

Manual para o Preenchimento do Layout de Movimentação de Fundos e Carteiras

Versão v 2.00

**Outubro 2007
01/10/2007**

ÍNDICE

Objetivo do Layout de posição	03
Valores Padrões e Fontes de Informação	04
Estrutura do Layout	06
Seção Versão	08
Seção Fundo/Carteira	09
Seção Fundos (Header)	10
Seção Carteira (Header)	11
Seção Participação de Planos de Benefício	12
Seção Papéis Públicos, Privados e Debêntures	13
Seção Ativos de Renda Variável	17
Seção Opções Flexíveis	21
Seção Termo de Ações	24
Seção Termo Renda Fixa	26
Seção Futuro e Opções de Futuros	28
Seção Swap	30
Seção Cotas	33
Seção Caixa	36
Seção Carteira Imobiliária	37
Seção Opções de Moedas (OTC)	39
Seção Forwards de Moedas	41
Anexo I – Dicionário de Termos	43
Anexo II – Tabelas Auxiliares	45
Anexo III – Composição do Campo “Valor dos Ativos” do Header	51

OBJETIVO DO LAYOUT DE MOVIMENTAÇÃO

O layout de movimentação de ativos de fundos e carteiras é um trabalho do Subcomitê de Padronização da ANBIMA, a qual esta subordinada ao Comitê de Serviços Qualificados ao Mercado de Capitais da ANBIMA.

De maneira geral, este arquivo pretende mostrar o momento em que as operações foram fechadas e não o momento em que os ativos foram efetivamente movimentados. No entanto, existem algumas situações onde será reportado o momento da movimentação dos ativos e estas situações serão explicitadas no manual.

O Subcomitê de Padronização visa elaborar padrões que facilitem o processo de troca de informações entre participantes do Mercado de Capitais do Brasil, as vantagens que se obtém com a padronização são:

- ✓ Redução no custo de geração de informação. Não é necessária a criação e manutenção de vários tipos e formatos de arquivos para o envio da mesma informação.
- ✓ Facilidade na troca de Informações. Havendo necessidade de receber informações de um novo fornecedor ou enviá-las para um novo cliente, o tempo para o envio e o recebimento destas informações será mínimo.
- ✓ Gestão compartilhada. No caso de mudanças ou evoluções no layout, estas serão discutidas com as Instituições Associadas á ANBIMA através do Subcomitê de Padronização, garantindo que os usuários do layout através dos seus pares no subcomitê sejam representados.

VALORES PADRÕES E FONTES DE INFORMAÇÃO

Número de Fundos ou Carteiras por Arquivo: O layout pode aceitar 1 ou N itens, podendo ser Fundos ou Carteiras, devendo apenas obedecer as regras de Nome do Arquivo.

Nome do Arquivo com apenas um Fundo: O nome do arquivo deve ser iniciado MVFD_ + o CNPJ do fundo, para facilitar a identificação do mesmo + () + Data inicial da movimentação, no formato (AAAAMMDD) + data e hora de geração do arquivo no formato (AAAAMMDDHHMMSS) + () após este o campo é livre.

Exemplo: O Fundo XPTO de CNPJ 12345678901234 das movimentações que iniciam em 12 de Agosto de 2003, o nome do arquivo será:

MVFD_12345678901234_20030812_20030812135000_XPTO.XML.

Nome do Arquivo com apenas uma Carteira: O nome do arquivo deve ser iniciado por MVCT_ + o código interno da carteira no informante, este código interno deve garantir a unicidade da carteira para a Instituição informante, + () + a Data inicial do movimento no formato (AAAAMMDD) + data e hora de geração do arquivo no formato (AAAAMMDDHHMMSS) + () após este o campo é livre.

Exemplo: A Carteira CART-XPTO de Código Interno 234567 de 12 de Agosto de 2003, o nome do arquivo será:

MVCT_234567_20030812_20030812135000_XPTO.XML.

Nome do Arquivo com mais de um fundo ou com mais de uma carteira: O nome do arquivo deve ser iniciado por MLT (para identificar que é um arquivo de lote) + o CNPJ da Instituição que esta enviando o Lote + () + a Data inicial da movimentação no formato (AAAAMMDD) + () + a quantidade de fundos/carteiras presentes no arquivo + () + data e hora de geração do arquivo no formato (AAAAMMDDHHMMSS).

Exemplo: A instituição A de CNPJ 12345678901234 em 12 de Agosto de 2003 às 13h50min gera o arquivo com a movimentação de 30 de julho de 2003 de 10 fundos, o nome do arquivo será:

MLT12345678901234_20030730_10_20030812135000.XML

Todas as Tags são obrigatórias. As tags que não são mandatórias deverão ser preenchidas com um valor padrão que identifica o campo como vazio. A única exceção é o Layout Corretagem que é opcional.

Segue abaixo as definições genéricas para este preenchimento.

Tipo de Campo	Valor Padrão	Exemplo
Data	Nulo	<data></data>
Texto	Nulo	<texto></texto>
Numérico	0 (Respeitando a Formatação)	<valor>0.00</valor>

- O separador decimal dos campos numéricos deverá ser ponto (.).
- Os campos "texto", que sejam mandatórios, não poderão ser preenchidos com caracteres acentuados ou com caracteres especiais.
- Todos os valores financeiros do layout são Valores Brutos (sem impostos e taxas) em reais (R\$). Os valores em outras moedas devem ser convertidos em Reais na Data Do Movimento.
- Nos campos numéricos não se deve utilizar separadores de milhar e para a identificação de valores negativos deverá ser utilizado o sinal negativo "-".

Fontes para os códigos:

Fornecedor	Site	Onde
CUSIP	http://www.cusip.com	
BVMF	http://www.bmfbovespa.com.br	ISIN – Informações de Mercado/ISIN
SND	http://www.debenture.com.br	
CETIP	http://www.cetip.com.br	

Obs. O código ISIN é obrigatório para o envio de informações para a SPC.

No caso de ausência do código ISIN e de as informações não serem enviadas para o SPC, poderá ser utilizado o coringa "Código do País + **" ou "*****" no campo ISIN.**

ESTRUTURA DO LAYOUT

O Layout está estruturado para que sejam informados fundos e carteiras, sendo que o arquivo no layout deve começar com esta linha:

```
<?xml version="1.0" ?>
```

A próxima linha informa a versão do layout e marca o início da informação.

```
<arquivomovimentacao_2_00>
```

No final do arquivo deve ser informado

```
</arquivomovimentacao_2_00>
```

Os dados devem ser informados primeiro os grupos de Fundos e depois os grupos com as carteiras.

Cada fundo deve começar com a tag `<fundo>` e terminar com a tag `</fundo>`

Cada carteira deve começar com a tag `<carteira>` e terminar com a tag `</carteira>`

Exemplo da Estrutura do Arquivo:

```
<?xml version="1.0" ?>
```

```
<arquivomovimentacao_2_00>
```

```
    <fundo>
```

```
        ...
```

```
    </fundo>
```

```
    ...
```

```
    <carteira>
```

```
        ...
```

```
    </carteira>
```

```
    ...
```

```
</arquivomovimentacao_2_00>
```

Existem 3 grupos de tags no layout:

Tag de Seção – São as tags que grupam as subseções e campos

Exemplo: <header> - grupo de dados que identificam o fundo ou a carteira...

Tag de Subseção – São as tags que marcam início de um subgrupo de informação

Exemplo: <compromisso> - grupo de dados sobre o compromisso de um ativo..

Tag de Campo - São as tags que marcam início e fim de um campo de informação.

Exemplo: <isin> - Código ISIN do ativo.

Observação: Os dados sobre tamanho, tipo de campo e obrigatoriedade do campo constam da planilha com o layout. Esta planilha encontra-se disponível no site da ANBIMA (www.anbima.com.br), através do link:

<http://www.anbima.com.br/mostra.aspx?id=1000001386>

SEÇÃO VERSÃO

Nesta seção deverá ser identificada a versão do arquivo.

Segue abaixo os campos que compõem esta seção:

VERSÃO – Versão do Formato do Arquivo de Movimentação.

Exemplo: <versão>**movimento_2_00**</versão>

Esta TAG deve abrir e fechar o arquivo.

SEÇÃO FUNDO/CARTEIRA

Nesta seção deverá ser identificado o fundo e a carteira. Segue abaixo os campos que compõem esta seção:

FUNDO – Código para identificação do fundo. Esta tag “Fundo” deverá abrir e fechar cada um dos fundos, podendo existir de 0 à N fundos no arquivo.

Exemplo: <fundo>fundo</fundo>

CARTEIRA – Código de identificação da carteira administrada. Esta tag “Carteira” deverá abrir e fechar cada uma das carteiras, podendo existir de 0 à N carteiras no arquivo.

Exemplo: <carteira>carteira</carteira>

IMPORTANTE: Se preenchido o campo "Fundo", não é necessário o preenchimento do campo "Carteira" e vice-versa.

SEÇÃO FUNDOS (HEADER)

Nesta seção deverá ser identificado o administrador, gestor e custodiante do fundo, definido pela tag <header>. Esta seção é obrigatória e deve sempre existir uma para cada Fundo. Segue abaixo os campos que compõem esta seção.

Código ISIN – Código para identificação do fundo fornecido pela *BVMFou* pela *Agência de Numeração do País* que emitiu o Título.

Exemplo: <isin>**BRCPRFCTF005**</isin>

CNPJ do Fundo – CNPJ do fundo conforme cadastro na Receita Federal. O campo deverá ser preenchido apenas com números.

Exemplo: <cnj>**07658775000188**</cnj>

Nome do Fundo – Nome do Fundo cadastrado na Receita Federal / *CVM* ou nome fantasia do Fundo.

Exemplo: <nome>**COMPOSTO RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO**</nome>

Data de Movimento Inicial – Data que iniciou a movimentação. Devem ser consideradas as movimentações de ativos efetivadas à partir deste dia, mesmo que não seja o *Trade Date* ou o *Settlement Date*. Deve ser menor ou igual a data atual.

Exemplo: <dtmovinicial>**20060405**</dtmovinicial>

Data de Movimento Final – Data que finalizou a movimentação. Deve ser menor ou igual a data atual.

Exemplo: <dtmovfinal>**20060405**</dtmovfinal>

Esta seção deve ser utilizada para preparar base de dados que irá compor a identificação de cada fundo na instituição. É obrigatória e deve existir um para cada fundo.

SEÇÃO CARTEIRA (HEADER)

Nesta seção deverá ser identificado o administrador, gestor e custodiante da carteira definido pela tag <header>. Esta seção é obrigatória e deve sempre existir, uma para cada Carteira. Segue abaixo os campos que compõem esta seção:

Código Carteira – Este é o código interno da carteira no sistema do informante. O objetivo deste campo é identificar diferentes carteiras do mesmo investidor (mesmo CNPJ / CPF).

Exemplo: <codcart>**000178610305**</codcart>

CNPJ ou CPF da Carteira – CNPJ ou CPF do proprietário da carteira. O campo deverá ser preenchido com somente números.

Exemplo: <cnjcpf>**07658775000188**</cnjcpf>

Nome da Carteira – Nome do titular da carteira conforme cadastro no CNPJ / CPF.

Exemplo: <nome>**FUNDAÇÃO XPTO**</nome>

Data de Movimento Inicial – Data que iniciou a movimentação. Devem ser consideradas as movimentações de ativos efetivadas à partir deste dia, mesmo que não seja o *Trade Date* ou o *Settlement Date*. Deve ser menor ou igual a data atual.

Exemplo: <dtmovinicial>**20060405**</dtmovinicial>

Data de Movimento Final – Data que finalizou a movimentação. Deve ser menor ou igual a data atual.

Exemplo: <dtmovfinal>**20060405**</dtmovfinal>

Esta seção é obrigatória e deve existir uma para cada carteira.

SEÇÃO PARTICIPAÇÃO DE PLANO DE BENEFÍCIO

Nesta seção deverá ser identificada a participação de cada Plano de Benefício no Patrimônio Líquido do Fundo / Carteira Administrada informado no arquivo, definido pela tag <partplanprev>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada Carteira.

Os campos desta seção se tornarão obrigatórios somente para arquivos de carteiras cujo titular é uma entidade fechada de previdência complementar, não devendo constar em arquivos de movimentação de fundos de investimento. Segue abaixo os campos que compõe esta seção:

Código CNPB – Código para identificação do Plano de Benefício que participa dos fundos, fornecido pela SPC

Exemplo: <cnpb>**32569724000145**</cnpb>

Obs: O campo “Código CNPB” não deverá ser preenchido com código superior a 10 dígitos.

% de Participação – Percentual da participação do Plano de Benefício no Patrimônio Líquido do Fundo / Carteira informado no Arquivo de Posição. O campo deverá ser preenchido com somente números.

Exemplo: <percpart>**100.00**</percpart>

Não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada carteira.

SEÇÃO PAPÉIS PÚBLICOS, PRIVADOS E DEBÊNTURES

Nesta seção deverão ser informados os Títulos Públicos, Privados e Debêntures que foram movimentados na data de operação, identificadas pelo código ISIN, definido pela tag <ativosrf>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõem esta seção:

Código ISIN - Código para identificação do ativo fornecido pela *BMF&BOVESPA* ou pela *Agência de Numeração do País* que emitiu o Título. Caso o campo 'Código CUSIP' for preenchido, este campo não será mandatório. Do contrário, o campo é mandatório.

Exemplo: <isin>**BRSTNCLF16C2**</isin>

Código do Ativo – Código para identificação do título público, fornecido pela *SELIC* ou pelo ambiente de negociação.

Exemplo: <codativo> **770100**</codativo>

Código CUSIP – Código para identificação do Emissor e da operação fornecido pelo *CUSIP*. Caso o campo 'Código ISIN' for preenchido, este campo não será mandatório. Do contrário, o campo é mandatório.

Exemplo: <cusip>**134657498558**</cusip>

Local de Negociação – Código que identifica o local de negociação, de acordo com a *Tabela de Local de Negociação*.

Exemplo: <localnegoc>**1**</localnegoc>

CNPJ da Contraparte – Número do CNPJ que identifica a Contraparte. Se 'Local de Negociação' for igual à "4-Exterior", campo não mandatório. O campo deverá ser preenchido somente com números

Exemplo: <cnjcontraparte>**32310572618558**</cnjcontraparte>

Nome da Contraparte – Nome da Contraparte. Se 'Local de Negociação' for igual à "4-Exterior", campo não mandatório.

Exemplo: <nomecontraparte>**FUNDAÇÃO XPTO**</nomecontraparte>

Data da Liquidação – Em operações de compra, é igual à data da operação. Em operações de venda e/ou resgate, é a data de liquidação financeira. Deve ser menor ou igual a data atual.

Exemplo: <dtliquidacao>**20060517**</dtliquidacao>

Data da Operação – Data em que ocorreu a operação, ou seja, data em que a operação foi contratada. Deve ser menor ou igual a data atual.

Exemplo: <dtoperacao>20060404</dtoperacao>

Quantidade – Quantidade movimentada. No caso de ‘Tipo de Movimentação’ igual a “AM- Amortização” ou “OU-Outros”, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, a quantidade a ser informada é aquela sob a qual incide o evento.

Exemplo: <qtd>80000.00</qtd>

PU – O valor do PU na data da operação. De acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, caso o ‘Tipo de Movimentação’, for igual a “AM – Amortização” ou “OU – Outros”, o PU se refere ao evento correspondente. Caso o ‘Tipo de Movimentação’ for igual a transferência de ativos, “TE – Transferência de Entrada” ou “TS – Transferência de Saída”, o PU a ser informado será o PU Valorizado na data em que ocorreu a operação.

Exemplo: <pu>45.00</pu>

Valor Bruto – Valor da multiplicação ‘PU’ x ‘Quantidade’. No caso de ‘Tipo de Movimentação’ igual a “AM – Amortização” ou “OU-Outros”, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, o valor bruto será o ‘PU’ do evento multiplicado pela ‘Quantidade’ sob a qual incidiu o evento.

Exemplo: <valor>50.00</valor>

Valor do Tributo – Valor total dos tributos cobrados na operação.

Exemplo: <tributos>50.00</tributos>

Tipo de Movimentação – Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**.

Exemplo: <tpmov>CP</tpmov>

Identificador Interno do Ativo – Código que identifica o movimento do ativo nos sistemas internos da instituição geradora do arquivo.

Exemplo: <idinternoativo>3156464654</idinternoativo>

SUBSEÇÃO ALUGUEL: Subseção de Aluguel definida pela tag <Aluguel>

CNPJ do Intermediário do Aluguel – Número do CNPJ da Instituição Financeira que intermediou a operação de aluguel.

Exemplo: <cnpjaloguel>32310572618587</cnpjaloguel>

Taxa de Aluguel – Custo, em valor percentual ao ano, a ser pago pelo Tomador e Doador do ativo. O campo deverá ser preenchido somente com números.

Exemplo: <txaluguel>2.2</txaluguel>

Data do Vencimento – Data de vencimento contratual do aluguel.

Exemplo: <dtvencaluguel>20060701</dtvencaluguel>

SUBSEÇÃO COMPROMISSO: Subseção de Compromisso definida pela tag <Compromisso>

Data de Retorno – Data do retorno da operação compromissada. Deve ser maior que a data da posição.

Exemplo: <dtretorno>20060701</dtretorno>

PU de Retorno – Valor corrigido da operação compromissada dividido pela ‘Quantidade’ movimentada.

Exemplo: <puretorno>51.00</puretorno>

Indexador - Código do indexador conforme cadastro disponível na *BVMF*. Para consultar os referidos códigos acesse o site:

<http://www.bmfbovespa.com.br/pt-br/regulacao/horarios-de-negociacao/derivativos.aspx?Idioma=pt-br>

Exemplo: <indexadorcomp>DDM</indexadorcomp>

Percentual do Indexador - Percentual do indexador da operação compromissada. O campo deverá ser preenchido somente com números.

Exemplo: <perindexcomp>100.00</perindexcomp>

Taxa da Operação – Taxa da Operação Compromissada, ao ano. O campo deverá ser preenchido somente com números.

Exemplo: <txoperacao>1.00</txoperacao>

Classe da Compromissada – Identifica a classe da operação compromissada. Preencher com:

“C” – Compra com Revenda ou “V” – Venda com recompra

Exemplo: <classecomp>C</classecomp>

IMPORTANTE:

- No caso de **Vencimentos**, os mesmos são considerados como movimentação e deverão ser reportados na Seção de “Papéis Públicos, Privados e Debêntures” como “**Resgate**” e o crédito do valor financeiro será reportado na seção “**Caixa**” e a relação entre os movimentos serão amarradas pelo “**Código Interno do Ativo**”.
- As liquidações das operações compromissadas (**Revenda e Recompra**) devem ser informadas apenas na Seção de “**Movimentação de Caixa**”.
- Quando a operação compromissada for lastreada por mais de um ativo (“**Multilastreada**”), para cada ativo-lastro deverá constar seu respectivo movimento.

SEÇÃO ATIVOS DE RENDA VARIÁVEL

Nesta seção deverão ser lançados os ativos de renda variável que foram movimentadas no fundo ou na carteira na data de movimentação, definida pela tag <ativosrv>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõem esta seção:

Tipo do Ativo – Código que identifica o tipo do ativo, de acordo com **Tabela de Tipo de Ativo**.

Exemplo: <tipoativo>**2**</tipoativo>

Código ISIN – Código para identificação do ativo fornecido pela BVMFou pela Agência de Numeração do País que emitiu o Título. Caso o campo ‘Código CUSIP’ for preenchido, este campo não será mandatório. Ao contrário, o campo é mandatório.

Exemplo: <isin>**BRAHEBTSA000**</isin>

Código do Ativo – Código para Identificação do ativo fornecido pelo ambiente de negociação onde é negociado.

Exemplo: <codativo>**TMAR3T**</codativo>

Código CUSIP - Código para identificação do emissor na operação fornecido pelo CUSIP. Caso o campo ‘Código ISIN’ for preenchido, este campo não será mandatório. Ao contrário, o campo é mandatório.

Exemplo: <cusip>**472396854587**</cusip>

Data da Operação – Deverão ser observados os seguintes critérios:

- Quando ‘Tipo de Movimento’, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, igual a “CP-Compra” ou “VD-Venda”, deve ser informada a data de negociação do ativo.
- Quando ‘Tipo de Movimentação’, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, igual a “TE– Transferência de Entrada” ou “TS-Transferência de Saída”, deverá ser informada a data efetiva da movimentação.
- Quando ‘Tipo de Movimentação’, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, igual a “AM-Amortização “ ou “EX-Exercício”, deverá ser informada a data em que o respectivo evento foi registrado na carteira.
- Quando ‘Tipo de Movimentação’, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, igual a “AT-Tomador de Aluguel” ou “AD-Doador de Aluguel”, deverá ser informada a data de registro da operação de aluguel.

Em todos os casos, a data deve ser anterior ou igual à data atual.

Exemplo: <dtoperacao>**20060501**</dtoperacao>

Quantidade – Deverão ser observados os seguintes critérios:

- Quando ‘Tipo de Movimento’, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, igual a “CP-Compra” ou “VD-Venda”, deve ser informada a quantidade negociada na data da operação.
- Quando se tratar de eventos corporativos de caráter financeiro, deverá ser informada a quantidade de ativos sob o qual foi gerado o direito.
- Quando se tratar de evento não-financeiro mas liquidado através de uma movimentação de ações (por exemplo, desdobramento e grupamento), deverá ser informada a quantidade de ativos que foi movimentada (por exemplo, a quantidade de ativos recebida em desdobramento ou a quantidade retirada da carteira devido à um grupamento).
- Quando ‘Tipo de Movimentação’, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, igual a “TE-Transferência de Entrada” ou “TS-Transferência de Saída”, deverá ser informada a quantidade transferida.

Exemplo: <qtd>**2000.00**</qtd>

Lote – Tamanho do lote na ‘Data da Operação’. Permite valores de lotes inteiros e fracionários.

Exemplo: <lote>**1000**</lote >

PU por Movimentação - É o valor do PU na data da operação. Quando ‘Tipo de Movimentação’, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, igual a “TE-Transferência de Entrada” ou “TS-Transferência de Saída”, deverá ser informado o PU valorizado na data da transferência. Quando ‘Tipo Movimentação’ for igual a “OU-Outros”, “DE-Desdobramento Split”, “GR-Grupamento Inplit”, “BO-Bonificação”, “DS-Direitos de Subscrição”, ou seja, eventos não financeiros, o PU será informado com o valor zero. No caso de eventos financeiros, o PU deve corresponder ao valor financeiro a ser pago.

Exemplo: <pu>**25.00**</pu>

PU Aquisição - É o valor do PU dos ativos quando registrados na carteira. Quando ‘Tipo de Movimento’, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, igual a “CP-Compra”, valor é igual ao valor do PU de compra. No caso de ‘Tipo de Movimento’ igual a “TE-Transferência de Entrada”, “TS-Transferência de Saída” ou “VD-Venda”, esse valor é o PU valorizado (custo médio unitário) do título de quando este entrou na carteira. No caso de recebimento de direitos de subscrição, definido no ‘Tipo de Movimento’ igual a “DS-Direito de Subscrição”, o PU é zero. Não deverá considerar os valores de correspondente a Corretagem e Emolumentos, uma vez que já existe campos específicos para essas informações, ‘Emolumentos’ e ‘Corretagem Líquida’.

Exemplo: <puaquisição>**25.00**</puaquisição>

Valor Financeiro – É o resultado da operação financeira, igual a (Quantidade/Lote) * PU. Não deverá englobar aqui os valores correspondentes a corretagem e emolumentos, uma vez que existe campos específicos para essas informações, 'Emolumentos' e 'Corretagem Líquida'.

Exemplo: <valorfindisp>50000.00</valorfindisp>

Tipo de Movimentação – Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**.

Exemplo: <tpmov>CP</tpmov>

CNPJ Corretora – Número do CNPJ da Corretora. No caso de eventos, o CNPJ a ser informado deve ser o do Custodiante (Agente de Custódia) sob a qual a posição que gerou o direito está registrada.

Exemplo: <cnjCorretora>30254320001184</cnjCorretora>

After-Market – Informa se a operação foi realizada no *After-Market da BM&FBOVESPA*.

“S” – Sim

“N” - Não

Exemplo: <aftermarket>S</aftermarket>

Corretagem Líquida – Valor da corretagem líquida já descontada o valor do repasse.

Exemplo: <corliq>200</corliq>

Emolumentos – Valor do Emolumento e Taxa de Registro

Exemplo: <emol>5000.00</emol>

Valor do Tributo – Valor total dos tributos cobrados na operação.

Exemplo: <tributos>50.00</tributos>

Local de Negociação - Código que identifica o local de negociação, de acordo com a **Tabela de Local de Negociação**.

Exemplo: <localnegoc>2</localnegoc>

CNPJ da Contraparte – Número do CNPJ que identifica a Contraparte. Quando reportando um evento, colocar o CNPJ do Agente de Custódia sob o qual o ativo está registrado. Se ‘Local de Negociação’ for diferente de “4-Exterior”, campo é mandatório. O campo deverá ser preenchido somente com números.

Exemplo: <cnjcontraparte>**30254362000118**</cnjcontraparte>

Nome da Contraparte – Nome da Contraparte. Quando reportando um evento, colocar o Nome do Agente de Custódia, sob o qual o ativo está registrado. Se ‘Local de Negociação’ for igual à “4-Exterior”, campo é mandatório.

Exemplo: <nomecontraparte>**FUNDAÇÃO XPTO**</nomecontraparte>

Identificador Interno do Ativo – Código que identifica o movimento do ativo nos sistemas internos da instituição geradora do arquivo.

Exemplo: <idinternoativo>**3156464654**</idinternoativo>

SUBSEÇÃO ALUGUEL: Subseção de Compromisso definida pela tag <Aluguel>

CNPJ do Intermediário do Aluguel – Número do CNPJ da Instituição Financeira que intermediou a operação de aluguel. O campo deverá ser preenchido somente com números

Exemplo: <cnjluguel>**30254362000118**</cnjluguel>

Taxa de Aluguel – Custo, em valor percentual ao ano, a ser pago pelo Tomador e Doador do ativo. O campo deverá ser preenchido somente com números.

Exemplo: <txaluguel>**2.2**</txaluguel>

Data do Vencimento – Data de vencimento contratual do aluguel.

Exemplo: <dtvencaluguel>**20060701**</dtvencaluguel>

IMPORTANTE:

- Os campos “**Quantidade Movimentada**” e “**Valor Financeiro**” poderão apresentar valor zero quando houver movimentações relacionadas a “**Split**” e “**Inplit**” de Ações. Nestes casos, há movimentações de ativos sem movimentação financeira.

SEÇÃO OPÇÕES FLEXÍVEIS

Nesta seção deverão ser lançadas as opções flexíveis que foram movimentadas no fundo ou na carteira na data de movimentação, definida pela tag <opcoesflx>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõem esta seção:

Código ISIN – Código para identificação do ativo fornecido pela *BVMFou* pela *Agência de Numeração do País* que emitiu o Título.

Exemplo: <isin>BRMACHDBS011</isin>

Código do Ativo - Código para identificação do ativo fornecido pelo ambiente de negociação e/ou registro da operação.

Exemplo: <codativo>BDLL4</codativo>

Tipo de Opção – Identificar se a opção pode ser exercida a qualquer tempo (Americana) ou somente na data de seu vencimento (Européia). Preencher com:

“A” – Americana

“E” – Européia

Exemplo: <tipo>A</tipo>

Data da Operação - Data em que ocorreu a operação, ou seja, data em que a operação foi reajustada na carteira.

Exemplo: <dtoperacao>20060225</dtoperacao>

Data Exercício – Data de exercício da opção.

Exemplo: <dtexercicio>20060630</dtexercicio>

Quantidade - Quantidade movimentada na data da operação.

Exemplo: <qtd>2500.00</qtd>

PU – PU na data da operação. Quando ‘Tipo de Movimento’, de acordo com a *Tabela de Tipo de Movimento*, igual a “TE-Transferência de Entrada” ou “TS-Transferência de Saída”, o PU informado deverá ser o PU valorizado na data da operação.

Exemplo: <pu>10.00</pu>

Preço do Exercício - Valor definido para o exercício do direito da referida opção.

Exemplo: <precoexercicio>15.00</precoexercicio>

Valor Financeiro – Resultado da multiplicação 'PU' X 'Quantidade'

Exemplo: <valorfinanceiro>25000.00</valorfinanceiro>

Corretagem Líquida – Valor da corretagem líquida, já descontado o valor do repasse.

Exemplo: <corliq>200</corliq>

Emolumentos – Valor do Emolumento e Taxa de Registro

Exemplo: <emol>5000.00</emol>

CNPJ Corretora – Número do CNPJ da Corretora que intermediou a operação.

Exemplo: <cnpjcorretora>30254362000118</cnpjCorretora>

Local de Negociação – Código que identifica o local de negociação, de acordo com a *Tabela de Local de Negociação*.

Exemplo: <localnegoc>2</localnegoc>

Valor do Tributo – Valor total dos tributos cobrados na operação.

Exemplo: <tributos>50.00</tributos>

Garantia – Identificar se há garantias associadas a posição de opções.

“S” – Sim

“N” – Não

Exemplo: <garantia>S</garantia>

Tipo de Movimentação – Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a *Tabela de Tipo de Movimento*.

Exemplo: <tpmov>CP</tpmov>

SUBSEÇÃO BARREIRA: Subseção de Compromisso definida pela tag <Barreira>

Tipo Barreira – Tipo da Barreira.

“1” – knock in

“2” – knock out

Exemplo: <tpbarreira>2</tpbarreira>

Limite Barreira – Valor do limite da barreira.

Exemplo: <limitebarreira>2.2</limitebarreira>

SEÇÃO TERMO DE AÇÕES

Nesta seção deverão ser lançadas as operações de termo de ações, que foram movimentadas no fundo ou na carteira na data de movimentação, definida pela tag <termoacoes> tratando apenas de Compras a Vista e Venda à Termo. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõem esta seção:

Código ISIN - Código para identificação do ativo objeto fornecido pela *BVMF* ou pela *Agência de Numeração do País* que emitiu o Título. Caso o campo 'Código CUSIP' for preenchido, este campo não será mandatório. Ao contrário, o campo é mandatório.

Exemplo: <isin>**BRCPFACNORO**</isin>

Código CUSIP - Código para identificação do ativo objeto fornecido pelo *CUSIP*. Caso o campo 'Código ISIN' for preenchido, este campo não será mandatório. Ao contrário, o campo é mandatório.

Exemplo: <cusip>**513569751578**</cusip>

Código do Ativo - Código para identificação do ativo base fornecido pela *SELIC* ou ambiente de negociação e/ou registro da operação.

Exemplo: <codativo>**BDLL4**</codativo>

Data da Contratação – Este campo deve ser preenchido com a data do registro da operação da carteira quando se abre uma operação a termo ou com a data de liquidação, quando a operação é liquidada antes do vencimento contratual.

Exemplo: <dtcont>**20060621**</dtcont>

Data do Vencimento – Data de vencimento da operação ou data de vencimento a termo. Esta data não é a data da liquidação.

Exemplo: <dtvenc>**20060701**</dtvenc>

PU da Operação – o PU acordado na contratação (compra ou venda).

Exemplo: <pu>**20.00**</pu>

Quantidade - Quantidade movimentada.

Exemplo: <qtd>**45000000.00**</qtd>

Valor Financeiro – Valor resultante da operação. ('Quantidade' * 'PU da Operação').

Exemplo: <valorfinanceiro>**900000.00**</valorfinanceiro>

Corretagem Líquida – Valor da corretagem líquida, já descontado o valor do repasse.

Exemplo: <corliq>**200**</corliq>

Emolumentos – Valor do emolumento e taxa de registro.

Exemplo: <emol>**5000.00**</emol>

Valor do Tributo – Valor total dos tributos cobrados na operação.

Exemplo: <tributos>**50.00**</tributos>

Tipo de Movimentação – Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a *Tabela de Tipo de Movimento*.

Exemplo: <tpmov>**CP**</tpmov>

Local de Negociação – Código que identifica o local de negociação, de acordo com a *Tabela de Local de Negociação*.

Exemplo: <localnegoc>**1**</localnegoc>

CNPJ da Corretora - Número do CNPJ que identifica a Corretora. Se 'Local de Negociação' for diferente de "4-Exterior", campo é obrigatório. O campo deverá ser preenchido somente com números.

Exemplo: <cnpjcorretora>**30254362000118**</cnpjcorretora>

Nome da Corretora – Nome da Corretora. Se 'Local de Negociação' for igual à "4-Exterior", campo é obrigatório.

Exemplo: <nomecorretora>**CORRETORA XPTO**</nomecorretora>

SEÇÃO TERMO RENDA FIXA

Nesta seção deverão ser lançadas as operações a termo com títulos de renda fixa que foram movimentadas no fundo ou na carteira na data de movimentação, definida pela tag <termorf>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõem esta seção:

Código ISIN - Código para identificação do ativo objeto fornecido pela *BVMF* ou pela *Agência de Numeração do País* que emitiu o Título. Caso o campo 'Código CUSIP' for preenchido, este campo não será mandatório. Ao contrário, o campo é mandatório.

Exemplo: <isin>**BRCPFACNORO**</isin>

Código CUSIP - Código para identificação do ativo objeto fornecido pelo *CUSIP*. Caso o campo 'Código ISIN' for preenchido, este campo não será mandatório. Ao contrário, o campo é mandatório.

Exemplo: <cusip>**513569751456**</cusip>

Data da Operação – Data em que foi realizado o registro da operação na carteira.

Exemplo: <dtoperacao>**20060409**</dtoperacao>

Data de Liquidação – Data da liquidação financeira.

Exemplo: <dtliquidacao>**20060103**</dtliquidacao>

Quantidade - Quantidade movimentada na data da operação.

Exemplo: <qtd>**2000.00**</qtd>

PU Operação – PU na data da operação. Quando 'Tipo de Movimento', de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, igual a "TE-Transferência de Entrada" ou "TS-Transferência de Saída" entre carteiras e ou instituições, o PU informado deverá ser o PU valorizado na data da operação.

Exemplo: <pu>**23.00**</pu>

Tipo de Movimentação – Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**.

Exemplo: <tpmov>**CP**</tpmov>

Valor Financeiro – Valor do ativo correspondente na data de operação. ‘PU Operação’ X ‘Quantidade movimentada’.

Exemplo: <valorfinanceiro>**900000.00**</valorfinanceiro>

Valor do Tributo – Valor total dos tributos cobrados na operação.

Exemplo: <tributos>**50.00**</tributos>

Taxa da Operação – Valor percentual da taxa da operação. O campo deve ser preenchido apenas com números.

Exemplo: <txoper>**20**</txoper>

Indexador - Código do indexador conforme cadastro na Tabela da BVMF. Para consultar os referidos códigos acesse o site:

<http://www.bmfbovespa.com.br/pt-br/regulacao/horarios-de-negociacao/derivativos.aspx?Idioma=pt-br>

Exemplo: <indexador>**SWP**</indexador>

Local de Negociação – Código que identifica o local de negociação, de acordo com a *Tabela de Local de Negociação*.

Exemplo: <localnegoc>**2**</localnegoc>

CNPJ da Contraparte - Número do Cnpj que identifica a Contraparte. Se ‘Local de Negociação’ for diferente de “4-Exterior”, campo é mandatório. O campo deverá ser preenchido somente com números.

Exemplo: <cnjcontraparte>**30254362000118**</cnjcontraparte>

Nome da Contraparte – Nome da Contraparte. Se ‘Local de Negociação’ for igual à “4-Exterior”, campo é mandatório.

Exemplo: <nomecontraparte>**FUNDAÇÃO XPTO**</nomecontraparte>

SEÇÃO FUTUROS, OPÇÕES DE FUTUROS E DISPONÍVEIS

As movimentações de Opção sobre Futuro DI, Opção IDI, Disponíveis deverão ser informadas nesta seção, definido pela tag <futuros>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõe esta seção:

Código do Ativo - Código para identificação do ativo fornecido pelo ambiente de negociação.

Exemplo: <codativo>**FUTDI1**</codativo>

Serie - Série da operação conforme cadastro no ambiente de negociação.

Exemplo: <serie>**N07**</serie>

Código ISIN - Código para identificação do ativo fornecido pela *BVMF* ou pela *Agência de Numeração do País* que emitiu o Título.

Exemplo: <isin>**BRBMEFD110J2**</isin>

Data da Operação – Data do registro da operação na carteira

Exemplo: <dtoperacao>**20060409**</dtoperacao>

Quantidade - Quantidade de contratos e/ou opções movimentada.

Exemplo: <qtd>**2000.00**</qtd>

PU – PU na data da operação.. Quando ‘Tipo de Movimento’, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**, igual a “TE-Transferência de Entrada” ou “TS-Transferência de Saída”, o PU informado deverá ser o PU valorizado na data da operação.

Exemplo: <pu>**23.00**</pu>

Valor Total da Operação – Valor total atualizado dos contratos na data da operação. ‘Quantidade’ X ‘PU’ X ‘Tamanho do Contrato’.

Exemplo: <vltotalpos>**1000000.00**</vltotalpos>

Local de Negociação – Código que identifica o local de negociação, de acordo com a **Tabela de Local de Negociação**.

Exemplo: <localnegoc>**2**</localnegoc>

CNPJ da Corretora – Número do CNPJ que identifica a Corretora. Se ‘Local de Negociação’ for diferente de “4-Exterior”, campo é obrigatório. O campo deverá ser preenchido somente com números.

Exemplo: <cnjcorretora>**30254362000118**</cnjcorretora>

Nome da Corretora – Nome da Corretora. Se ‘Local de Negociação’ for igual à “4-Exterior”, campo é obrigatório.

Exemplo: <nomecorretora>**CORRETORA XPTO**</nomecorretora>

Corretagem Líquida – Valor da corretagem líquida, já descontado o valor do repasse.

Exemplo: <corliq>**200**</corliq>

Emolumentos – Valor do emolumento e da taxa de registro.

Exemplo: <emol>**5000.00**</emol>

Valor do Tributo – Valor total dos tributos cobrados na operação.

Exemplo: <tributos>**50.00**</tributos>

Tipo de Movimentação – Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**

Exemplo: <tpmov>**CP**</tpmov>

SEÇÃO SWAP

Nesta seção deverão ser lançadas as movimentações relativas aos contratos de swap do fundo ou da carteira, definido pela tag <swap>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõe esta seção:

Código ISIN - Código para identificação do tipo de swap da operação, fornecido pela BVMFou pela Agência de Numeração do País, onde a operação está registrada.

Exemplo: <isin>BRBMEFSAS001</isin>

Local de Registro – Identificar o local de registro da operação. Preencher com:

C – CETIP

B – BVMF

O - Outros

Exemplo: <cetipbmf>B</cetipbmf>

Data da Operação - Data do registro da operação da carteira.

Exemplo: <dtoperacao>20060410</dtoperacao>

Data do Registro – Data de registro da operação no local de registro.

Exemplo: dtregistro>20060103</dtregistro>

Data do Vencimento - Data do Vencimento da operação.

Exemplo: <dtvencimento>20060105</dtvencimento>

CNPJ da Contraparte - Número do Cnpj da Contraparte na operação. O campo deverá ser preenchido somente com números.

Exemplo: <cnpjcontraparte>3025436250007117</cnpjcontraparte>

Nome da Contraparte – Nome da Contraparte. Se o ‘Local de Registro’ for igual “OU- Outros” o campo é mandatório.

Exemplo: <nomecontraparte>CORRETORA XPTO</nomecontraparte>

Valor Notional – Valor principal negociado entre as partes no contrato.

Exemplo: <vlnotional>50000.00</vlnotional>

Valor da Ponta Ativa – Valor da ponta ativa na data da operação.

Exemplo: <vlptativo>50000.00</vlptativo>

Taxa Ativo – Taxa negociada entre as partes da posição ativa. O campo deverá ser preenchido apenas com números.

Exemplo: <taxaativo>10.00</taxaativo>

Indexador Ativo – Código do indexador que valoriza a posição ativa. Para consulta de códigos acesse o site:

<http://www.bmfbovespa.com.br/pt-br/regulacao/horarios-de-negociacao/derivativos.aspx?Idioma=pt-br>

Exemplo: <indexadorativo>SDT</indexadorativo>

Percentual do Índice Ativo – Percentual do indexador utilizado na valorização da posição ativa. O campo deverá ser preenchido apenas com números.

Exemplo: <percindexativo>2.00</percindexativo>

Valor da Ponta Passiva - Valor da ponta passiva na data da operação.

Exemplo: <vlptpassivo>50000.00</vlptpassivo>

Taxa Passivo - Taxa negociada entre as partes da posição passiva. O campo deverá ser preenchido apenas com números.

Exemplo: <taxapassivo>10.00</taxapassivo>

Indexador Passivo - Código do indexador que valoriza a posição passiva.

Exemplo: <indexadorpassivo>DOL</indexadorpassivo>

Percentual do Índice Passivo - Percentual do indexador utilizado na valorização da posição passiva. O campo deverá ser preenchido apenas com números.

Exemplo: <percindexpassivo>2.00</percindexpassivo>

Valor do Tributo – Valor total dos tributos cobrados na operação.

Exemplo: <tributos>50.00</tributos>

Identificador Interno do Ativo - Código que identifica o movimento do ativo nos sistemas internos da instituição geradora do arquivo.

Exemplo: <idinternoativo>3123121313</idinternoativo>

Tipo de Movimentação – Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**.

Exemplo: <tpmov>CP</tpmov>

SUBSEÇÃO PRÊMIO: Subseção de Compromisso definida pela tag <premio>

Valor do Prêmio – Valor do prêmio da operação.

Exemplo: <vlpremio>2</vlpremio>

Opção de Arrependimento – Opção de arrependimento.

“S” – Sim

“N” - Não

Exemplo: <arrependimento>S</arrependimento>

SEÇÃO COTAS

Nesta seção deverão ser informadas as movimentações de cotas adquiridas ou alienadas por outros fundos ou carteiras administradas, definido pela tag <cotas>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõe esta seção:

CNPJ do Fundo - CNPJ do fundo objeto do investimento, conforme cadastro na Receita Federal. Preencher apenas com números.

Exemplo: <cnjfund>**25945765000135**</cnjfund>

Código ISIN - Código para identificação do fundo, fornecido pela *BMF&BOVESPA* ou pela *Agência de Numeração do País* que emitiu o Título.

Exemplo: <isin>**BRMCGVCTF002**</isin>

Data da Operação - Data em que foi registrada a operação na carteira.

Exemplo: <dtoperacao>**20060410**</dtoperacao>

Tipo de Movimentação – Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a *Tabela de Tipo de Movimento*.

Exemplo: <tpmov>**CP**</tpmov>

Data de Conversão – Data de conversão das cotas.

Exemplo: <dtconversao>**20060620**</dtconversao>

Quantidade - Quantidade de cotas movimentadas. Caso a conversão das cotas seja diferente de D0, a quantidade de cotas será igual a zero (não estará disponível em D0), devendo informar o valor financeiro.

Exemplo: <qtd>**2000.00**</qtd>

PU – Valor da cota na data da operação. Quando for transferência de ativos, o PU informado será o valor da cota valorizada na data da operação. Se “Data de conversão” diferente de “D0”, PU não mandatário.

Exemplo: <pu>**23.00**</pu>

Valor Financeiro – Resultado da operação ‘Quantidade’ X ‘PU’. O campo deve ser preenchido mesmo quando data de conversão é diferente de D0 (neste caso, a quantidade cotas ainda estará indisponível).

Exemplo: <valorfinanceiro>900000.00</valorfinanceiro>

Data de Liquidação – Data da liquidação financeira.

Exemplo: <dtliquidacao>20060103</dtliquidacao>

Local de Negociação – Código que identifica o local de negociação, de acordo com a *Tabela de Local de Negociação*.

Exemplo: <localnegoc>1</localnegoc>

CNPJ da Contraparte - CNPJ da contraparte. Se o Local de Negociação for diferente de “4-Exterior” e fundo Fechado, o campo é mandatório.

Exemplo: <cnpjcontraparte>30254362000118</cnpjcontraparte>

Nome da Contraparte – Nome da Contraparte. Se o Local de Negociação for diferente de “4-Exterior” e fundo Fechado, o campo é mandatório.

Exemplo: <nomecontraparte>CORRETORA XPTO</nomecontraparte>

Aplicação Inicial – Classificação se é ou não uma aplicação inicial.

“S” – Sim

“N” – Não

Exemplo: <aplicacaoinicial>N</aplicacaoinicial>

Resgate Total– Classificação se é ou não um resgate total.

“S” – Sim

“N” – Não

Exemplo: <resgatetotal>S</resgatetotal>

Valor do Tributo – Valor total dos tributos cobrados na operação.

Exemplo: <tributos>50.00</tributos>

IMPORTANTE:

- As amortizações de cotas (FIDC ou FIP) não devem ser consideradas nas Movimentações de Cotas, pois as amortizações não interferem na quantidade. Assim a quantidade a ser informada, é aquela sobre a qual está sendo paga a amortização. Este valor multiplicado pelo valor do PU resulta no Valor Financeiro Amortizado.
- O campo 'Nome da Contraparte' ou 'CNPJ da Contraparte' só será informada quando existir Mercado Secundário de Fundos, Fundos no Exterior e Fundos Fechados (que podem ser negociados na BVMF ou em ambiente de negociação no exterior). Quando se tratar de Fundos Abertos não precisa ser informado a Contraparte.

SEÇÃO CAIXA

Nesta seção deverão ser informadas as movimentações (débito e crédito) efetuadas na conta corrente do fundo ou da carteira na data de movimentação, definido pela tag <movcaixa>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõe esta seção:

Data do Movimento – Data em que ocorreu a movimentação no caixa.

Exemplo: <dtmovimento>20060103</dtmovimento>

Valor – Valor do movimento.

Exemplo: <vlmovimento>50.00</vlmovimento>

Tipo do Lançamento – Tipo do Lançamento.

“D” – Débito

“C” - Crédito

“E” – Estorno

Todo lançamento de despesas está sujeito a ser estornado. Neste caso, deve ser informado o código “E”. No caso de lançamentos de caixa estornados relacionados a uma liquidação de operação com ativos, deverão ser usados os códigos “C” ou “D”, contrário ao código utilizado no lançamento original.

Exemplo: <tiplancamento>D</tiplancamento>

Código do Lançamento – Código do lançamento, de acordo com a **Tabela Descrição do Lançamento**.

Exemplo: <codlanc>50</codlanc>

Identificador Interno do Ativo - Código que identifica o movimento do caixa nos sistemas internos da instituição geradora do arquivo. Para ativos fungíveis (ativos de renda variável, futuros, opções de futuros e disponíveis) , este campo deverá ser informado somente se for possível indicar o ativo relacionado ao movimento em caixa reportado.

Exemplo: <idinternoativo>3123121313</idinternoativo>

SEÇÃO CARTEIRA IMOBILIÁRIA

Nesta seção deverão ser informadas as movimentações dos imóveis de propriedade do fundo ou do titular da carteira, definida na tag <imoveis>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõe esta seção:

Data da Operação – Data em que foi realizado o registro da operação na carteira.

Exemplo: <dtoperacao>**20041126**</dtoperacao>

Endereço do Imóvel - Logradouro – Logradouro do imóvel.

Exemplo: <logradouro>**AVENIDA BRIGADEIRO FARIA LIMA**</logradouro>

Endereço do Imóvel - Número – Número do endereço do imóvel.

Exemplo: <numero>**2179**</numero>

Endereço do Imóvel - Complemento – Dados complementares ao logradouro que determinem a exata localização do imóvel (bloco; sala; andar).

Exemplo: <complemento>**2 ANDAR**</complemento>

Endereço do Imóvel - Cidade – Cidade onde se localiza o logradouro.

Exemplo: <cidade>**SAO PAULO**</cidade>

Endereço do Imóvel - Estado – Código da Unidade Federativa (UF) onde se localiza o imóvel.

Exemplo: <estado>**SP**</estado>

Endereço do Imóvel - CEP – Código de Endereçamento Postal (CEP) onde se localiza o imóvel.

Exemplo: <cep>**01451001**</cep>

Nome comercial do imóvel – Nome comercial do imóvel ou nome pelo qual é conhecido.

Exemplo: <nomecomercial>**OS BANDEIRANTES**</nomecomercial>

Participação do fundo no imóvel – Participação em percentual do fundo na propriedade do imóvel. O campo deverá ser preenchido apenas com números.

Exemplo: <percpart>**100.00**</percpart>

Valor Financeiro – Valor do movimento.

Exemplo: <valorfinanceiro>**100000.00**</valorfinanceiro>

Tipo de Movimentação – Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a *Tabela de Tipo de Movimento*.

Exemplo: <tpmov>**CP**</tpmov>

Identificador Interno do Ativo - Código que identifica do movimento do ativo nos sistemas internos da instituição geradora do arquivo.

Exemplo: <idinternoativo>**3123121313**</idinternoativo>

IMPORTANTE:

- As receitas de aluguéis e as despesas referentes aos imóveis estão sendo consideradas na seção “**Movimento de Caixa**”. A associação com o Imóvel será feita através do “**Código do Ativo**”.

SEÇÃO OPÇÕES DE MOEDAS (OTC)

Nesta seção deverão ser informadas as movimentações com opções de moeda negociadas em balcão na data de movimentação, definido pela tag <opcoesmoedasotc>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõem esta seção:

Obs: Atentar para que nesta seção não sejam informados operações registradas na BVMF.

Tipo de Opção – Identificar se a opção pode ser exercida a qualquer tempo (Americana) ou somente na data de seu vencimento (Européia). Preencher com:

“A” – Americana

“E” – Européia

Exemplo: <tipopcao>A</tipopcao>

Call/Put – Identificar se a opção é uma “opção de compra” (Call) ou uma “opção de venda” (Put). Preencher com:

“C” – Call

“P” – Put

Exemplo: <callput>C</callput>

Data da Operação – Data em que foi realizado o registro da operação na carteira.

Exemplo: <dtoperacao>20051115</dtoperacao>

Data do Vencimento – Data do exercício da Opção (igual ao campo Data Exercício).

Exemplo: <dtvencimento>20060402</dtvencimento>

Data Exercício – Data de exercício das opções.

Exemplo: <dtexercicio>20060520</dtexercicio>

Moeda Ativa – Código alfabético da moeda de referência da posição ativa da operação. Identificar a moeda de acordo com os códigos definidos pela ISO (www.iso.org/iso/en/prods-services/popstds/currencycodeslist.html).

Exemplo: <moedaativa>YEN</moedaativa>

Moeda Passiva – Código alfabético da moeda de referência da posição ativa da operação. Identificar a moeda de acordo com os códigos definidos pela ISO(www.iso.org/iso/en/prods-services/popstds/currencycodeslist.html).

Exemplo: <moedapassiva>EUR</moedapassiva>

Prêmio - Soma de todos os valores de prêmios pagos (comprados) ou recebidos (vendidos) na operação.

Exemplo: <vlpremio>75000.00</vlpremio>

PU Aquisição – É o valor que está sendo registrado no Fundo/Carteira na Data de Operação. No caso de compra ou venda este valor o PU negociado, nos outros casos este valor é o PU valorizado na Data da Operação.

Exemplo: <pu>0.50</pu>

Preço do Exercício – Valor definido para o exercício do direito da referida opção.

Exemplo: <precoexercicio>0.60</precoexercicio>

Quantidade – Quantidade movimentada.

Exemplo: <qtd>50000.00</qtd>

Valor Financeiro – ‘PU Aquisição’ X ‘Quantidade’

Exemplo: <valorfinanceiro>25000.00</valorfinanceiro>

Tipo de Movimentação - Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a **Tabela de Tipo de Movimento**.

Exemplo: <tpmov>CP</tpmov>

SEÇÃO FORWARDS DE MOEDAS

Nesta seção deverão ser informadas as movimentações de operações de Forwards de Moedas (Termo) na data de registro na carteira, definido pela tag < forwardsmoedas>. Esta seção não é obrigatória e poderá existir mais de uma para cada fundo ou carteira. Segue abaixo os campos que compõem esta seção:

Tipo de Operação – Identificar o tipo de operação. Preencher com:

“**FRW**” – Operações a Termo com entrega física de moeda.

“**NDP**” – Operações a Termo sem entrega física de moeda.

Exemplo: <tipooperacao>**FRW**</tipooperacao>

Moeda Ativa – Código alfabético da moeda de referência da posição ativa da operação. Identificar a moeda de acordo com os códigos definidos pela ISO (www.iso.org/iso/en/prods-services/popstds/currencycodeslist.html).

Exemplo: <moedaativa>**BRL**</moedaativa>

Moeda Passiva – Código alfabético da moeda de referência da posição ativa da operação. Identificar a moeda de acordo com os códigos definidos pela ISO (www.iso.org/iso/en/prods-services/popstds/currencycodeslist.html).

Exemplo: <moedapassiva>**USD**</moedapassiva>

Data da Operação – Data em que foi realizado o registro da operação na carteira.

Exemplo: <dtoperacao>**20051115**</dtoperacao>

Notional – Valor do principal negociado entre as partes no contrato, na moeda ativa em reais.

Exemplo: <vlnotional>**20000.00**</vlnotional>

Forward Value – Valor da taxa de câmbio contratada entre as partes na operação.

Exemplo: <taxa>**2.2431**</taxa>

Data do Vencimento – Data do vencimento igual à data da operação.

Exemplo: <dtvencimento>**20060402**</dtvencimento>

Tipo de Movimentação – Código do Tipo de Movimentação, de acordo com a *Tabela de Tipo de Movimento*.

Exemplo: <tpmov>CP</tpmov>

Local de Registro – Código do local de negociação, de acordo com a *Tabela de Local de Negociação*. **Exemplo:** <localnegoc>1</localnegoc>

CNPJ da Contraparte - CNPJ da contraparte. Se o 'Local de Registro' for diferente de "4-Exterior", o campo é obrigatório.

Exemplo: <cnjcontraparte>30254362000118</cnjcontraparte>

Nome da Contraparte – Nome da Contraparte. Se o 'Local de Registro' é "4-Exterior", o campo é obrigatório.

Exemplo: <nomecontraparte>FUNDAÇÃO XPTO</nomecontraparte>

Data de Referência da Valorização- Data em que será publicado o preço de referência para a liquidação da operação.

Exemplo: <dtvalorizacao>20060904</dtvalorizacao>

Identificador Interno do Ativo - Código que identifica o movimento do ativo nos sistemas internos da instituição geradora do arquivo.

Exemplo: <idinternoativo>3123121313</idinternoativo>

ANEXO I – DICIONÁRIO DE TERMOS

BACEN: Banco Central do Brasil. Para maiores informações, acesse o site: www.bcb.gov.br

BMA: Clearing de administração de ativos desenvolvido pela BVMF.

BM&FBOVESPA: Bolsa de Valores de São Paulo e Bolsa de Mercadorias & Futuros. Para maiores informações, acesse o site: www.bmfbovespa.com.br

BOVESPA FIX: ambiente integrado para negociação, liquidação e custódia de títulos de renda fixa privada. É um sistema dirigido por ordens, onde as operações são fechadas eletronicamente pelo melhor preço e obedecendo a ordem cronológica.

CBLC: Câmara Brasileira de Liquidação e Custódia. Para maiores informações, acesse o site: www.cbcl.com.br

CETIP: Câmara de Liquidação e Custódia. Para maiores informações, acesse o site: www.cetip.com.br

CETIP NET: plataforma de negociação eletrônica da CETIP.

CMN: Conselho Monetário Nacional

CNPJ: Cadastro Nacional de Pessoa Jurídica. Para maiores informações, acesse o site: www.receita.fazenda.gov.br

CPF: Cadastro de Pessoa Física. Para maiores informações, acesse o site: www.receita.fazenda.gov.br

CUSIP: Committee on Uniform Security Identification Procedures, CUSIP é administrador do sistema de numeração utilizado para a realização de emissões nos EUA e Canadá. É um número, formado por 9 dígitos alfanuméricos, de identificação designado a uma emissão de ações ou títulos no mercado americano e canadense, cujo objetivo é facilitar a compensação destas operações. Para maiores informações, acesse o site: www.cusip.com

CVM: Comissão de Valores Mobiliários. Para maiores informações, acesse o site: www.cvm.gov.br

ISIN: A norma ISO 6166 ou ISIN (International Securities Identification Number) foi criada visando estabelecer uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. A BVMF é a agência numeradora brasileira, única instituição autorizada a atribuir ISINs a títulos financeiros no Brasil. Para mais informações, consulte: www.bmfbovespa.com.br

MERCADO DE BALCÃO - Mercado em que as negociações ocorrem fora do ambiente de bolsas de valores.

ISO – International Standards Organization

SELIC: Sistema Especial de Liquidação e de Custódia.

SND: Sistema Nacional de Debêntures. Para maiores informações, acesse o site: www.debentures.com.br

SOMA: é um segmento de negociação de ativos administrados pela BM&FBOVESPA, com regras específicas, diferentes das aplicáveis ao ambiente de Bolsa.

SOMA FIX: mercado de balcão organizado para a negociação de títulos de renda fixa.

SPC: Secretaria de Previdência Complementar.

SPE: Sociedade de Propósito Específico

SWIFT: As mensagens SWIFT (Society for Worldwide Interbank Financial Telecommunication) representam um sistema adotado internacionalmente cujo objetivo é estabelecer um padrão de comunicação segura sobre operações bancárias, entre os diversos bancos nacionais e estrangeiros. Para maiores informações, consulte o site: www.swift.com

TRADE DATE: Data de efetivação da Transação.

SETTLEMENT DATE: Data do fechamento do negócio, sendo o cliente em geral creditado ou debitado cinco dias úteis após a operação com títulos de empresas. No caso da negociação com títulos do Governo, a entrega será realizada no dia seguinte. O prazo é maior nas bolsas europeias, sendo de até 15 dias

AFTER MARKET: O After-market é o horário após o fechamento do pregão principal da BM&FBOVESPA, quando os investidores podem enviar ordens de compra e venda e realizar negócios pelo home-broker.

ANEXO II – TABELAS AUXILIARES

Tipo de Movimento													
Descrição	Código	RF	RV	OF	TA	TR	MF	SW	CO	MC	IM	OM	FM
Compra	CP	X	X	X	X	X	X		X		X	X	X
Venda	VD	X	X	X	X	X	X		X		X	X	X
Transferência Entrada	TE	X	X	X	X	X	X	X	X		X	X	X
Transferência Saída	TS	X	X	X	X	X	X	X	X		X	X	X
Resgate	RG	X											
Estorno	ET	X	X	X	X	X	X	X	X		X	X	X
Liquidação	LQ	X			X	X		X				X	X
Exercício	EX		X	X			X					X	
Amortização **	AM	X							X		X		
Outros(juros, correção monetária,...)	OU	X	X										
Desdobramento – Split *	DE		X										
Grupamento – Inplit *	GR		X										
Bonificação	BO		X										
Direitos de Subscrição *	DS		X										
Doadora de Aluguel	AD	X	X										

Tomador de Aluguel	AT	X	X										
Devolução Doador	DD	X	X										
Devolução Tomador	DT	X	X										
Contratação Swap	CS							X					

Tipo do Ativo	
Código	Descrição
1	Ações
2	Operação de Ações
3	Termos
4	Mercadorias
5	Contratos
6	Futuros

ANEXO II – TABELAS AUXILIARES

Local de Negociação	
Código	Descrição
1	BMA
2	Cetip Net
3	Balcão
4	Exterior
5	Bovespa Fix
6	Soma
7	Bovespa
8	BVMF
9	CBLC (Liquidação Bruta)
10	Conta Corrente(aplica somente para cotas de fundos, quando aplicação e resgate são feitas diretamente na conta do fundo)
11	Soma Fix

Descrição do Lançamento		
Código	Descrição	Débito/ Crédito/Estorno
1	Advogados	D ou E
2	Auditoria	D ou E
3	Bancárias	D ou E
4	Cartório	D ou E
5	Correspondências	D ou E
6	Impressos	D ou E
7	Jurídicos	D ou E
8	Outras Despesas Administrativas	D ou E
9	Outras Despesas Exterior	D ou E
10	Publicação de Atas	D ou E
11	Publicidade	D ou E
12	Taxa ANBIMA	D ou E
13	Taxa CETIP	D ou E
14	Taxa CVM	D ou E
15	Taxa Custódia	D ou E
16	Taxa SELIC	D ou E
17	Taxa SISBACEN	D ou E
18	Títulos Públicos	D ou C
19	Títulos Privados	D ou C
20	Debênture	D ou C
21	Ações, Opções de Ações e Direitos de Subscrição	D ou C

22	Derivativos (Opções Derivativo ou Flexíveis ou Futuros)	D ou C
23	Termo de Ações	D ou C
24	Termo SELIC	D ou C
25	Cotas – Fundo (Ingresso ou Retirada)	D ou C
26	Swap	D ou C
27	Dividendo	C
28	Juros s/ Capital Próprio	C
29	Subscrições	D
30	Juros (RF)	C
31	Empréstimo Ação	D ou C
32	Empréstimo Título Público	D ou C
33	Aluguel Imóvel	C
34	Taxa Administração	D
35	Taxa Performace	D
36	Despesa de Corretagem Bovespa	D ou E
37	Despesa de Corretagem BVMF	D ou E
38	Emolumentos	D
39	Valor Bovespa	D
40	Valor Repasse BVMF	D
41	Valor BVMF	D
42	Valor Repasse BVMF	D
43	Valor outras bolsas	D
44	Valor Repasse outras Bolsas	D

45	Saldo Inicial	D ou C
46	Saldo Final	D ou C
47	Amortização FIDC	D ou C
48	Despesas Imóvel	D ou E
49	Aplicações Cliente	C
50	Resgate Clientes	D
51	Pendência de Bolsa	D ou C
52	Cotas a Emitir	C
53	Cotas a Resgatar	D
999	Outros	D ou C

ANEXO III – COMPOSIÇÃO DO CAMPO “VALOR DOS ATIVOS” DO HEADER

O campo “Valor dos Ativos” localizado na seção “Header de Fundos”, representa o somatório dos valores dos ativos de cada seção que compõem patrimônio líquido do fundo. A regra para preenchimento do campo encontra-se exposta abaixo:

✓ **Seção Títulos Públicos**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro Disponível} + { Valor Financeiro em Garantia} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Títulos Privados**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro Disponível} + { Valor Financeiro em Garantia} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Debêntures**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro Disponível} + { Valor Financeiro em Garantia} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Ações**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro Disponível} + { Valor Financeiro em Garantia} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Opções de Ações**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Opções Derivativos**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Opções Flexíveis**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Termo Renda Variável**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Termo Renda Fixa**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Futuros**

Σ Ativos Header = {Valor dos Ajustes} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Swap**

Σ Ativos Header = {Valor de Mercado Ativo} – {Valor de Mercado Passivo} - {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Caixa**

Σ Ativos Header = {Saldo Caixa}

✓ **Seção Cotas**

Σ Ativos Header = {PU Posição} X {Quantidade} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Despesas (Taxas)**

Os valores contidos nesta seção não entram no cálculo do valor do PL do Header por se tratarem de dados informativos.

✓ **Seção Despesas (Outras)**

Os valores contidos nesta seção não entram no cálculo do valor do PL do Header por se tratarem de dados informativos.

✓ **Seção Provisões**

Os valores contidos nesta seção são contabilizados no “Contas a Pagar” (quando for débito” e no “Contas a Receber” (quando for crédito) do Header

✓ **Seção Posição de Corretagem**

Os valores contidos nesta seção não entram no cálculo do valor do PL do Header por se tratarem de dados informativos.

✓ **Seção Carteira Imobiliária**

Σ Ativos Header = {Valor Contábil}

✓ **Seção Opções de Moeda**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Forwards de Moeda**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro} – {Valor dos Tributos}

✓ **Seção Informações de Participações**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro}

✓ **Seção Direitos Creditórios**

Σ Ativos Header = {Valor Financeiro}