

Perguntas e Respostas

ARQUIVO DE POSIÇÃO 5.0



Q&A Arquivo de Posição 5.0

Seção 1 – Informações do Arquivo de Posição 5.0 e histórico do arquivo

Seção 2 – Adaptação do Arquivo de Posição 5.0 à RCV 175 e nova estrutura

Seção 3 – Preenchimento dos ativos, cálculo do PL e contas a pagar e receber

Seção 4 – Usos do Arquivo de Posição 5.0

Seção 5 – Materiais de apoio do Arquivo de Posição 5.0 e periodicidade de mudanças

Seção 1 – Informações do Arquivo de Posição 5.0 e histórico do arquivo

1- Há quanto tempo o Arquivo de posição 5.0 existe e é utilizado?

O Arquivo de Posição 5.0 existe há mais de 10 anos e é usado por prestadores de serviços do mercado para troca de informações sobre fundos e carteiras administradas. A ANBIMA disponibiliza o [manual de preenchimento da posição em português](#), tomando como base a norma internacional para troca de informações entre instituições financeiras, a ISO 20022. Em 2016, a PREVIC passou a usar esse padrão para o recebimento de informações de fundos estruturados adquiridos por planos de pensão. Conforme notícia: https://www.anbima.com.br/pt_br/noticias/previc-adota-arquivo-de-posicao-5-0-para-recebimento-de-informacoes-de-fundos-de-pensao.htm

2- Qual é o objetivo do Arquivo de Posição 5.0 e quais as vantagens de sua padronização?

O layout de posição de ativos visa padronizar a troca de informações entre as instituições do mercado. As vantagens dessa padronização incluem a redução no custo de geração de informações, pois, após a implementação, não haverá necessidade de criar e manter vários tipos e formatos de arquivos para o envio da mesma informação. Além disso, facilita a troca de informações, já que, ao precisar receber informações de um novo fornecedor ou enviá-las para um novo cliente, o tempo para o envio e recebimento será mínimo, uma vez que será utilizado o mesmo padrão definido pelo mercado. A gestão compartilhada também é um benefício, pois mudanças ou evoluções no layout serão discutidas com as Instituições associadas à ANBIMA, garantindo a representação dos usuários nas definições.



3- O que é o padrão internacional ISO 20022?

A ISO (*International Organization for Standardization*) é um organismo internacional que facilita a coordenação e unificação de padrões. O Comitê Técnico ISO/TC68 desenvolve normas e relatórios técnicos para a indústria de serviços financeiros, ajudando os países a alcançar interoperabilidade entre mercados e sistemas, reduzir fraudes, superar obstáculos legais e utilizar tecnologia de forma uniforme. A mensagem “MX semt.003.001.04 ISO 20022” permite a apresentação de informações em diferentes moedas, países ou outros critérios definidos pelo provedor da mensagem.

4- O que são as tabelas nível ANBIMA?

As tabelas nível ANBIMA reúnem códigos para identificações dos ativos no arquivo de posição 5.0 em 3 níveis. A tabela Nível 1 identifica o produto, a tabela Nível 2 identifica o lastro (ativo-objeto) e a tabela Nível 3 identifica o tipo de negociação.

Seção 2 – Adaptação do Arquivo de Posição 5.0 à RCVM nº 175 e nova estrutura

5- Porque houve mudança no Arquivo de Posição 5.0?

O principal objetivo das mudanças trazidas no Arquivo de Posição 5.0 foi ajustar sua estrutura às mudanças introduzidas pela Resolução CVM nº 175, que é o novo marco regulatório dos fundos de investimento. O layout 5.0 é flexível, o que permite o preenchimento de novas estruturas de classes e subclasses. As mudanças também foram realizadas para detalhar melhor informações e uso do arquivo.

6- Quais foram as principais mudanças na estrutura do arquivo para a adaptação à Resolução nº 175?

No layout do Arquivo de Posição 5.0 foi adaptado o cabeçalho para identificar as informações referentes às classes e subclasses de fundos. O arquivo referente à classe sem subclasse contém a identificação da classe, cadastro, detalhamento dos ativos e despesas da classe. Para classes com subclasses, além das informações da classe, são incluídas as informações de cadastro da subclasse, bem como suas despesas.

O arquivo da subclasse contém o cadastro da classe (que é opcional), o cadastro da subclasse, detalhamento das despesas da subclasse e quantidade de cotas gerenciais.

Mais informações acesse: [Manual de preenchimento do Arquivo de posição 5.0 - ESTRUTURA DO LAYOUT.](#)



7- O que foi alterado com relação às regras dos nomes dos arquivos?

A estrutura do nome de cada arquivo de posição 5.0 deve seguir uma regra que padroniza a leitura e facilita a identificação. Com a adaptação do arquivo à nova estrutura dos fundos trazida pela RCVM nº 175 e carteiras administradas, foi incluída uma nova regra para nomes no manual de preenchimento.

Mais informações acesse: [Manual de preenchimento do Arquivo de posição 5.0 - REGRAS PARA O NOME DO ARQUIVO.](#)

8- Como é a nova estrutura do Arquivo de Posição 5.0?

Estrutura do Arquivo de Posição 5.0:

- Constituída por blocos de dados agregados.
- Organizada em campos com informações específicas sobre cada bloco.
- Inclui informações relacionadas às classes e/ou subclasses do arquivo.

Blocos de paginação e detalhes gerais:

- Referem-se ao próprio arquivo e incluem:
 - ✓ Número da página da mensagem dentro do arquivo.
 - ✓ Indicador de continuidade (informando se o arquivo tem continuação ou se é a última página).
- Contém dados gerais sobre o fundo ou carteira, como:
 - ✓ Data;
 - ✓ Atividade;
 - ✓ Frequência de envio;
 - ✓ Base das informações.

Blocos de informações adicionais:

- Dados sobre:
 - ✓ Administrador
 - ✓ Gestor



- ✓ Custodiante
- Detalhes da classe, subclasse ou carteira administrada
- Informações sobre:
 - ✓ Ativos
 - ✓ Patrimônio na moeda base do fundo ou carteira

As subseções dos blocos de informações possuem regras de obrigatoriedade e repetição que podem ser consultadas no manual: <https://anbi.ma/arquivo.posicao-5.0>.

9- Do que se trata a validação da estrutura do Arquivo XSD?

A estrutura do arquivo de posição 5.0 é feita com a extensão de arquivo XSD, um formato de arquivo baseado em texto que define regras de validação para um arquivo XML e explica o formulário XML.

O arquivo é validado, principalmente, por 3 (três) XSDs. No [manual de preenchimento](#), estão identificados pelos namespaces <p:>; <ns3:>; <posatbr:>, relacionados aos XSD abaixo:

- head.001.001.01.xsd – identificado pelo namespace - <p:> (campos relacionados ao envio e tamanho do arquivo);
- semt.003.001.04.xsd - identificado pelo namespace - <ns3:> (campos relacionados à informação do fundo e seus ativos);
- SchemaBalanceForSubAccountBrazil.xsd - identificado pelo namespace - <posatbr:> (campos relacionados às informações adicionais do fundo e seus ativos para o mercado brasileiro).

https://www.anbima.com.br/pt_br/representar/foruns-de-representacao/servicos-fiduciarios/servicos-fiduciarios.htm#collapseFive

10- Qual o limite de dígitos e a quantidade de casas decimais que devem ser preenchidas para valores financeiros no arquivo?

Os valores financeiros a serem preenchidos no arquivo devem ter no máximo 18 dígitos, sendo 13 para a parte inteira e 5 para a parte decimal.



Seção 3 – Preenchimento dos ativos, cálculo do PL e contas a pagar e receber

11- Quais são os ativos descritos no manual de preenchimento do arquivo de posição 5.0 e qual é o rito para definição de padrões de preenchimento de novos ativos?

O arquivo de posição 5.0 permite realizar ajustes no layout com mais facilidade de forma a incluir mais informações em seus blocos e permitir a inclusão de novos ativos sem mudanças drásticas de estrutura. Atualmente, os ativos já formalizados no arquivo incluem:

- Caixa,
- Títulos públicos,
- Títulos privados,
- Debêntures,
- Compromissadas,
- Termo de renda fixa,
- Ação ou ativos negociados na B3,
- Opção de ação,
- Termo de ações,
- Empréstimo de ações e ativos da B3,
- Futuro,
- Swap,
- Opção de derivativo,
- Opção de moedas,
- Forward de moedas,
- Imóvel,
- Cotas de fundos e de fundos no exterior.

Para a padronização e formalização do preenchimento de novos ativos, o processo passa pela definição do comitê técnico do Arquivo de Posição, que aprovará a forma de preenchimento das informações. Após a formalização nos manuais, documentos e boletador/validador, o mercado terá um prazo para implementar os novos campos, que passarão a ser requeridos e validados.



12- Como é o lançamento do Patrimônio Líquido (PL) para uma estrutura de classe que possua subclasses?

Para calcular o PL do Fundo, devem ser considerados os ativos, despesas e receitas da classe e da subclasse.

- Se houver subclasse, as cotas a emitir e a resgatar são baseadas nela.
- Se houver apenas classe, considera-se as cotas da classe.

Dessa forma, temos que:

Fundo com classe que tenha subclasses: PL = somatório dos ativos (Classe) + somatório das receitas (classe e subclasse) – somatório das despesas (classe e subclasse) – somatório das cotas a emitir (somente subclasse) – somatório das cotas a resgatar (somente da subclasse).

Fundo com classe sem subclasses: PL = somatório dos ativos (classe) + somatório das receitas (classe) – somatório das despesas (classe) – somatório das cotas a emitir (classe) – somatório das cotas a resgatar (classe).

Outro processo para o cálculo do PL é multiplicar o número de cotas pelo valor da cota. Neste caso o valor do PL é dado por:

Fundo classe com subclasses: PL = somatório do produto do valor da cota das subclasses multiplicado pela quantidade da subclasse.

Obs.: Como o valor da cota da classe é apenas gerencial, não se deve utilizar ele na composição do PL, por não considerar as receitas e despesas da subclasse.

Fundo classe sem subclasses: PL = O valor da cota da classe multiplicado pela quantidade de cotas da classe.

Seção 4 – Usos do Arquivo de Posição 5.0

13- Qual o principal uso do arquivo de posição 5.0?

O layout de posição de ativos fornece informações sobre a composição da carteira e provisões (receitas e despesas) dos fundos, permitindo, dessa forma, montar a carteira e avaliar seus riscos. Ele é utilizado para a troca de informações entre administradores, gestores e empresas- com o objetivo de avaliação das carteiras. A PREVIC o utiliza para receber informações sobre fundos estruturados adquiridos pelas instituições de previdência privada como investimento.



14- A ANBIMA recebe o Arquivo de Posição 5.0?

O layout do Arquivo de Posição 5.0 não é recebido pela ANBIMA. A ANBIMA é responsável por deliberar sobre a padronização e ajustes no arquivo, bem como pela atualização do boletador/validador do arquivo e dos materiais de apoio deste.

15- Qual o nível de verificação do validador ANBIMA?

O validador do arquivo verifica a estrutura do arquivo, o tamanho dos campos e a estrutura do ISIN informados. Ele também verifica a coerência por meio do somatório dos ativos, receitas e despesas em relação ao PL do fundo ou da carteira. Por ser um programa que não realiza acessos externos, o validador não confirma se o ISIN informado existe ou se representa corretamente o ativo a ele vinculado.

Seção 5 – Materiais de apoio do Arquivo de Posição 5.0 e periodicidade de mudanças dos materiais

Os materiais de apoio ao uso do Arquivo de Posição 5.0 podem ser encontrados no site da ANBIMA: https://www.anbima.com.br/pt_br/index.htm.

Materiais:

- [Manual de Preenchimento do Arquivo de Posição 5.0](#)
- [Boletador/Validador do Arquivo de posição 5.0](#)



