



25 de março de 2004
005/2004-DIM

COMUNICADO EXTERNO

Vendors

Ref.: **Manual do Sistema de Difusão de Informações ao Mercado –
Versão 8.3.**

Prezado Vendor,

Atendendo a solicitações do mercado, enviamos anexo o Manual do Sistema de Difusão de Informações ao Mercado. A versão 8.3 inclui o preço de exercício das opções no subitem a.7.

Informações adicionais poderão ser obtidas com a Divisão de Sinal (Sandra Ribeiro, +11-3119-2327, sandralr@bmf.com.br; Mario Palhares, +11-3119-2357, mrpalhares@bmf.com.br; e Juliana Takase, +11-3119-2358, jtakase@bmf.com.br).

Atenciosamente,



Noeno Spinola
Diretor de Imprensa e Mídia

Bolsa de Mercadorias & Futuros

Praça Antonio Prado, 48 - Telefone: 3119-2000 - CEP 01010-901 - São Paulo - SP
Caixa Postal, 4275 - São Paulo - Capital - CEP 01061-970



Anexo ao Comunicado Externo 005/2004-DIM

**SISTEMA DE DIFUSÃO DE INFORMAÇÕES AO MERCADO –
VERSÃO 8.3.**

Os sinais BM&F, difundidos via Sistema de Difusão de Informações ao Mercado, constituem um conjunto de mensagens emitidas eletronicamente, contendo cotações apregoadas e informações consolidadas sobre as operações registradas nos sistemas de pregão – viva voz e eletrônico Global Trading System (GTS) –, além de informações da Clearing de Câmbio BM&F, da Clearing de Ativos BM&F e da Bolsa Brasileira de Mercadorias.

As mensagens são transmitidas da maneira discriminada a seguir.

a) Derivativos

a.1) Sinal de Cotações

O sinal de cotações é obtido via rodas de operadores no pregão de viva voz e via GTS, captando em tempo real todo o andamento das operações. Esse sinal comporta informações de eventos, principalmente ofertas e negócios, ocorridos no pregão de viva voz (campo "origem" contendo "01") e no GTS (campo "origem" contendo "05"), permitindo a identificação exata do canal de negociação utilizado. Esse sinal também inclui informações de ofertas e negócios ocorridos em ambos os sistemas de negociação (campo "origem" contendo "02"), possibilitando aos usuários acompanhar o mercado a partir de uma única origem. Durante a sessão *after-hours*, o campo "data de referência" contém a data do próximo pregão (D+1).

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---------------------|---------|------|--------|-----|--|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0066 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "01" - Pregão de viva voz "02" - Mercados BM&F "05" - Global Trading System |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "A" - Abertura "N" - Negócio fechado "D" - Negócio direto fechado "U" - Correção do preço do último negócio "C" - Oferta de compra "V" - Oferta de venda "X" - Correção de preço máximo "I" - Correção de preço mínimo "T" - Cancelamento de negócio |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------|---------|------|--------|-----|---|
| Mercadoria | Char. | 3 | 4 | 6 | |
| | | | | | "DIS" - Disponível "FUT" - Futuro "OPD" - Opções sobre disponível "OPF" - Opções sobre futuro "TMO" - Termo |
| Mercado | Char. | 3 | 7 | 9 | |
| Vencimento | Char. | 4 | 10 | 13 | Ver subitem "a.3" (descrição do campo vencimento) |
| Preço | Numeric | 8 | 14 | 21 | |
| Qtd. de casas decimais | Numeric | 2 | 22 | 23 | |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 24 | 29 | HHMMSS |
| Tendência | Char. | 1 | 30 | 30 | "=" / "+" / "-" / " " |
| Cód. de negociação | Char. | 20 | 31 | 50 | Ver item "a.4" (descrição do código de negociação - padrão internacional) |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 51 | 58 | AAAAMMDD |
| Data pregão | Numeric | 8 | 59 | 66 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

a.2) Sinal de Totais dos Contratos

Nesse sinal, as informações sobre os totais dos contratos registrados são enviadas:

- a cada minuto, contendo informações dos respectivos contratos negociados e efetivamente registrados no sistema; e
- em intervalos regulares, contendo um bloco de informações sobre os contratos negociados, com pelo menos um negócio desde o início do pregão, de modo que o usuário possa entrar em fase com o andamento normal das negociações, a qualquer tempo.

Esse sinal comporta informações referentes ao resumo dos negócios registrados no pregão de viva voz, no GTS e em ambos (mercados BM&F).

Na sessão *after-hours*, são criadas mensagens em que o campo "tipo" contém "H" ("resumo do mercado D+1 – *after-hours*") e o campo "data de referência" contém a data do dia seguinte (D+1), apresentando o resumo dos negócios registrados nesse período. As mensagens com o campo "tipo" contendo "R" geradas na abertura do dia seguinte acumulam as informações da sessão *after-hours* do dia anterior.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|------------------------------------|---------|------|--------|-----|--|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0371 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "01" - Pregão de viva voz "02" - Mercados BM&F "05" - Global Trading System |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "R" - Resumo do mercado D+0 "H" - Resumo do mercado D+1 - <i>after-hours</i> |
| Seqüência | Numeric | 6 | 4 | 9 | |
| Mercadoria | Char. | 3 | 10 | 12 | |
| Mercado | Char. | 3 | 13 | 15 | "DIS" - Disponível "FUT" - Futuro "OPD" - Opções sobre disponível "OPF" - Opções sobre futuro "TMO" - Termo |
| Vencimento | Char. | 4 | 16 | 19 | Ver subitem "a.3" (descrição do campo vencimento) |
| Reservado | Char. | 1 | 20 | 20 | |
| Qtd. de negócios realizados | Numeric | 5 | 21 | 25 | |
| Qtd. de contratos negociados | Numeric | 7 | 26 | 32 | |
| Qtd. de contratos em aberto | Numeric | 7 | 33 | 39 | |
| Cotação do primeiro negócio | Numeric | 10 | 40 | 49 | |
| Menor cotação negociada | Numeric | 10 | 50 | 59 | |
| Maior cotação negociada | Numeric | 10 | 60 | 69 | |
| Cotação média do dia | Numeric | 10 | 70 | 79 | |
| Ajuste (FUT) do dia atual | Numeric | 14 | 80 | 93 | |
| Ajuste (FUT) do dia anterior | Numeric | 14 | 94 | 107 | |
| Preço de exercício | Numeric | 10 | 108 | 117 | |
| Hora de registro do último negócio | Numeric | 6 | 118 | 123 | |
| Cotação do último negócio | Numeric | 10 | 124 | 133 | |
| Qtd. de contratos - último negócio | Numeric | 5 | 134 | 138 | |
| Cotação da oferta de compra | Numeric | 10 | 139 | 148 | |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---|---------|------|--------|-----|---|
| Qtd. da oferta de compra | Numeric | 5 | 149 | 153 | |
| Cotação da oferta de venda | Numeric | 10 | 154 | 163 | |
| Qtd. da oferta de venda | Numeric | 5 | 164 | 168 | |
| Qtd. de contratos exercidos | Numeric | 7 | 169 | 175 | |
| Volume de exercício | Numeric | 17 | 176 | 192 | |
| Volume de negócios | Numeric | 17 | 193 | 209 | |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 4 | 210 | 213 | |
| Casas decimais dos campos "cotação" e "preço exercício" | Numeric | 2 | 214 | 215 | |
| Status do ajuste atual | Char. | 1 | 216 | 216 | "S" - Ajuste definitivo |
| Status do ajuste anterior | Char. | 1 | 217 | 217 | "A" - Ajuste anterior corrigido (só mercados DI1 e DDI) |
| Casas decimais dos campos "ajuste" | Numeric | 2 | 218 | 219 | |
| Casas decimais dos campos "volume" | Numeric | 2 | 220 | 221 | |
| Data de vencimento do contrato | Numeric | 8 | 222 | 229 | AAAAMMDD |
| Cotação do último negócio - pregão anterior | Numeric | 14 | 230 | 243 | |
| Ajuste atual em taxa | Char. | 14 | 244 | 257 | |
| Ajuste anterior em taxa | Char. | 14 | 258 | 271 | |
| Número de saques até data de vencimento | Numeric | 4 | 272 | 275 | |
| Número de dias úteis até data de vencimento | Numeric | 4 | 276 | 279 | |
| Número de dias corridos até data de vencimento | Numeric | 4 | 280 | 283 | |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------------|---------|------|--------|-----|--|
| Cód. de negociação no viva voz | Char. | 20 | 284 | 303 | Ver subitem "a.4" (descrição do código de negociação - padrão internacional) |
| Cód. de negociação no GTS | Char. | 20 | 304 | 323 | Ver subitem "a.4" (descrição do código de negociação - padrão internacional) |
| Data da criação do sinal | Numeric | 8 | 324 | 331 | AAAAMMDD |
| Data pregão | Numeric | 8 | 332 | 339 | AAAAMMDD |
| Limite mínimo de preço | Numeric | 10 | 340 | 349 | |
| Limite máximo de preço | Numeric | 10 | 350 | 359 | |
| Código ISIN | Char. | 12 | 360 | 371 | Identificação internacional de ativos |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

a.3) Descrição do Campo Vencimento

a.3.1) Mercado Futuro (FUT) = Vencimento

| Código | Descrição |
|--------|-----------|
| JANx | Janeiro |
| FEVx | Fevereiro |
| MARx | Março |
| ABRx | Abril |
| MAIx | Maio |
| JUNx | Junho |
| JULx | Julho |
| AGOx | Agosto |
| SETx | Setembro |
| OUTx | Outubro |
| NOVx | Novembro |
| DEZx | Dezembro |

x = último número do ano de vencimento.

Exemplo: x = 3, ano 2003

x = 4, ano 2004

x = 5, ano 2005

Obs.: no caso dos contratos de FRP, o campo é preenchido com FRP0 ou FRP1.

a.3.2) Mercado de Opções (OPD/OPF) = Série

| Código | Descrição |
|--------|-----------|
| JAxx | Janeiro |
| FExx | Fevereiro |
| MRxx | Março |
| ABxx | Abril |
| MAxx | Maio |
| JNxx | Junho |
| JLxx | Julho |

| Código | Descrição |
|--------|-----------|
| AGxx | Agosto |
| STxx | Setembro |
| OTxx | Outubro |
| NVxx | Novembro |
| DZxx | Dezembro |

xx = série: OPD = 01 a 25 (opção de compra sobre disponível)
 = 26 a 50 (opção de venda sobre disponível)
 OPF = 51 a 75 (opção de compra sobre futuro)
 = 76 a 99 (opção de venda sobre futuro)

a.3.3) Mercado a Termo (TMO) = Prazo (em Dias)

- Para termo de ouro: xxxx = de 0001 a 0180
- Para SCC, SC2, and SC3: MAxx, onde:
 M = mês de vencimento, segundo a tabela abaixo;
 A = último dígito do ano de vencimento;
 Xx = dia do vencimento.

Tabela de código dos meses:

| Código | Descrição |
|--------|-----------|
| F | Janeiro |
| G | Fevereiro |
| H | Março |
| J | Abril |
| K | Maio |
| M | Junho |
| N | Julho |
| Q | Agosto |
| U | Setembro |
| V | Outubro |
| X | Novembro |
| Z | Dezembro |

a.4) Descrição do Código de Negociação – Padrão Internacional

Códigos de negociação adotados pelo GTS, visando sua adequação aos padrões internacionais:

| Mercado | Formação |
|---|-----------------|
| Futuro | CCCMAV |
| Opções | CCCMAOSSSSSV |
| Disponível | CCCLV |
| Termo | CCCPVV |
| SCC, SC2 e SC3 | CCCMADDV |
| Opções de D11, D12, D13, VF1, VF2 e VF3 | CCCMAOSSSSSV |

(Obs.: no caso dos contratos de FRP, o campo é preenchido com FRP0 ou FRP1.)

Onde:

| Campo | Descrição |
|--------------|--|
| CCC | Código da mercadoria |
| M | Mnemônico do mês, segundo a tabela abaixo |
| A ou AA | Último dígito do ano ou 2 últimos dígitos do ano |
| SSSSS | Preço de exercício |
| ou SSSSS | |
| O | Opções: valor "C" para <i>call</i> e "P" para <i>put</i> |
| PPPP | Prazo em dias do termo |
| L | Mercado disponível |
| DD | Dia de vencimento do termo |
| V | Quando o instrumento é negociado no viva voz |

Tabela de código dos meses:

| Código | Descrição |
|---------------|------------------|
| F | Janeiro |
| G | Fevereiro |
| H | Março |
| J | Abril |
| K | Maio |
| M | Junho |
| N | Julho |
| Q | Agosto |
| U | Setembro |
| V | Outubro |
| X | Novembro |
| Z | Dezembro |

a.5) Taxas Médias de Swaps

O sinal taxas médias de swaps divulga a média apurada com base nas cotações das operações de swap. Ele é transmitido ao final do dia, logo depois de as cotações serem introduzidas no sistema.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------------|---------|------|--------|-----|--------------------------------------|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0100 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "02" - Mercados BM&F |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "E" - Taxas de swap |
| Subtipo | Char. | 1 | 4 | 4 | "T" |
| Suborigem | Numeric | 2 | 5 | 6 | "06" |
| Seqüência | Numeric | 6 | 7 | 12 | |
| Data de referência da taxa | Numeric | 8 | 13 | 20 | AAAAMMDD |
| Nome da taxa | Char. | 15 | 21 | 35 | |
| Prazo em dias corridos | Numeric | 5 | 36 | 40 | |
| Prazo em saques | Numeric | 5 | 41 | 45 | |
| Valor da taxa | Numeric | 15 | 46 | 60 | Valor*(10**qtd. de casas decimais) |
| Qtd. de casas decimais da taxa | Numeric | 2 | 61 | 62 | |
| Reservado | Char. | 38 | 63 | 100 | |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

a.6) Sinal de Indicadores

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---------------------------------|---------|------|--------|-----|--------------------------------------|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0103 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "02" |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "S" |
| Seqüência | Numeric | 6 | 4 | 9 | |
| Data de referência do indicador | Numeric | 8 | 10 | 17 | AAAAMMDD |
| Grupo do indicador | Char. | 2 | 18 | 19 | |
| Nome do indicador | Char. | 25 | 20 | 44 | |
| Valor do indicador | Numeric | 25 | 45 | 69 | Valor*(10**qtd. casas decimais) |
| Qtd. de casas decimais | Numeric | 2 | 70 | 71 | |
| Reservado | Char. | 32 | 72 | 103 | |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

a.7) Séries Abertas no Call de Estratégia de Volatilidade

A BM&F publica os deltas das estratégias de volatilidade durante o *call*.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------------|---------|------|--------|-----|--|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho Mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0152 (Exceto STX / Tamanho / ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "02" - Mercados BM&F |
| Tipo | Char | 1 | 3 | 3 | "Z" - Séries Abertas no Call de Estratégias |
| Mercadoria | Char | 3 | 4 | 6 | |
| Mercado | Char | 3 | 7 | 9 | "DIS" - Mercado Disponível "FUT" - Mercado Futuro "OPD" - Opções sobre Disponível "OPF" - Opções sobre Futuro "TMO" - Mercado a Termo |
| Vencimento | Char | 4 | 10 | 13 | Ver subitem "a.3" (descrição do campo vencimento) |
| Data de Vencimento do Contrato | Numeric | 8 | 14 | 21 | AAAAMMDD |
| Preço de Exercício | Numeric | 15 | 22 | 36 | |
| Hora Inicial | Numeric | 4 | 37 | 40 | HHMM |
| Valor do Futuro Longo | Numeric | 16 | 41 | 56 | |
| Valor do Futuro | Numeric | 16 | 57 | 72 | |
| Número de Decimais do Contrato | Numeric | 2 | 73 | 74 | |
| Valor do Delta | Numeric | 20 | 75 | 94 | |
| Número de Decimais do Delta | Numeric | 2 | 95 | 96 | |
| Data de Criação do Sinal | Numeric | 8 | 97 | 104 | AAAAMMDD |
| Data de Referência | Numeric | 8 | 105 | 112 | AAAAMMDD |
| Cód. de negociação no viva voz | Char | 20 | 113 | 132 | Ver subitem "a.4" (descrição do código de negociação - padrão internacional) |
| Cód. de negociação no GTS | Char | 20 | 133 | 152 | Ver subitem "a.4" (descrição do código de negociação - padrão internacional) |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

b) BM&F News

A BM&F transmite sinal com notícias e/ou comunicados relevantes ao mercado.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|-----------------------------|---------|------|--------|-----|--|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | No máx. 273 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "10" - Notícias BM&F |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "N" - Notícias |
| Data de criação da mensagem | Numeric | 8 | 4 | 11 | AAAAMMDD |
| Reservado | Char | 3 | 12 | 14 | |
| Identificação da notícia | Numeric | 6 | 15 | 20 | Número de identificação seqüencial (pode ser enviada várias vezes ao dia) |
| Idioma | Char. | 2 | 21 | 22 | |
| Seqüência | Numeric | 4 | 23 | 26 | Uma notícia pode ser dividida em várias mensagens, em que a seqüência "01" traz a manchete |
| Tipo de divulgação | Numeric | 1 | 27 | 27 | "1" - Obrigatória e imediata "2" - Obrigatória no dia "3" - Facultativa e válida no dia |
| Indicador de continuação | Char. | 1 | 28 | 28 | "C" - Mais mensagens comporão a notícia "F" - Última linha da notícia |
| Texto | Char. | 245 | 29 | 273 | Variável de 1 a 245 |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

c) Clearing de Câmbio BM&F

A Clearing de Câmbio BM&F fornece aos *vendors* informações atualizadas (on-line) sobre as operações de câmbio registradas, contratadas, compensadas e liquidadas por seu intermédio.

c.1) Sinal de Intervalo de Flutuação

Informa o intervalo de oscilação das taxas de câmbio, conforme o registro de operações na Clearing de Câmbio.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---------------------|---------|------|--------|-----|--------------------------------------|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0095 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "30" - Câmbio |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "F" - Flutuação |
| Código da moeda | Char. | 3 | 4 | 6 | Código da moeda (padrão ISO) |
| Data de liquidação | Char. | 8 | 7 | 14 | AAAAMMDD |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------|---------|------|--------|-----|---|
| Taxa média | Numeric | 19 | 15 | 33 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Taxa máxima | Numeric | 19 | 34 | 52 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Taxa mínima | Numeric | 19 | 53 | 71 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Qtd. de casas decimais | Numeric | 2 | 72 | 73 | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 74 | 81 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 82 | 87 | HHMMSS |
| Data pregão | Numeric | 8 | 88 | 95 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

c.2) Sinal de Taxa de Câmbio de Operações Contratadas

Permite o acompanhamento da evolução da taxa efetivamente praticada nas operações contratadas de câmbio.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------|---------|------|--------|-----|---|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0114 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "30" - Câmbio |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "T" - Taxa de câmbio |
| Código da moeda | Char. | 3 | 4 | 6 | Código da moeda (padrão ISO) |
| Data de liquidação | Char. | 8 | 7 | 14 | AAAAMMDD |
| Última taxa | Numeric | 19 | 15 | 33 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Maior taxa | Numeric | 19 | 34 | 52 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Menor taxa | Numeric | 19 | 53 | 71 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Taxa média | Numeric | 19 | 72 | 90 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Qtd. de casas decimais | Numeric | 2 | 91 | 92 | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 93 | 100 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 101 | 106 | HHMMSS |
| Data pregão | Numeric | 8 | 107 | 114 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

c.3) Sinal de Volume Total Negociado

Informa o volume total negociado em moeda nacional e estrangeira e a quantidade de negócios contratados.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------------------|---------|------|--------|-----|---|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0082 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "30" - Câmbio |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "N" - Volume negociado |
| Código da moeda | Char. | 3 | 4 | 6 | Código da moeda (padrão ISO) |
| Data de liquidação | Char. | 8 | 7 | 14 | AAAAMMDD |
| Valor negociado em moeda nacional | Numeric | 19 | 15 | 33 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Valor negociado em moeda estrangeira | Numeric | 19 | 34 | 52 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Qtd. de negócios | Numeric | 6 | 53 | 58 | |
| Qtd. de casas decimais | Numeric | 2 | 59 | 60 | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 61 | 68 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 69 | 74 | HHMMSS |
| Data Pregão | Numeric | 8 | 75 | 82 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

c.4) Sinal de Volume Total Compensado

Informa o volume total compensado (*netting*) em moeda nacional e estrangeira e a quantidade de negócios contratados.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---------------------------------------|---------|------|--------|-----|---|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0082 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "30" - Câmbio |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "C" - Volume compensado |
| Código da moeda | Char. | 3 | 4 | 6 | Código da moeda (padrão ISO) |
| Data de liquidação | Char. | 8 | 7 | 14 | AAAAMMDD |
| Valor compensado em moeda nacional | Numeric | 19 | 15 | 33 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Valor compensado em moeda estrangeira | Numeric | 19 | 34 | 52 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Qtd. de negócios | Numeric | 6 | 53 | 58 | |
| Qtd. de casas decimais | Numeric | 2 | 59 | 60 | |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------|---------|------|--------|-----|-------------|
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 61 | 68 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 69 | 74 | HHMMSS |
| Data pregão | Numeric | 8 | 75 | 82 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

c.5) Sinal de Total de Garantias – Analítico

Divulga o volume de garantias do Fundo de Participação e de garantias operacionais depositadas na Clearing de Câmbio BM&F, segregadas por tipo de ativo. Todos os valores são expressos em reais.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------------------|---------|------|--------|-----|--|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0118 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "30" - Câmbio |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "G" - Total de garantias - analítico |
| Identificação da finalidade | Numeric | 5 | 4 | 8 | "0" - Soma de "1" e "4" "1" - Garantias operacionais "4" - Fundo de Participação |
| Tipo de ativo | Numeric | 2 | 9 | 10 | "4" - Título público "5" - Moeda estrangeira |
| Código da moeda do tipo de ativo | Char. | 3 | 11 | 13 | Padrão ISO |
| Indicador de correção | Char. | 17 | 14 | 30 | |
| Descrição do indicador de correção | Char. | 10 | 31 | 40 | |
| Código da moeda do valor do ativo | Char. | 5 | 41 | 45 | Padrão ISO |
| Valor total do indicador de correção | Numeric | 19 | 46 | 64 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Percentual | Numeric | 5 | 65 | 69 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Valor total de garantias | Numeric | 19 | 70 | 88 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Qtd. de casas decimais | Numeric | 2 | 89 | 90 | |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---------------------------------|---------|------|--------|-----|---|
| Número de seqüência da mensagem | Numeric | 3 | 91 | 93 | Identificação da mensagem dentro do bloco de sinais |
| Quantidade de mensagens | Numeric | 3 | 94 | 96 | Quantidade de mensagens do bloco |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 97 | 104 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 105 | 110 | HHMMSS |
| Data pregão | Numeric | 8 | 111 | 118 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

c.6) Sinal de Vinculação de Garantias

Divulga a vinculação de garantias operacionais, ou seja, o percentual das garantias operacionais depositadas na Clearing de Câmbio que está vinculado às operações registradas e o percentual disponível para novos registros.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--|---------|------|--------|-----|---|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0102 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "30" - Câmbio |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "U" - Utilização de garantias |
| Identificação da finalidade | Numeric | 5 | 4 | 8 | "0" - Soma "1" e "4" "1" - Garantias operacionais "4" - Fundo de Participação |
| Código da moeda do valor vinculado e não vinculado | Char. | 3 | 9 | 11 | Padrão ISO |
| Valor total vinculado | Numeric | 19 | 12 | 30 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Percentual vinculado | Numeric | 5 | 31 | 35 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Valor total não vinculado | Numeric | 19 | 36 | 54 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Percentual não vinculado | Numeric | 5 | 55 | 59 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Valor total de garantias | Numeric | 19 | 60 | 78 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Qtd. de casas decimais | Numeric | 2 | 79 | 80 | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 81 | 88 | AAAAMMDD |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------|---------|------|--------|-----|-------------|
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 89 | 94 | HHMMSS |
| Data pregão | Numeric | 8 | 95 | 102 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

d) Bolsa Brasileira de Mercadorias – Pregão Dinâmico

Esse sinal fornece dados sobre negócios realizados nos sistemas da Bolsa Brasileira de Mercadorias. O sinal traz informações sobre o lote negociado, assim como ofertas de compra e venda. É também divulgada a relação de Cédulas de Produto Rural (CPRs) que compõem o lote disponível para negociação ou já negociado. Caso a quantidade de CPRs por lote seja muito grande, a descrição das CPRs não é enviada, mas pode ser obtida no site da Bolsa Brasileira de Mercadorias – www.bbmnet.com.br. A quantidade máxima de CPRs a ser divulgada no sinal é informada periodicamente pela Bolsa Brasileira de Mercadorias e pela BM&F.

d.1) Sinal de Cotações

As mensagens de cotações exibem os eventos ocorridos no ambiente de negociação do pregão dinâmico da Bolsa Brasileira de Mercadorias.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|----------------------|---------|------|--------|-----|--|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0143 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem da mensagem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "15" – Bolsa Brasileira de Mercadorias - pregão dinâmico |
| | | | | | "E" - Exposição "O" - Cancelamento de exposição "V" - Oferta de venda "C" - Melhor oferta de compra "P" - Cancelamento de oferta de venda "Z" - Cancelamento de oferta de compra "N" - Negócio realizado "A" - Abertura da negociação "F" - Fechamento da negociação |
| Tipo de mensagem | Char. | 1 | 3 | 3 | |
| Número de referência | Char. | 28 | 4 | 31 | Código de identificação do lote |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------|---------|------|--------|-----|---|
| Tipo de título | Numeric | 3 | 32 | 34 | "001" - CPR |
| Modalidade | Numeric | 1 | 35 | 35 | "1" - Produto "2" - Financeira - preço fixo "3" - Financeira - índice Esalq "4" - Financeira - preço de ajuste do contrato futuro (BM&F) "5" - Exportação |
| Índice | Numeric | 3 | 36 | 38 | "001" - Esalq |
| Código do produto | Numeric | 3 | 39 | 41 | |
| Descrição do produto | Char. | 50 | 42 | 91 | |
| Data de vencimento | Numeric | 8 | 92 | 99 | AAAAMMDD |
| Cotação | Numeric | 15 | 100 | 114 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Qtd. de casas decimais | Numeric | 2 | 115 | 116 | |
| Lote com detalhe | Char. | 1 | 117 | 117 | "S" - Descrição dos títulos do lote seguirão a mensagem "N" - Lote sem descrição dos títulos |
| Qtd. de títulos no lote | Numeric | 4 | 118 | 121 | Total de títulos no lote, caso campo "lote com detalhe" tenha sido preenchido |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 122 | 129 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 130 | 135 | HHMMSS |
| Data Pregão | Numeric | 8 | 136 | 143 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

d.2) Sinal de Descrição de Título

Caso o campo "lote com detalhe" venha preenchido com "S", o sinal de cotações será sucedido por uma série de mensagens de descrição de títulos (o número total de mensagens de descrição de título é o mesmo que a "quantidade de títulos no lote" do sinal de cotações). O campo "número de referência" denota o lote a que o título pertence.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---------------------|---------|------|--------|-----|-------------------------------|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0303 (exceto STX/tamanho/ETX) |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|-------------------------------|---------|------|--------|-----|--|
| Origem da mensagem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "15" - Bolsa Brasileira de Mercadorias - pregão dinâmico |
| Tipo de mensagem | Char. | 1 | 3 | 3 | "T" - Descrição de título |
| Número de referência | Numeric | 28 | 4 | 31 | Código de identificação do lote |
| Padrão | Char. | 50 | 32 | 81 | Descrição do padrão do título |
| Safra | Numeric | 8 | 82 | 89 | AAAAMMDD |
| Quantidade | Numeric | 12 | 90 | 101 | |
| Unidade de oferta | Char. | 50 | 102 | 151 | Descrição da unidade de oferta |
| Valor do resgate | Numeric | 15 | 152 | 166 | Ver qtd. de casas decimais na primeira coluna |
| Mês/ano do contrato futuro | Char. | 6 | 167 | 172 | |
| Título com/sem garantia | Numeric | 1 | 173 | 173 | "S" - Com garantia "N" - Sem garantia |
| Garantidor | Char. | 50 | 174 | 223 | CPF/CNPJ/nome do garantidor |
| UF de produção | Char. | 2 | 224 | 225 | UF do estado |
| Local de entrega | Char. | 50 | 226 | 275 | Local de entrega do título |
| Qtd. de casas decimais | Numeric | 2 | 276 | 277 | |
| Número de seqüência do título | Numeric | 4 | 278 | 281 | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 282 | 289 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 290 | 295 | HHMMSS |
| Data Pregão | Numeric | 8 | 296 | 303 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

e) Clearing de Ativos BM&F

A Clearing de Ativos BM&F divulga aos *vendors* informações atualizadas sobre ofertas e negócios efetuados no SISBEX, bem como os volumes financeiros liquidados por intermédio de seus sistemas.

e.1) TCAT – Taxa Média das Operações de Financiamento de Títulos Públicos Federais

Taxa média ponderada das operações efetuadas na modalidade compromissada (específica e genérica), para o prazo D+0/D+1, calculada a cada negócio aceito pela Clearing.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--|---------|------|--------|-----|---|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0046 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "20" - Clearing de Ativos |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "M" - Taxa média da Clearing de Ativos |
| Taxa média | Numeric | 19 | 4 | 22 | |
| Quantidade de casas dec. da taxa média | Numeric | 2 | | | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 25 | 32 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 33 | 38 | HHMMSS |
| Data de referência | Numeric | 8 | 39 | 46 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

e.2) Volume Negociado por Modalidade Operacional

Apuração dos totais de volume negociados em cada uma das modalidades operacionais da Clearing de Ativos, com divulgação na frequência determinada pela BM&F.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|----------------------|---------|------|--------|-----|--|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0061 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "20" - Clearing de Ativos |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "V" - Volume negociado por modalidade |
| Código da modalidade | Numeric | 3 | 4 | 6 | Ver a tabela que segue |
| | | | | | Dias úteis das operações consideradas na apuração do volume fin. neg. conforme a modalidade: definitiva a termo (modal. = 004) → menor prazo para liq. da op. compromissada (001-gen./002-espec.) → prazo de ida da compromissada: "000" - ida em D+0; "999" - ida > D+0 demais modalidades: "000" |
| Prazo inicial | Numeric | 3 | 7 | 9 | |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---|---------|------|--------|-----|--|
| | | | | | Dias úteis das operações consideradas na apuração do volume financeiro negociado conforme a modalidade: definitiva a termo (modalidade = 004) → maior prazo para liquidação da operação compromissada (001-genérica/002-específica) → prazo de volta da operação compromissada: "001" - volta em D+1; "999" - volta > D+1 demais modalidades: "000" |
| Prazo final | Numeric | 3 | 10 | 12 | |
| Volume financeiro negociado | Numeric | 19 | 13 | 31 | |
| Quantidade de casas decimais do volume financeiro negociado | Numeric | 2 | 32 | 33 | |
| Quantidade de negócios | Numeric | 6 | 34 | 39 | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 40 | 47 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 48 | 53 | HHMMSS |
| Data de referência da Clearing | Numeric | 8 | 54 | 61 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

| Campo da Modalidade | Descrição |
|---------------------|----------------------------|
| 001 | Compromissadas genéricas |
| 002 | Compromissadas específicas |
| 003 | Definitivas a vista |
| 004 | Definitivas a termo |
| 006 | SET – Empréstimos |
| 007 | SET – Trocas |
| 008 | Termo de leilão |

Obs.: novos códigos de modalidade e suas descrições serão enviadas formalmente aos *vendors*.

e.3) Volume Negociado por Título e por Modalidade Operacional

Apuração dos totais de volume negociados em cada um dos títulos aceitos pela Clearing de Ativos BM&F, segmentados por modalidade operacional, com divulgação na frequência determinada pela BM&F.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--|---------|------|--------|-----|---|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0090 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "20" - Clearing de Ativos |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "T" - Volume negociado por título e modalidade |
| Código SELIC do título | Numeric | 6 | 4 | 9 | |
| Data de vencimento do título | Numeric | 8 | 10 | 17 | AAAAMMDD |
| Código da modalidade | Numeric | 3 | 18 | 20 | Ver tabela que segue |
| Prazo inicial | Numeric | 3 | 21 | 23 | Dias úteis das operações consideradas na apuração do volume financeiro negociado conforme modalidade: definitiva a termo (modalidade = 004) → menor prazo para liquidação da operação compromissada (001-genérica/002-específica) → prazo de ida da compromissada: "000" - ida em D+0; "999" - ida > D+0 demais modalidades: "000" |
| Prazo final | Numeric | 3 | 24 | 26 | Dias úteis das operações consideradas na apuração do volume financeiro negociado conforme modalidade: definitiva a termo (modalidade = 004) → maior prazo para liquidação da operação compromissada (001-genérica/002-específica) → prazo de volta da compromissada: "001" - volta em D+1; "999" - volta > D+1 demais modalidades: "000" |
| Volume negociado por título e modalidade | Numeric | 19 | 27 | 45 | |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--|---------|------|--------|-----|-------------|
| Quantidade de casas decimais do volume negociado por título e modalidade | Numeric | 2 | 46 | 47 | |
| Quantidade de títulos | Numeric | 15 | 48 | 62 | |
| Quantidade de negócios | Numeric | 6 | 63 | 68 | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 69 | 76 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 77 | 82 | HHMMSS |
| Data de referência da Clearing | Numeric | 8 | 83 | 90 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

| Campo da Modalidade | Descrição |
|---------------------|----------------------------|
| 001 | Compromissadas genéricas |
| 002 | Compromissadas específicas |
| 003 | Definitivas a vista |
| 004 | Definitivas a termo |
| 006 | SET – Empréstimos |
| 007 | SET – Trocas |
| 008 | Termo de leilão |

Obs.: novos códigos de modalidade e suas descrições serão enviadas formalmente aos *vendors*.

e.4) Volume Financeiro Liquidado

Apuração do volume financeiro liquidado pela Clearing de Ativos BM&F, composto pelo somatório dos valores provenientes de operações e eventos sobre operações, como pagamento de juros, amortização e resgate. Será divulgado após o fechamento das liquidações da Clearing.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---|---------|------|--------|-----|-----------------------------------|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0046 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "20" - Clearing de Ativos |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "F" - Volume financeiro liquidado |
| Volume financeiro liquidado | Numeric | 19 | 4 | 22 | |
| Quantidade de casas decimais do volume financeiro liquidado | Numeric | 2 | 23 | 24 | |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------------|---------|------|--------|-----|-------------|
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 25 | 32 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 33 | 38 | HHMMSS |
| Data de referência da Clearing | Numeric | 8 | 39 | 46 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

e.5) Associações a Pagamentos de Leilão

Apuração da quantidade de títulos negociados por intermédio da Clearing de Ativos BM&F, associados a pagamento de leilão do Banco Central, com divulgação após o encerramento das liquidações pela Clearing.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--------------------------------|---------|------|--------|-----|-------------------------------|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho Mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0054 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "20" - Clearing de Ativos |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "L" - Associações a leilões |
| Código SELIC do título | Numeric | 6 | 4 | 9 | |
| Data de vencimento do título | Numeric | 8 | 10 | 17 | AAAAMMDD |
| Quantidade de títulos | Numeric | 15 | 18 | 32 | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 33 | 40 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 41 | 46 | HHMMSS |
| Data de referência da Clearing | Numeric | 8 | 47 | 54 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

e.6) Melhor Oferta de Venda e Melhor Oferta de Compra

Apresenta as informações referentes à melhor oferta de venda e à melhor oferta de compra de cada um dos títulos e das modalidades operacionais autorizados pela Clearing de Ativos BM&F.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---------------------|---------|------|--------|-----|----------------------------------|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 00138 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "21" - SISBEX |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "0" - Melhores ofertas no SISBEX |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--|---------|------|--------|-----|--|
| Identificador de mensagem SISBEX | Numeric | 4 | 4 | 7 | "9146" - Melhor oferta de compra e de venda |
| Subidentificador de mensagem SISBEX | Numeric | 2 | 8 | 9 | "39" - Clearing de Ativos |
| Modalidade SISBEX | Char. | 1 | 10 | 10 | Ver tabela que segue |
| Código do título no SISBEX | Char. | 18 | 11 | 28 | |
| Código SELIC do título | Numeric | 6 | 29 | 34 | |
| Data de vencimento do título | Numeric | 8 | 35 | 42 | AAAAMMDD |
| Prazo da operação | Numeric | 3 | 43 | 45 | Prazo de ida das compromissadas, prazo de liquidação das demais modalidades |
| Prazo de volta das operações compromissadas | Numeric | 3 | 46 | 48 | Prazo de volta das compromissadas, igual a zero para as demais modalidades |
| Vigência da taxa | Char. | 15 | 49 | 63 | "Spot" ou "Forward" ou espaços |
| Indexador de correção | Char. | 15 | 64 | 78 | Descrição do indexador de correção do valor de liquidação da operação a termo ou espaços |
| Indicativo de existência de melhor oferta de venda | Char. | 1 | 79 | 79 | "S" - existe melhor oferta de venda "N" - não existe melhor oferta de venda |
| Taxa ou preço unitário (PU) da melhor oferta de venda | Numeric | 18 | 80 | 97 | Taxa ou preço unitário, conforme modalidade operacional, com 8 casas decimais |
| Indicativo de existência de melhor oferta de compra | Char. | 1 | 98 | 98 | "S" - existe melhor oferta de compra "N" - não existe melhor oferta de compra |
| Taxa ou preço unitário (PU) da melhor oferta de compra | Numeric | 18 | 99 | 116 | Taxa ou preço unitário, conforme modalidade operacional, com 8 casas decimais |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 117 | 124 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 125 | 130 | HHMMSS |
| Data de referência da Clearing | Numeric | 8 | 131 | 138 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

| Código da Modalidade | Descrição |
|----------------------|---------------------|
| R | Compromissadas |
| Z | Definitivas a vista |
| U | Definitivas a termo |
| E | Termo de leilão |

Obs.: novos códigos de modalidade e suas descrições serão enviadas formalmente aos *vendors*.

e.7) Negócios realizados no ambiente SISBEX

Apresenta as informações referentes aos negócios efetuados no Sisbex-Negociação, bem como no Sisbex-Registro.

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---|---------|------|--------|-----|--|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0193 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "21" - SISBEX |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "N" - Negócios realizados no SISBEX |
| Identificador de mensagem SISBEX | Numeric | 4 | 4 | 7 | "9115" - Negócios realizados no ambiente SISBEX |
| Subidentificador de mensagem SISBEX | Numeric | 2 | 8 | 9 | "39" - Clearing de Ativos |
| Modalidade SISBEX | Char. | 1 | 10 | 10 | Ver tabela que segue |
| Código do título no SISBEX | Char. | 18 | 11 | 28 | |
| Código SELIC do título | Numeric | 6 | 29 | 34 | |
| Data de vencimento título | Numeric | 8 | 35 | 42 | AAAAMMDD |
| Prazo da operação | Numeric | 3 | 43 | 45 | Prazo de ida das compromissadas, prazo de liquidação das demais modalidades |
| Prazo de volta das operações compromissadas | Numeric | 3 | 46 | 48 | Prazo de volta das compromissadas, igual a zero para as demais modalidades |
| Vigência da taxa | Char. | 15 | 49 | 63 | "Spot" ou "Forward" ou espaços |
| Indexador de correção | Char. | 15 | 64 | 78 | Descrição do indexador de correção do valor de liquidação da operação a termo ou espaços |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|--|---------|------|--------|-----|---|
| Indicativo de negociação em roda ou registro | Char. | 3 | 79 | 81 | "NEG" - Negócios fechados nas rodas do Sisbex-Negociação "REG" - Negócios fechados entre os participantes e registrados no Sisbex-Registro |
| Taxa ou preço unitário (PU) da operação | Numeric | 18 | 82 | 99 | Taxa ou preço unitário, conforme modalidade operacional, com 8 casas decimais |
| Taxa da operação transformada em preço unitário (PU) | Numeric | 18 | 100 | 117 | Somente para as modalidades operacionais negociadas em taxa; demais igual a zero, com 8 casas decimais |
| Taxa ou preço unitário (PU) médio | Numeric | 18 | 118 | 135 | Taxa ou preço unitário (PU) médio negociado do instrumento, com 8 casas decimais |
| Taxa ou preço unitário (PU) mínimo | Numeric | 18 | 136 | 153 | Taxa ou preço unitário (PU) mínimo negociado no dia com o instrumento, com 8 casas decimais |
| Taxa ou preço unitário (PU) máximo | Numeric | 18 | 154 | 171 | Taxa ou preço unitário (PU) máximo negociado no dia com o instrumento, com 8 casas decimais |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 172 | 179 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 180 | 185 | HHMMSS |
| Data de referência da Clearing | Numeric | 8 | 186 | 193 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

| Código da Modalidade | Descrição |
|----------------------|---------------------|
| R | Compromissadas |
| Z | Definitivas a vista |
| U | Definitivas a termo |
| E | Termo de leilão |

Obs.: novos códigos de modalidade e suas descrições serão enviadas formalmente aos *vendors*.

e.8) Preços de Referência dos Títulos Públicos por Ciclo de Liquidação – Arquivo

A BM&F divulga os preços referenciais de títulos públicos em seu site (www.bmf.com.br), mas os *vendors* podem obter o arquivo correspondente em um servidor FTP da Bolsa. Para informar quando a nova versão desse arquivo está disponível, é enviada mensagem com o seguinte leiaute:

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---|---------|------|--------|-----|--|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0295 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "20" - Clearing de Ativos |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "R" - Preços de referência de títulos públicos |
| Nome do arquivo | Char. | 20 | 4 | 23 | "PUCICLO_aammdd99.TXT" - Data de ref. do arquivo "99" - Nº da geração do arquivo (seqüencial) (Ver estrutura do arquivo a seguir) |
| Pasta FTP da qual o arquivo será obtido | Char. | 250 | 24 | 273 | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 274 | 281 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 282 | 287 | HHMMSS |
| Data de referência da Clearing | Numeric | 8 | 288 | 295 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

Estrutura do arquivo **PUCICLO_aammdd99.TXT**

REGISTRO – 01 – Header

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|----------------------------|---------|------|--------|-----|--------------------------------------|
| Tipo de registro | Numeric | 2 | 1 | 2 | "01" – Registro <i>header</i> |
| Separador | Char. | 1 | 3 | 3 | "," |
| Data do movimento | Numeric | 8 | 4 | 11 | AAAAMMDD |
| Separador | Char. | 1 | 12 | 12 | "," |
| Nome do arquivo | Char. | 20 | 13 | 32 | PUCICLO_aammdd99.TXT |
| Hora de criação do arquivo | Char. | 8 | 34 | 40 | HH:MM:SS |

REGISTRO – 02 – Detalhes dos Preços de Referência

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|------------------------------|---------|------|--------|-----|---|
| Tipo de registro | Numeric | 2 | 1 | 2 | "02" - Detalhes dos preços referenciais |
| Separador | Char. | 1 | 3 | 3 | "," |
| Código SELIC do título | Numeric | 6 | 4 | 9 | |
| Separador | Char. | 1 | 10 | 10 | "," |
| Descrição SELIC do título no | Char. | 30 | 11 | 40 | |
| Separador | Char. | 1 | 41 | 41 | "," |
| Data de emissão do título | Numeric | 8 | 42 | 49 | |
| Separador | Char. | 1 | 50 | 50 | "," |
| Data de vencimento do título | Numeric | 8 | 51 | 58 | |
| Separador | Char. | 1 | 59 | 59 | "," |
| Ciclo de liquidação | Numeric | 2 | 60 | 61 | |
| Separador | Char. | 1 | 62 | 62 | "," |
| Valor PU de mercado | Numeric | 19 | 63 | 81 | 8 casas decimais |
| Separador | Char. | 1 | 82 | 82 | "," |
| Taxa de mercado | Numeric | 19 | 83 | 101 | 8 casas decimais |

e.9) Ativos Permitidos pela Clearing de Ativos BM&F – Arquivo

Os *vendors* poderão obter o arquivo contendo os ativos permitidos pela Clearing de Ativos em um servidor FTP da BM&F. Para informar quando a nova versão desse arquivo está disponível, é enviada mensagem com o seguinte leiaute:

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---------------------|---------|------|--------|-----|---|
| STX | Binary | 1 | - | - | 0x02 |
| Tamanho da mensagem | Numeric | 4 | - | - | 0295 (exceto STX/tamanho/ETX) |
| Origem | Numeric | 2 | 1 | 2 | "20" - Clearing de Ativos |
| Tipo | Char. | 1 | 3 | 3 | "A" - Ativos permitidos |
| Nome do arquivo | Char. | 20 | 4 | 23 | "GAATaaaamdd.TXT" - Data de referência do arquivo (Ver estrutura do arquivo a seguir) |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|---|---------|------|--------|-----|-------------|
| Pasta FTP da qual o arquivo será obtido | Char. | 250 | 24 | 273 | |
| Data de criação do sinal | Numeric | 8 | 274 | 281 | AAAAMMDD |
| Hora de criação do sinal | Numeric | 6 | 282 | 287 | HHMMSS |
| Data de referência da Clearing | Numeric | 8 | 288 | 295 | AAAAMMDD |
| ETX | Binary | 1 | - | - | 0x03 |

Estrutura do arquivo **GAATaaaammdd.TXT**

REGISTRO – 00 – Header

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|----------------------------|---------|------|--------|-----|------------------------|
| Tipo de registro | Numeric | 2 | 1 | 2 | "00" - Registro header |
| Separador | Char. | 1 | 3 | 3 | ":" |
| Nome do arquivo | Char. | 13 | 4 | 16 | "GAATaaaammdd.TXT" |
| Separador | Char. | 1 | 17 | 17 | ":" |
| Origem do arquivo | Char. | 4 | 18 | 21 | "BMA" |
| Separador | Char. | 1 | 22 | 22 | ":" |
| Destino do arquivo | Numeric | 6 | 23 | 28 | |
| Separador | Char. | 1 | 29 | 29 | ":" |
| Data de geração do arquivo | Numeric | 8 | 30 | 37 | AAAAMMDD |
| Separador | Char. | 1 | 38 | 38 | ":" |
| Data do movimento | Numeric | 8 | 39 | 46 | AAAAMMDD |
| Separador | Char. | 1 | 47 | 47 | ":" |
| Filler | Char. | 253 | 48 | 300 | Espaços |

REGISTRO – 01 – Detalhes dos Ativos Autorizados

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|------------------------------|---------|------|--------|-----|--|
| Tipo de registro | Numeric | 2 | 1 | 2 | "01" - Detalhes dos ativos autorizados |
| Separador | Char. | 1 | 3 | 3 | ":" |
| Código SELIC do título | Numeric | 6 | 4 | 9 | "GAATaaaammdd.TXT" |
| Separador | Char. | 1 | 10 | 10 | ":" |
| Descrição SELIC do título | Char. | 25 | 11 | 35 | AAAAMMDD |
| Separador | Char. | 1 | 36 | 36 | ":" |
| Data de vencimento do título | Numeric | 8 | 37 | 44 | |
| Separador | Char. | 1 | 45 | 45 | ":" |
| Código ISIN | Char. | 12 | 46 | 57 | |
| Separador | Char. | 1 | 58 | 58 | ":" |

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|----------------------------------|-------|------|--------|-----|-------------|
| Autorizado à negociação/registro | Char. | 1 | 59 | 59 | "S" ou "N" |
| Separador | Char. | 1 | 60 | 60 | "," |
| Garantia | Char. | 1 | 61 | 61 | "S" ou "N" |
| Separador | Char. | 1 | 62 | 62 | "," |
| Empréstimo/troca | Char. | 1 | 63 | 63 | "S" ou "N" |
| Separador | Char. | 1 | 64 | 64 | "," |
| Filler | Char. | 236 | 65 | 300 | Espaços |

REGISTRO – 99 – Trailer

| Nome do Campo | Tipo | Tam. | Início | Fim | Observações |
|----------------------------|---------|------|--------|-----|------------------------|
| Tipo de registro | Numeric | 2 | 1 | 2 | "00" - Registro header |
| Separador | Char. | 1 | 3 | 3 | "," |
| Nome do arquivo | Char. | 13 | 4 | 16 | "GAATaaaammdd.TXT" |
| Separador | Char. | 1 | 17 | 17 | "," |
| Origem do arquivo | Char. | 4 | 18 | 21 | "BMA" |
| Separador | Char. | 1 | 22 | 22 | "," |
| Destino do arquivo | Numeric | 6 | 23 | 28 | |
| Separador | Char. | 1 | 29 | 29 | "," |
| Data de geração do arquivo | Numeric | 8 | 30 | 37 | AAAAMMDD |
| Separador | Char. | 1 | 38 | 38 | "," |
| Total de registros gerados | Numeric | 9 | 39 | 47 | |
| Separador | Char. | 1 | 48 | 48 | "," |
| Filler | Char. | 252 | 49 | 300 | Espaços |