

Previc altera tabela de indexadores e regra de ISIN para os arquivos XML 4.01 e 5.0.

1. TABELA DE INDEXADORES

No campo de indexadores dos arquivos, devem ser inseridos os três caracteres da coluna SIGLA_INDEX da tabela de indexadores, disponível em:

http://www.previc.gov.br/supervisao-das-entidades/portal-de-sistemas-1/informacoes-sobre-os-sistemas-previc/informacoes-de-investimentos/tabela_indexadores.xlsx/view

Caso haja necessidade de utilização de algum indexador que não esteja cadastrado na tabela, a EFPC deverá solicitar sua inclusão ao previc.monitoramento@previc.gov.br, descrevendo detalhadamente, no mínimo:

- O indexador;
- Emissor/gerador do indexador;
- Seu país;
- O descritivo do que seria esse indexador;
- O link para consulta dos valores e metodologia;
- Sua localização na carteira da EFPC.

2. REGRAS DE ISIN e CNPJ

As regras de ISIN e CNPJ, tanto para os arquivos XML 4.01 quanto para os 5.0, foram atualizadas conforme tabela abaixo:

Ativo/Derivativo	ISIN	Origem	Layout	Obrigatoriedade do CNPJ do Emissor	Obrigatoriedade do ISIN	Uso do coringa	Outro identificador (other id)
Ativo	Existe	Nacional (B3)	4.01	Não será necessário informar	Informar o próprio código	Não aplicável	Não existe
Ativo	Existe	Nacional (B3)	5.00	Não será necessário informar	Informar o próprio código	Não aplicável	Não aplicável
Ativo	Existe	Estrangeiro	4.01	Não aplicável	Informar o próprio código	Não aplicável	Não existe
Ativo	Existe	Estrangeiro	5.00	Não aplicável	Informar o próprio código	Não aplicável	Não aplicável
Ativo	Não existe	Nacional (B3)	4.01	Obrigatório	Informar o coringa	BR0000000000	Não existe

Ativo	Não existe	Nacional (B3)	5.00	Obrigatório	Informar o coringa	BR0000000000	Não aplicável
Ativo	Não existe	Estrangeiro	4.01	Não aplicável	Informar o coringa	XX0000000000*	Não existe
Ativo	Não existe	Estrangeiro	5.00	Não aplicável	Informar o coringa	XX0000000000*	Informar o código do ativo negociado no país de origem
Derivativo	Existe	Nacional (B3) / Estrangeiro	4.01	Não aplicável	Informar o próprio código	Não aplicável	Não existe
Derivativo	Existe	Nacional (B3) / Estrangeiro	5.00	Não aplicável	Informar o próprio código	Não aplicável	Não aplicável
Derivativo	Não existe	Nacional (B3) / Estrangeiro	4.01	Não aplicável	Informar o coringa	BR0000000000 ou XX0000000000*	Não aplicável
Derivativo	Não existe	Nacional (B3) / Estrangeiro	5.00		Específico a cada tipo (Vide tabelas abaixo)	BR0000000000 ou XX0000000000*	

*O XX deve ser substituído com o código do país de dois dígitos.

Derivativo	Tabela 1	Tabela 2	ISIN do Derivativo	
			Campo XML	Situação
ACOEOPCOES	OPTN	EQUI	balForSubAcct.finInstrmId.isin	Obrigatório
FUTURO	FUTU		balForSubAcct.finInstrmId.isin	Obrigatório
SWAP	SWAP		balForSubAcct.finInstrmId.isin	Obrigatório (quando não existir informar o coringa)
OPCOESDERIVATIVOS	OPTN	DERI	balForSubAcct.finInstrmId.isin	Obrigatório (quando não existir informar o coringa)
TERMORF	FWRD	GOVE*	balForSubAcct.finInstrmId.isin	Obrigatório (quando não existir informar o coringa)
ACOESTERMOS	FWRD	EQUI	balForSubAcct.finInstrmId.isin	Obrigatório (quando não existir informar o coringa)
ACOESPRESTIMO	LOAN	EQUI	balForSubAcct.finInstrmId.isin	Informar o coringa
MOEDASOPCAO	OPTN	CURR	balForSubAcct.finInstrmId.isin	Informar o coringa
MOEDASFORWARD	FWRD	CURR	balForSubAcct.finInstrmId.isin	Informar o coringa
COMPROMISSADA	REPO	CORP*	balForSubAcct.finInstrmId.isin	Informar o coringa

*pode ser GOVE, CORP, DEBE, ETC.

Derivativo	Tabela 1	Tabela 2	ISIN do Ativo Objeto	
			Campo XML	Situação
ACOESOPCOES	OPTN	EQUI	balForSubAcct.finInstrmAttrbts.undrlygFinInstrmId.isin	Obrigatório (quando não existir informar o coringa)
FUTURO	FUTU		balForSubAcct.finInstrmAttrbts.undrlygFinInstrmId.isin	Obrigatório (quando não existir informar o coringa)
SWAP	SWAP		balForSubAcct.finInstrmAttrbts.undrlygFinInstrmId.isin	Obrigatório (quando não existir informar o coringa)
OPCOESDERIVATIVOS	OPTN	DERI	balForSubAcct.finInstrmAttrbts.undrlygFinInstrmId.isin	Obrigatório (quando não existir informar o coringa)
TERMORF	FWRD	GOVE*	balForSubAcct.finInstrmAttrbts.undrlygFinInstrmId.isin	Obrigatório (quando não existir informar o coringa)
ACOESTERMOS	FWRD	EQUI	balForSubAcct.finInstrmAttrbts.undrlygFinInstrmId.isin	Obrigatório (quando não existir informar o coringa)
ACOESEMPRESIMO	LOAN	EQUI	balForSubAcct.finInstrmAttrbts.undrlygFinInstrmId.isin	Obrigatório
MOEDASOPCAO	OPTN	CURR	balForSubAcct.finInstrmAttrbts.undrlygFinInstrmId.isin	Informar o coringa
MOEDASFORWARD	FWRD	CURR	balForSubAcct.finInstrmAttrbts.undrlygFinInstrmId.isin	Informar o coringa
COMPROMISSADA	REPO	CORP*	balForSubAcct.finInstrmAttrbts.undrlygFinInstrmId.isin	Obrigatório

*pode ser GOVE, CORP, DEBE, ETC.

Por fim, ressalta-se a importância de sempre validar os arquivos XML, antes de enviar no STA-Previc, nos validadores da Anbima.