações do documento do emissor do ativo.	
5.9.2.1		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.	
5.9.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. CNPJ Number.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Número do CNPJ.	
5.9.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g RECEITA FEDERAL This field should be filled with default value = 1.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: RECEITA FEDERAL. Este campo deve assumir o valor default = 1.	
5.9.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CNPJ This field should be filled with default value = 1.	Código do tipo de documento. Ex: CNPJ. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 1.	
5.9.3		IssueDate	IsseDt	[1..1]	+	Provides issue date of collateral.	Fornece a data de emissão da carta fiança	

							deixada em garantia.	
5.9.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.9.4		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of collateral.	Fornece a data de vencimento da carta fiança deixada em garantia.	
5.9.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.10	OR	SecuritiesAndGoldCollateralInformation	SciesAndGoldCollnf	[1..1]	+	Provides securities and gold collateral information.	Este bloco possui informações sobre as ações e ouro deixados como garantia.	
5.10.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.	
5.10.2		CustodianInformation	CtdnInf	[1..1]	+	This block identifies the custodian and account identification.	Este bloco possui a identificação e a conta do custodiante.	
5.10.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
5.10.2.1.1		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.	
5.10.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. 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 ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: 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. 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 ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
5.10.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
5.10.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

5.10.2.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.
5.10.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.
5.10.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta
5.10.3		SubAccountOrigin	SubAcctOrgn	[1..1]	Max5Text	Identification of the origin sub account.	Identificação da carteira na origem.
5.10.4		SubAccountDestination	SubAcctDstn	[1..1]	Max5Text	Identification of the destination sub account.	Identificação da carteira no destino.
5.10.5		SystemMovementNumber	SysMvmntNb	[1..1]	int	Provides the movement number of custody system.	Fornece o número do movimento no sistema de custódia.
5.11	OR	CashOrCurrencyCollateralInformation	CshOrCcyCollnfnf	[1..1]	+	Provides information cash collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre os valores monetários deixados como garantia.
5.11.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.
5.11.2		ExecutedMovementType	ExctdMvmntTp	[1..1]	ExternalCollateralExecutedMovementTypeCode	Middle in which was executed the movement type of withdrawal or deposit. 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 is ExternalCollateralExecutedMovementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Meio em que foi efetuado o tipo de movimentação de retirada ou depósito. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCollateralExecutedMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls
5.12	OR	InvestmentFundInformation	InvstmtFndInf	[1..1]	+	This block provides information about funds collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre os fundos de investimento deixados como garantia.
5.12.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.

5.12.2		ExecutedMovementType	ExctdMvmntTp	[1..1]	ExternalCollateralExecutedMovementTypeCode	Middle in which was executed the movement type of withdrawal or deposit. 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 is ExternalCollateralExecutedMovementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Meio em que foi efetuado o tipo de movimentação de retirada ou depósito. 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 BVMF. Neste caso, o externo é ExternalCollateralExecutedMovementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.13	OR	CPRInformation	CPRInf	[1..1]	+	This block provides information about CPR collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre os CPRs deixados como garantia.	
5.13.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.	
5.13.2		CPRTYPE	CPRTp	[1..1]	ExternalCollateralCPRTYPECode	Provides CPR type information. 1 - Física, 2 - Preço Fixo, 3 - Ajuste Futuro BVMF	Fornece os tipos de CPR: 1 - Física, 2 - Preço Fixo, 3 - Ajuste Futuro BVMF	
5.13.3		IssueDate	IsseDt	[1..1]	+	Provides issue date of CPR bond collateral.	Fornece a data de emissão do título CPR deixado como garantia.	
5.13.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.13.4		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of CPR bond collateral.	Fornece a data de vencimento do título CPR deixado como garantia.	
5.13.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.14	OR	TreasuryInformation	TrsrInf	[1..1]	+	This block provides information about Treasuries collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre ativo treasury deixado como garantia.	
5.14.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.	
5.14.2		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of Treasury collateral.	Fornece a data de vencimento do título Treasury deixado como garantia.	
5.14.2.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.15	OR}	OtherCollateralInformation	OthrCollInf	[1..1]	+	This block provides information about others collateral valuation.	Este bloco possui informações sobre outros ativos deixados como garantia.	
5.15.1		CollateralReference	CollRef	[1..1]	Max35Text	Reference of the piece of valued collateral.	Identifica cada item da garantia avaliada.	
5.15.2		CollateralDetail	CollDtl	[1..1]	Max35Text	Provides details of collateral.	Fornece detalhes da garantia.	
5.15.3		MaturityDate	MtrtyDt	[1..1]	+	Provides maturity date of collateral.	Fornece a data de vencimento do ativo deixado em garantia.	
5.15.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
5.16		CollateralDetailInformation	CollDtlInf	[1..1]	+	This block provides summary information about the collateral.	Este bloco fornece informações sobre valores e quantidades das garantias.	
5.16.1		OperationValue	OprnVal	[0..1]	ActiveOrHistoricCurrencyA	Initial value of a transaction.	Valor inicial de uma operação de garantia informado pelo participante.	

					nd13Decimal Amount			
5.16.2		OperationAcceptValue	OprnAccptVal	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13Decimal Amount	Value accept in the transaction.	Valor de uma operação de garantias aceito pela Clearing.	
5.16.3		OperationQuantity	OprnQty	[0..1]	+	Initial quantity of a transaction.	Quantidade inicial de uma operação de garantia informada pelo participante.	
5.16.3.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
5.16.4		OperationAcceptQuantity	OprnAccptQty	[0..1]	+	Quantity accepts in the transaction.	Quantidade de uma operação de garantias aceita pela Clearing.	
5.16.4.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	