

27 de março de 2017
027/2017-DO

COMUNICADO EXTERNO

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

Ref.: Novo Arquivo de Saldo Analítico do Tesouro Direto.

Atendendo à solicitação dos participantes habilitados a operar no Tesouro Direto (TD), informamos que, a partir de **03/04/2017**, estará disponível, por meio da ferramenta de transferência de arquivos (MTA), novo arquivo de saldo analítico do Tesouro Direto (CATD).

O CATD conterá informações das posições dos investidores no TD, segregada por data de compra, nos mesmos moldes em que atualmente estão disponíveis na consulta de saldo analítico do portal do Tesouro Direto, <https://tesourodireto.bmfbovespa.com.br/>.

O leiaute detalhado do arquivo CATD está no Anexo deste Comunicado Externo, bem como em www.bvmfnet.com.br, Manuais, Manuais SISAR, Agentes de Custódia, Tesouro Direto. O participante que desejar receber esse arquivo deverá solicitá-lo à Superintendência de Suporte à Pós-Negociação, pelo e-mail entregadeservicos@bvmf.com.br.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria da Central Depositária de Ativos e de Registro de Operações do Mercado de Balcão, pelo telefone (11) 2565-4033 ou pelo e-mail td.operacional@bvmf.com.br.

Atenciosamente,

Cícero Augusto Vieira Neto
Diretor Executivo de Operações, Clearing e Depositária

Anexo ao Comunicado Externo 027/2017-DO

Arquivo de Saldo Analítico do Tesouro Direto – CATD

1. Conceitos básicos

O arquivo de saldo analítico do Tesouro Direto (CATD) permite que os agentes de custódia efetuem o acompanhamento dos saldos, por data de compra, dos investidores que possuem títulos públicos no TD.

Esse arquivo é processado e enviado diariamente aos agentes de custódia via MTA. Os agentes de custódia interessados em recebê-lo deverão solicitá-lo à Superintendência de Suporte à Pós-Negociação pelo e-mail entregadeservicos@bvmf.com.br, informando o código do participante, nome do arquivo (CATD) e ambiente (produção).

2. Estrutura do arquivo

Nome do arquivo: CATD – Arquivo de Saldo Analítico – Tesouro Direto.

Total de registros: esse arquivo é composto de três tipos de registro, a saber:

- Registro 00 – Header;
- Registro 01 – Identificação do saldo;
- Registro 99 – Trailer.

Tamanho de cada registro: 350 bytes.

3. Leiaute do arquivo

3.1. Registro – 00 – Header

DESCRIÇÃO DO CAMPO	CONTEÚDO	TIPO E TAMANHO	POSIÇÃO INICIAL	POSIÇÃO FINAL
01 – TIPO DE REGISTRO	FIXO “00”	N(02)	01	02
02 – NOME DO ARQUIVO	VER REDEFINIÇÃO ABAIXO	X(25)	03	27
CÓDIGO DO ARQUIVO	FIXO “CATD”	X(04)	03	06
CÓDIGO DO AGENTE DE CUSTÓDIA	CÓDIGO DO AGENTE DE CUSTÓDIA NA BM&FBOVESPA	N(15)	07	21
DATA DO MOVIMENTO INICIAL	FORMATO “DDMMAA”	N(06)	22	27
SEQUENCIAL	–	X(03)	28	30

027/2017-DO

.3.

DESCRIÇÃO DO CAMPO	CONTEÚDO	TIPO E TAMANHO	POSIÇÃO INICIAL	POSIÇÃO FINAL
03 – CÓDIGO DA ORIGEM	FIXO “BVMF”	X(04)	31	34
04 – CÓDIGO DO DESTINO	CÓDIGO DO AGENTE DE CUSTÓDIA NA BM&FBOVESPA	N(15)	35	49
05 – NÚMERO DO MOVIMENTO	SEQUENCIAL POR AGENTE, ATRIBUÍDO P/ CONTROLE DOS ARQUIVOS GERADOS	N(03)	50	52
06 – DATA DA GERAÇÃO DO ARQUIVO	AAMMDD	N(06)	53	58
07 – HORÁRIO DA GERAÇÃO DO ARQUIVO	HHMMSS	N(06)	59	64
08 – RESERVA	PREENCHIDO COM BRANCOS	X(286)	65	350

3.2. Registro – 01 – Identificação do saldo

DESCRIÇÃO DO CAMPO	CONTEÚDO	TIPO E TAMANHO	POSIÇÃO INICIAL	POSIÇÃO FINAL
01 – TIPO DE REGISTRO	01	N(02)	01	02
02 – INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	CÓDIGO DA INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	N(15)	03	17
03 – CONTA INVESTIDOR	NÚMERO DA CONTA DO INVESTIDOR	N(08)	18	25
04 – DATA DA APLICAÇÃO	DATA DA APLICAÇÃO REALIZADA PELO INVESTIDOR – DDMMAAAA	X(08)	26	33
05 – TÍTULO	NOME DO TÍTULO APLICADO	X(60)	34	93
06 – DATA DE VENCIMENTO	DATA DE VENCIMENTO DO TÍTULO	X(08)	94	101
07 – QUANTIDADE LIVRE DE TÍTULOS	QUANTIDADE DE TÍTULOS LIVRES ADQUIRIDOS PELO INVESTIDOR NA APLICAÇÃO (A QUANTIDADE TOTAL DE TÍTULOS É A SOMA DOS CAMPOS 7 E 8)	N(13,2)	102	114
08 – QUANTIDADE DE TÍTULOS BLOQUEADOS EM GARANTIA	QUANTIDADE DE TÍTULOS BLOQUEADOS EM GARANTIA ADQUIRIDOS PELO INVESTIDOR NA APLICAÇÃO (A QUANTIDADE TOTAL DE TÍTULOS É A SOMA DOS CAMPOS 7 E 8)	N(13,2)	115	127
09 – PREÇO DO TÍTULO NA APLICAÇÃO	PU DO TÍTULO NO DIA DA APLICAÇÃO	N(13,2)	128	140
10 – ÍNDICE RENTABILIDADE CONTRATADA	IPCA, IGPM, SELIC, PRÉ	X(10)	141	150

027/2017-DO

.4.

DESCRIÇÃO DO CAMPO	CONTEÚDO	TIPO E TAMANHO	POSIÇÃO INICIAL	POSIÇÃO FINAL
11 – RENTABILIDADE CONTRATADA	PARTE NUMÉRICA DA RENTABILIDADE CONTRATADA PELO INVESTIDOR NA DATA DA APLICAÇÃO	N(05,2)	151	155
12 – VALOR INVESTIDO	(QUANTIDADE DE TÍTULOS) X (PREÇO DO TÍTULO NA APLICAÇÃO)	N(13,2)	156	168
13 – PREÇO ATUAL DO TÍTULO	PU DE VENDA DE ABERTURA	N(13,2)	169	181
14 – VALOR BRUTO	VALOR BRUTO ATUAL DO INVESTIMENTO (QUANTIDADE DE TÍTULOS X PREÇO ATUAL DO TÍTULO)	N(13,2)	182	194
15 – TAXA INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	VALOR FINANCEIRO DEVIDO PELO INVESTIDOR À INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	N(13,2)	195	207
16 – TAXA BVMF	VALOR FINANCEIRO DEVIDO PELO INVESTIDOR À BVMF	N(13,2)	208	220
17 – VALOR IR	O CÁLCULO APRESENTADO É MERAMENTE INFORMATIVO, UMA VEZ QUE O VALOR DO IMPOSTO DE RENDA RETIDO NA FONTE DEVE SER RECOLHIDO PELO AGENTE DE CUSTÓDIA, QUE É O RESPONSÁVEL TRIBUTÁRIO PELO RECOLHIMENTO DESTES TRIBUTOS	N(13,2)	221	233
18 – VALOR LÍQUIDO	VALOR BRUTO SUBTRAÍDO DOS IMPOSTOS E TAXAS PREVISTOS ATÉ O MOMENTO, POR COMPRA	N(13,2)	234	246
19 – RENTABILIDADE BRUTA ACUMULADA ANUALIZADA	RENTABILIDADE ACUMULADA ANUALIZADA, LEVANDO EM CONSIDERAÇÃO O ÍNDICE DO TÍTULO (FORMATO PARA LEITURA: ÍNDICE RENTABILIDADE CONTRATADA + RENTABILIDADE BRUTA ACUMULADA ANUALIZADA)	N(05,2)	247	251
20 – RENTABILIDADE ACUMULADA	RENTABILIDADE ACUMULADA DESDE O DIA DA APLICAÇÃO ATÉ A DATA DE REFERÊNCIA DO ARQUIVO	N(05,2)	252	256
21 – RESERVA	PREENCHIDO COM BRANCOS	X(94)	257	350

027/2017-DO

.5.

3.3. Registro – 99 – Trailer

DESCRIÇÃO DO CAMPO	CONTEÚDO	TIPO E TAMANHO	POSIÇÃO INICIAL	POSIÇÃO FINAL
01 – TIPO DE REGISTRO	FIXO “00”	N(02)	01	02
02 – NOME DO ARQUIVO	VER REDEFINIÇÃO ABAIXO	X(25)	03	27
CÓDIGO DO ARQUIVO	FIXO “CATD”	X(04)	03	06
CÓDIGO DO AGENTE DE CUSTÓDIA	CÓDIGO DO AGENTE DE CUSTÓDIA NA BM&FBOVESPA	N(15)	07	21
DATA DO MOVIMENTO INICIAL	FORMATO “DDMMAA”	N(06)	22	27
SEQUENCIAL	–	X(03)	28	30
03 – CÓDIGO DA ORIGEM	FIXO “BVMF”	X(04)	31	34
04 – CÓDIGO DO DESTINO	CÓDIGO DO AGENTE DE CUSTÓDIA NA BM&FBOVESPA	N(15)	35	49
05 – NÚMERO DO MOVIMENTO	SEQUENCIAL POR AGENTE, ATRIBUÍDO P/ CONTROLE DOS ARQUIVOS GERADOS	N(03)	50	52
06 – DATA DA GERAÇÃO DO ARQUIVO	AAMMDD	N(06)	53	58
07 – HORÁRIO DA GERAÇÃO DO ARQUIVO	HHMMSS	N(06)	59	64
08 – TOTAL DE REGISTROS GERADOS	INCLUIR TAMBÉM OS REGISTROS HEADER E TRAILER	N(08)	65	72
09 – RESERVA	PREENCHIDO COM BRANCOS	X(278)	73	350