

SISTEMA DE FUNDOS DE INVESTIMENTO (SFI) - *ORDER ROUTING*

DESCRIÇÃO FUNCIONAL
DOCUMENTO EXTERNO

Introdução	4
Modelo Funcional	5
1. Pressupostos.....	5
2. Utilizadores.....	5
3. Acesso das Sociedades Gestoras ao <i>Order Routing</i> via STD	5
4. Número de casas decimais.....	6
5. Inscrição e exercício de direitos.....	6
5.1. - Inscrição de emissões	6
5.2. - Pagamento de rendimentos.....	6
6. Encaminhamento de ordens (<i>order routing</i>)	7
7. Horário.....	7
8. Processo de encaminhamento de ordens (<i>order routing</i>)	9
8.1. Registo de pedidos de subscrição ou de resgate.....	9
8.2. Validação dos pedidos de subscrição ou de resgate	9
8.3. Aceitação ou rejeição dos pedidos de subscrição e de resgate pela Entidade Aprovadora	10
8.4. Processo de cancelamento ou alteração dos pedidos de subscrição ou de resgate.....	12
9. Liquidação	15
9.1. Liquidação das instruções de subscrição	16
9.2. Falhas na liquidação das instruções de subscrição	16
9.3. Liquidação das instruções de resgate	16
9.4. Falhas na liquidação das instruções de resgate.....	17
10. Informação e Consultas	18
11. Anexos	21
11.1. <i>Layouts</i> dos ficheiros/mensagens disponibilizados aos Intermediários Financeiros	21
11.2. <i>Layouts</i> dos ficheiros/mensagens disponibilizados à Sociedade Gestora ou Entidade Depositária/Liquidadora	31
11.3. <i>Layout</i> do ficheiro QSF - Quantidade Subscrita por Fundo e IF	43
11.4. Tabela de códigos utilizados nas mensagens SFI e SFId.....	44

Introdução

A Interbolsa dispõe de um serviço de tratamento automático e liquidação das ordens de subscrição e resgate de fundos de investimento abertos, através do registo dos pedidos pelos intermediários financeiros e de encaminhamento de ordens (*order routing*) para a entidade aprovadora (Sociedade Gestora ou Entidade Depositária), que tem como função a aceitação e a execução das mesmas.

Face ao interesse demonstrado, a Interbolsa disponibilizou uma nova funcionalidade que permite que a Sociedade Gestora possa proceder à confirmação/rejeição das operações de subscrição/resgate (Função de “Aprovador”), de fundos por si emitidos, em substituição do Banco Depositário. Esta nova funcionalidade é disponibilizada mediante pedido da Sociedade Gestora e por Fundo de Investimento.

Em caso de utilização desta funcionalidade pela Sociedade Gestora, a Entidade Depositária/Liquidadora (Banco Depositário/Banco Liquidador) passa a ter apenas a função de acompanhamento do processo das subscrições e resgates bem como da respetiva liquidação financeira, que ocorre na sua conta de cash (DCA - *Dedicated Cash Account*).

De acordo com o novo modelo funcional do Sistema de Fundos de Investimento – *order routing*, os pedidos de subscrição e resgate de unidades de participação de fundos de investimento abertos registados na Interbolsa podem ser aceites/rejeitados pela Sociedade Gestora ou pela Entidade Depositária, consoante a opção escolhida.

Caso a Sociedade Gestora escolha proceder à confirmação/rejeição dos pedidos de subscrição/resgate (Função de “Aprovador”):

- A Sociedade Gestora passa a ter acesso aos ficheiros/mensagens do Sistema de Transferência de Dados (STD) para efetuar a aceitação/rejeição dos pedidos de subscrição/resgate dos seus fundos, bem como à informação relativa à monitorização dos pedidos de subscrição/resgate e à distribuição dos fundos por si geridos;
- A Entidade Depositária/Liquidadora tem acesso à informação necessária para acompanhamento dos pedidos subscrição e resgate e pode efetuar a respetiva liquidação financeira, dado que a mesma irá ser efetuada na sua conta de cash (DCA - *Dedicated Cash Account*).

Modelo Funcional

1. Pressupostos

Os serviços descritos aplicam-se às emissões de unidades de participação de fundos de investimento abertos que revistam a forma de representação desmaterializada e estejam registados em unidades (UNIT).

A liquidação financeira é efetuada em EUR.

A infraestrutura de comunicações a usar no encaminhamento de ordens de subscrição e resgate, é o STD -Sistema de Transferência de Dados.

A Sociedade Gestora ou a Entidade Depositária devem remeter à Interbolsa a informação necessária ao funcionamento do tratamento automático das subscrições e resgates (*Order Routing*), nomeadamente a hora limite (“*cut-off time*”) de aceitação de ordens de subscrição e resgate, para cada fundo.

2. Utilizadores

Todos os Intermediários Financeiros filiados nos sistemas da Interbolsa têm acesso às funcionalidades previstas para o registo e o encaminhamento das ordens de subscrição e de resgate de unidades de participação, bem como para a liquidação das operações correspondentes.

3. Acesso das Sociedades Gestoras ao *Order Routing* via STD

A Sociedade Gestora tem acesso ao sistema de *order routing* para aceitar/rejeitar os pedidos de subscrição/resgate dos Intermediários Financeiros através do interface proprietário da Interbolsa, o STD.

A conectividade pode ser estabelecida através de circuito (s) dedicado (s) da WAN da Interbolsa (tipicamente dois circuitos – um principal e um de backup), ou através de uma ligação segura via Internet com o recurso a um “VPN Tunnel”.

Em qualquer caso não é instalada nenhuma aplicação da Interbolsa em computadores do cliente.

Para a utilização do STD é necessário a definição de utilizadores (*user-ids*):

- As pessoas autorizadas a solicitar a criação/eliminação de utilizadores têm de ser informadas pela Sociedade Gestora através de um formulário a disponibilizar pela Interbolsa (“Pessoas autorizadas a solicitar novos códigos de utilizadores e passwords”);
- Os utilizadores a criar/eliminar pela Interbolsa têm de ser solicitados pela Sociedade Gestora através de um formulário a disponibilizar pela Interbolsa, o qual terá de ser assinado por pessoa autorizada para o efeito (“Gestão de Utilizadores para STD”).

4. Número de casas decimais

A quantidade de unidades de participação, se o regulamento do fundo o permitir, pode ser especificada com números decimais.

O número de casas decimais utilizáveis varia de fundo para fundo, sendo que o sistema suporta quantidades com um máximo de **5 casas decimais**. A apresentação das quantidades é feita com 14 números inteiros e 5 casas decimais.

5. Inscrição e exercício de direitos

5.1. - Inscrição de emissões

A inscrição das emissões de unidades de participação de fundos de investimento abertos é efetuada pela Interbolsa utilizando os procedimentos habituais. Para o efeito, a Sociedade Gestora ou a entidade que a representa, deve enviar para a Interbolsa toda a informação necessária, procedendo a Interbolsa ao correspondente registo no sistema centralizado.

No decurso da vida da emissão a conta de controlo do total da emissão é atualizada em função dos sucessivos movimentos de subscrição e de resgate por contrapartida das contas dos Intermediários Financeiros.

5.2. - Pagamento de rendimentos

Os eventos de Pagamento de Rendimentos das unidades de participação dos fundos abertos são processados da

forma habitual, conforme descrito no Manual Operativo da Interbolsa.

6. Encaminhamento de ordens (*order routing*)

A funcionalidade de encaminhamento de ordens (*order routing*) permite aos Intermediários Financeiros enviar, através de mensagens ou ficheiros, em tempo real, as ordens de subscrição e de resgate dos seus clientes para a entidade responsável pela sua aceitação e execução, a Entidade Depositária ou Sociedade Gestora.

As ordens de subscrição ou de resgate podem ser registadas indicando a quantidade de unidades de participação ou o correspondente montante.

Sempre que seja efetuado o registo de um pedido de subscrição ou de resgate de unidades de participação em quantidade, o sistema valida o número de casas decimais indicadas no pedido, com o número de casas decimais permitido para a referida emissão, rejeitando os pedidos que não sejam compatíveis com o número de casas decimais definidas no sistema.

7. Horário

O registo e encaminhamento de ordens de subscrição e resgate está disponível todos os dias de funcionamento dos serviços da Interbolsa, no seguinte horário:

	Horário (WET)	Observações
Registo de pedidos de subscrição e resgate	8:30 - 16:45	
Cut-off (hora limite para que os pedidos sejam considerados para o próprio dia) indicado pela Sociedade Gestora ou Entidade Depositária	É indicado pela Sociedade Gestora (SG) ou Entidade Depositária (ED), sendo que não pode ser posterior às 16:45	Os pedidos de cancelamento efetuados após o <i>cut-off</i> do dia anterior à liquidação são rejeitados pela Interbolsa.
		Os pedidos de subscrição e resgate são enviados no próprio dia para a Entidade Depositária ou Sociedade Gestora, com indicação da data e hora de registo do pedido e, se a ordem for recebida após o <i>cut-off time</i> , será enviado o motivo “062” (Pedido registado após o <i>cut-off time</i> do fundo de investimento); caberá à Entidade Depositária ou à Sociedade Gestora decidir se considera os pedidos para esse dia ou para o dia seguinte.
Confirmação dos pedidos de subscrição e de resgate pela Entidade Depositária ou Sociedade Gestora	8:30 - 16:45	A confirmação ou a rejeição dos pedidos de subscrição ou de resgate deve ser enviada no limite até às 11:00 do dia da liquidação.
		Todos os pedidos não confirmados, pela Entidade Depositária ou pela Sociedade Gestora, até às 11:00 do dia da liquidação são cancelados pela Interbolsa. O <i>feedback</i> dos cancelamentos é enviado através de uma mensagem com o estado “CANC” (Ordem cancelada) e motivo “069” (Prazo de confirmação pela Entidade Depositária ou Sociedade Gestora expirado, pedido cancelado).
Liquidação dos pedidos de subscrição e resgate confirmados	12:00	

8. Processo de encaminhamento de ordens (*order routing*)

8.1. Registo de pedidos de subscrição ou de resgate

Os Intermediários Financeiros podem registar no sistema as ordens de subscrição ou de resgate, através do envio de uma mensagem (mnemónica **SFImsg**) ou de um ficheiro (mnemónica **SFifile**) com a indicação da quantidade de unidades de participação ou do respetivo montante a subscrever ou a resgatar, da conta de valores e da data de liquidação pretendida.

8.2. Validação dos pedidos de subscrição ou de resgate

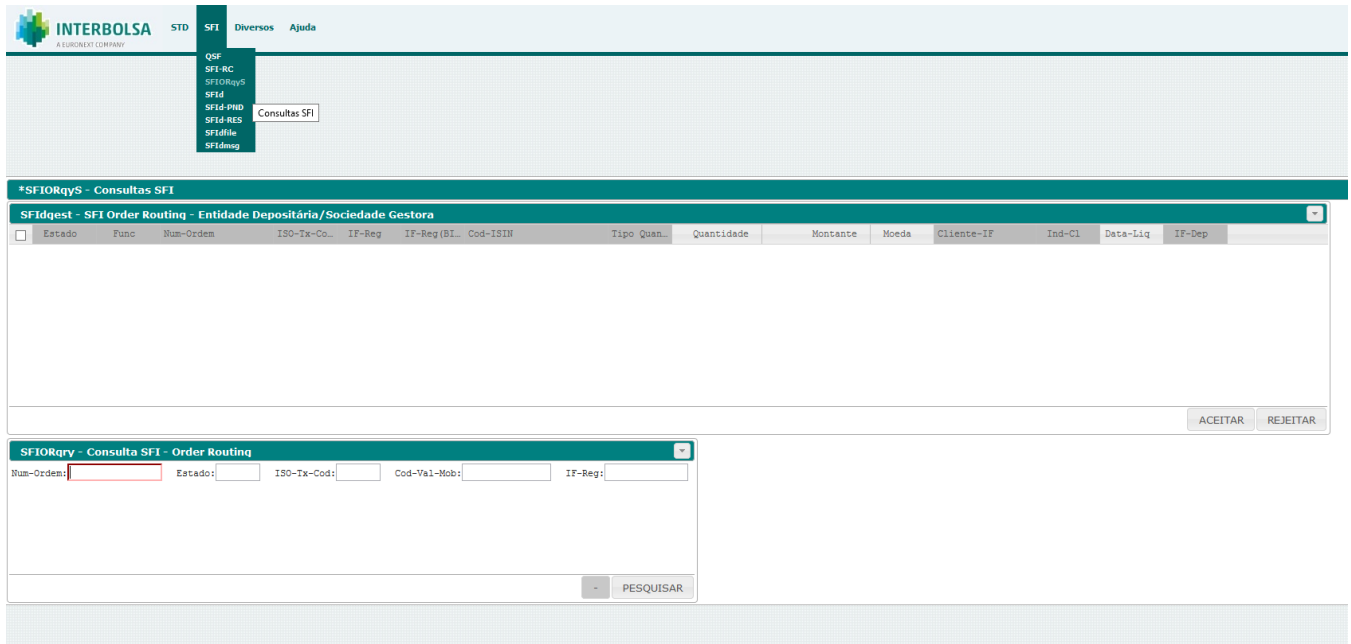
- a) O sistema valida, em tempo real, os pedidos de subscrição e resgate, nomeadamente, no que se refere à **Entidade que efetua o registo (Intermediário Financeiro - IF), valor mobiliário (ISIN/código CVM), quantidade (nº de casas decimais), conta de valores (no formato de 10 dígitos), data de liquidação e cut-off time**. Após o sucesso das validações referidas, os pedidos são aceites e numerados e a Sociedade Gestora e/ou a Entidade Depositária, bem como o Intermediário Financeiro que efetuou o pedido, recebem, em tempo real, através das mnemónicas **SFid/SFI**, respetivamente, a informação do registo dos pedidos e do respetivo número de ordem atribuído pelo sistema;
- b) No caso dos pedidos de resgate, o sistema verifica a existência de saldo na conta de valores indicada. Caso exista saldo na conta de valores, o pedido é registado e o sistema bloqueia, no T2S, os valores mobiliários (BL29), através do envio da correspondente instrução de bloqueio. Caso não exista na conta valores mobiliários a quantidade suficiente para satisfazer o pedido, a entidade aprovadora (Entidade Depositária ou Sociedade Gestora), bem como o Intermediário Financeiro que efetuou o pedido, recebem, em tempo real, através das mnemónicas **SFid/SFI**, respetivamente, informação sobre a rejeição e o pedido de resgate não é registado pelo sistema;
- c) Para os pedidos de resgate efetuados em montante, o sistema bloqueia (**BL29**) os valores na conta de valores, após a receção da confirmação da entidade aprovadora (Entidade Depositária ou Sociedade Gestora) com a indicação da quantidade a registar. Não havendo valores suficientes, o pedido é rejeitado e a entidade responsável pela sua execução (Entidade Depositária ou Sociedade Gestora) e o

Intermediário Financeiro em causa, são informados, através das mnemónicas **SFId/SFI**, respetivamente, sobre a rejeição e o pedido de resgate não é registado pelo sistema;

- d) Se um pedido de subscrição ou de resgate for rejeitado pela entidade aprovadora (Entidade Depositária ou Sociedade Gestora), o sistema marca a ordem como ‘rejeitada’ e informa o Intermediário Financeiro através da mnemónica **SFI**, e a entidade aprovadora recebe o *feedback* através da mnemónica **SFId**. Se for um pedido de resgate, os valores anteriormente bloqueados serão desbloqueados. As ‘ordens rejeitadas’ não terão qualquer processamento adicional, exceto o *reporting*.
- e) Os pedidos de subscrição e resgate de confirmação/rejeição relativos a acréscimos ou decréscimos da quantidade registada para cada fundo aceites pelo sistema, são enviados para a entidade aprovadora (Entidade Depositária ou Sociedade Gestora) e para o Intermediário Financeiro, podendo ser acompanhados via STD / menu **SFI**, mnemónicas **SFId/SFI**, respetivamente.

8.3. Aceitação ou rejeição dos pedidos de subscrição e de resgate pela Entidade Aprovadora

- a) A Entidade Aprovadora (Entidade Depositária ou Sociedade Gestora) pode efetuar a confirmação/rejeição dos pedidos recebidos via STD / menu **SFI**, através das seguintes mnemónicas:
- ficheiro **SFIdfile** – “Resposta SFI Entidade Depositária/Sociedade Gestora – Subscrição/Resgate (Ficheiro)”; ou
 - mensagem **SFIdmsg** – “Resposta SFI Entidade Depositária/Sociedade Gestora – Subscrição/Resgate”; ou
 - consulta **SFIORqry** – “Consulta SFI - Order Routing” / **SFIdgest** – “SFI Order Routing – Entidade Depositária/Sociedade Gestora.”
- b) Na opção de confirmação/rejeição de pedidos de subscrição/resgate através da mnemónica **SFIORqry** / **SFIdgest**, a Sociedade Gestora ou a Entidade Depositária, tem que efetuar os seguintes procedimentos:
- ✓ **Passo 1 – efetuar a pesquisa:** se não for indicado filtro, por defeito é apresentada a lista de todos os pedidos pendentes de confirmação (**SFIdgest**);



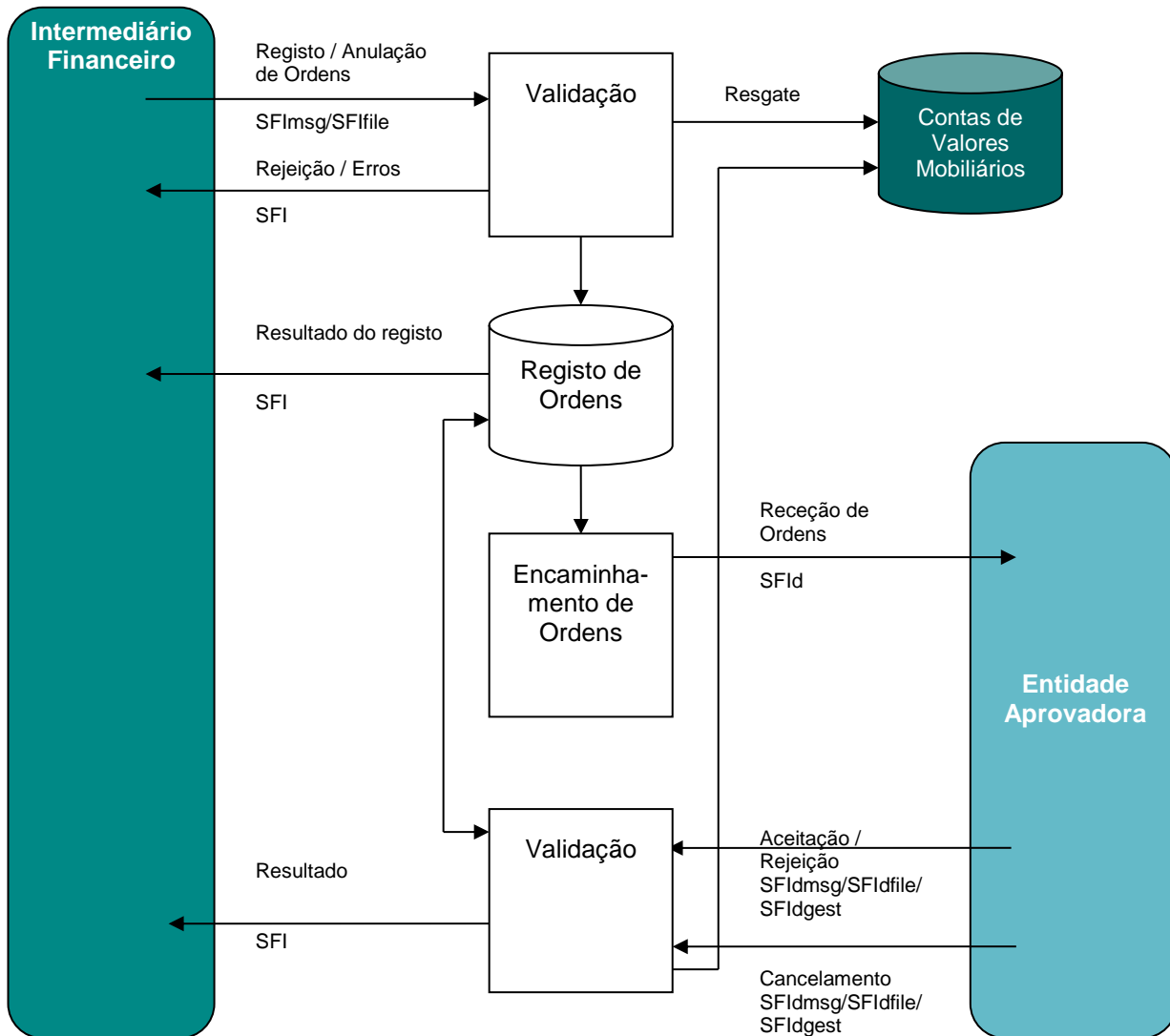
- ✓ **Passo 2 – fazer seleção:** na lista com os pedidos pendentes de confirmação (**SFIgest**), selecionar os pedidos e escolher a opção (botão) pretendida: **ACEITAR** ou **REJEITAR**.
 - ✓ No caso de ser escolhida a opção **ACEITAR** têm de ser preenchidos os campos:
 - **“Quantidade”** - se o pedido de subscrição/resgate tiver sido efetuado em **“Montante”**; ou
 - **“Montante”** e **“Moeda”** - se o pedido de subscrição/resgate tiver sido efetuado em **“Quantidade”**;
 - Os campos **“Montante”** e **“Data-Liq”** podem ser alterados pela Entidade Aprovadora.
- c) No caso de a Entidade Aprovadora ter indicado uma data de liquidação diferente da data indicada no pedido, o Intermediário Financeiro recebe, na mensagem de confirmação, informação de que a data de liquidação foi alterada - estado **“CONF”** e motivo **“064”** (Data de Liquidação alterada pela Entidade Depositária).
- d) No caso de a Entidade Aprovadora ter indicado um montante a liquidar diferente do indicado no pedido, o Intermediário Financeiro recebe, na mensagem de confirmação, informação de que o montante foi alterado - estado **“CONF”** e motivo **“063”** (Montante a liquidar alterado pela Entidade Depositária).
- e) No caso de o pedido ser efetuado em quantidade, a Entidade Aprovadora não pode alterar a quantidade, podendo apenas aceitar ou rejeitar a quantidade pedida.
- f) Os pedidos de subscrição e resgate validados e aceites são guardados no sistema até à respetiva data de liquidação, indicada no pedido ou alterada pela Entidade Aprovadora.

- g) Não é permitida a alteração de pedidos aceites pela Entidade Aprovadora e pendentes de liquidação. No entanto, um pedido anteriormente registado, e ainda não liquidado, pode ser cancelado e ser enviado um novo pedido

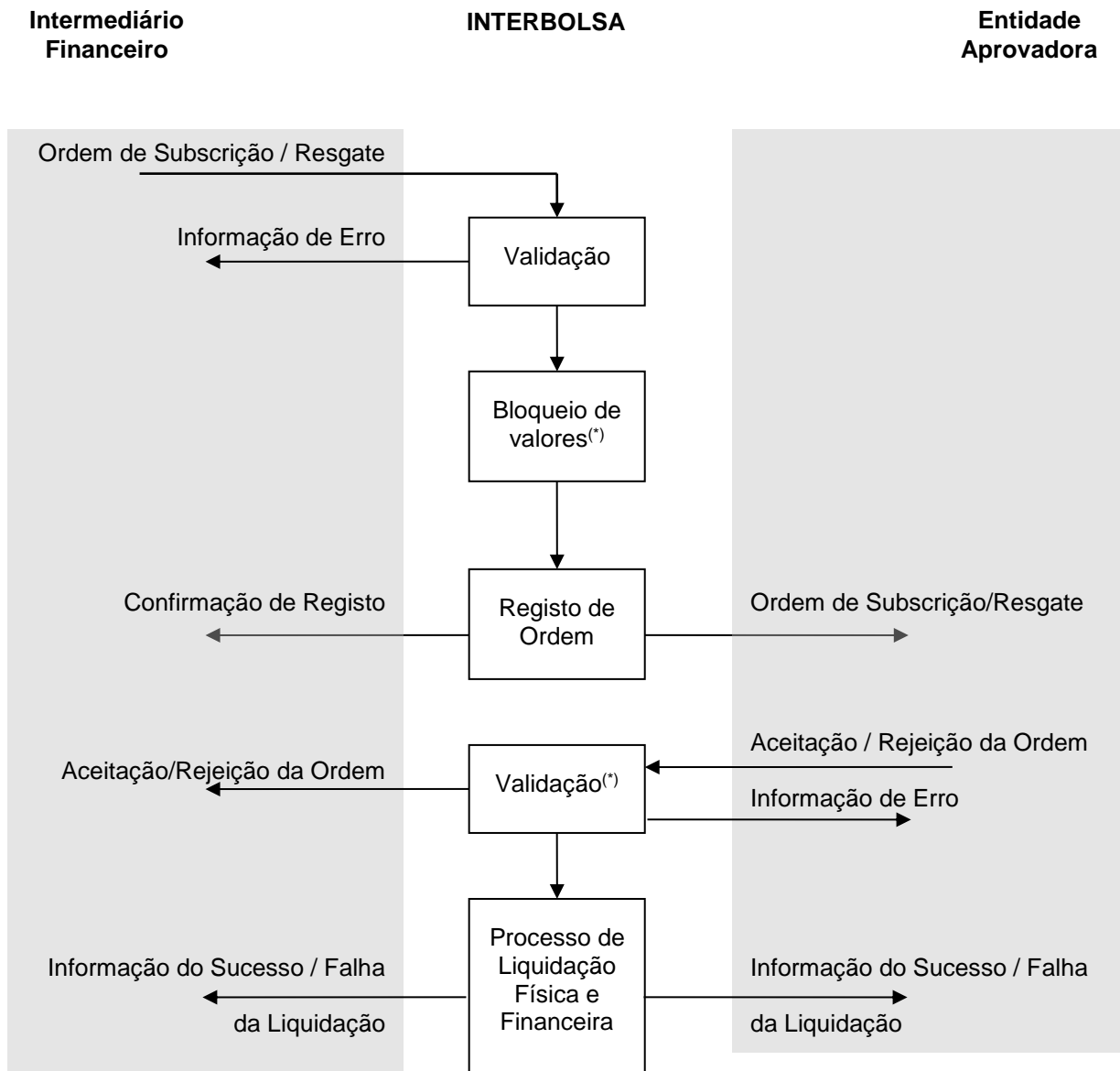
8.4. Processo de cancelamento ou alteração dos pedidos de subscrição ou de resgate

- a) Se o pedido de cancelamento de uma ordem for enviado no dia anterior ao dia da liquidação:
- ✓ **Antes do cut-off:** a Entidade Aprovadora ainda pode aceitar o cancelamento nesse dia;
 - ✓ **Após o cut-off:** o pedido é rejeitado pelo sistema e o Intermediário Financeiro recebe informação dessa rejeição.
- b) Se o cancelamento de uma instrução for aceite pela Entidade Aprovadora, o sistema marca o pedido como 'cancelado' e informa o Intermediário Financeiro, em tempo real, via mnemónica **SFI**. A Entidade Aprovadora também recebe a informação através da mnemónica **SFId**. As 'ordens canceladas' não têm qualquer processamento adicional pelo sistema, exceto o *reporting*.
- c) No caso de execução de um cancelamento de um pedido de resgate, o sistema desbloqueia automaticamente as unidades de participação anteriormente bloqueadas.
- d) A alteração de pedidos de subscrição/resgate anteriormente aceites pela Entidade Aprovadora não é permitida. Para tal, deve ser enviada um pedido de cancelamento, anulando o pedido aceite e que se encontra pendente de liquidação (que tem que ser aprovado pela Entidade Aprovadora). Posteriormente, deve ser enviado um novo pedido de subscrição/resgate para ser aceite pela Entidade Aprovadora.

Diagrama funcional do encaminhamento de ordens

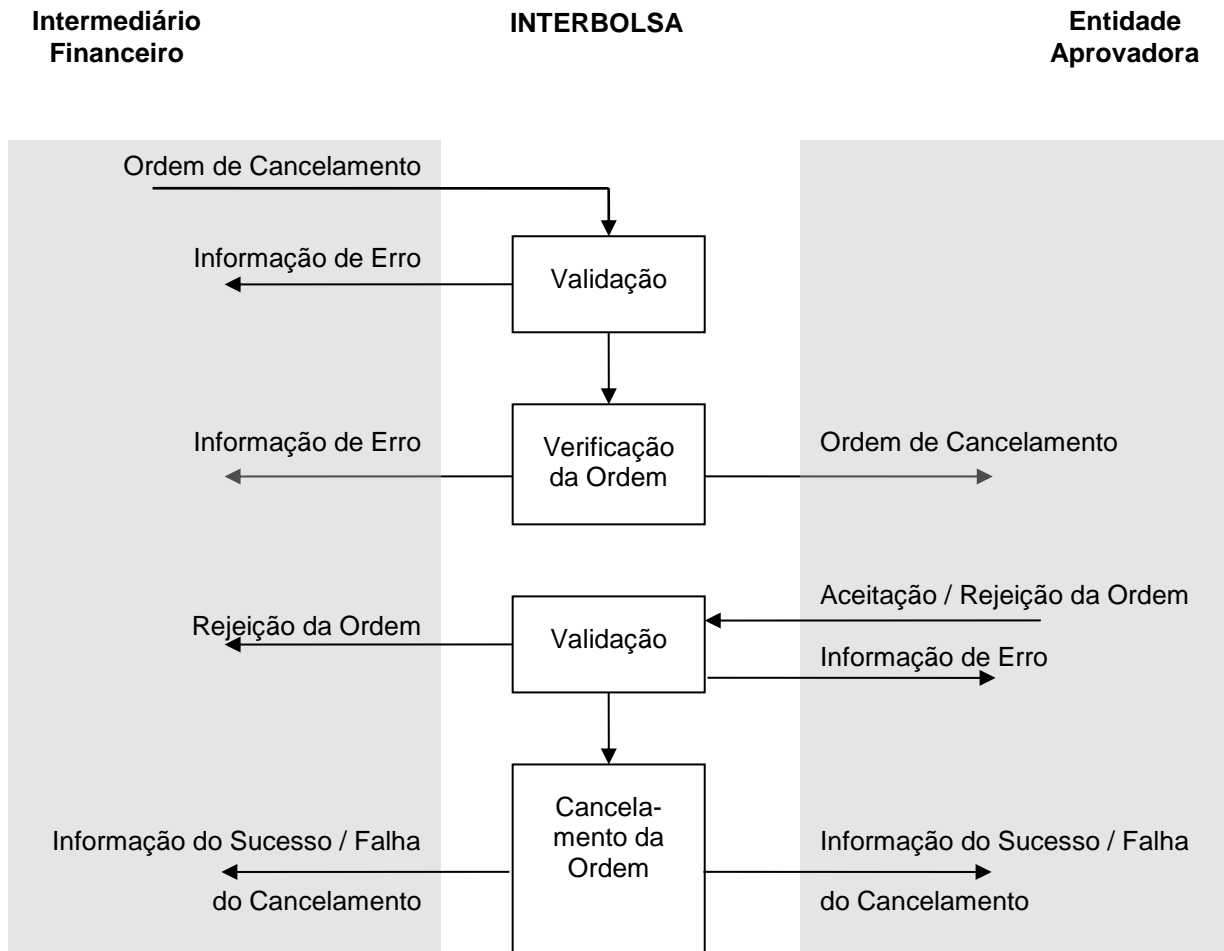


Fluxo de processamento das ordens de subscrição/resgate



(*) Só em caso de resgate. Nos resgates em quantidade, o bloqueio será efetuado num primeiro momento. Nos resgates em montante, o bloqueio só será efetuado após confirmação da entidade aprovadora e indicação da quantidade a resgatar.

Fluxo do Cancelamento de ordens de subscrição e resgate



9. Liquidação

A liquidação dos pedidos de subscrição e resgate, é efetuada às 12:00 WET do dia de liquidação, através do envio das respetivas instruções para a plataforma T2S.

9.1. Liquidação das instruções de subscrição

- a) Às 12:00 WET do dia de liquidação são enviadas para o T2S duas instruções:
- **Instrução de cash - Payment Free of Delivery (PFoD):** débito ao Intermediário Financeiro por crédito à Entidade Depositária/Liquidadora;
 - **Instrução de valores mobiliários - Free of Payment (FOP):** crédito das unidades de participação na conta de valores informada pelo Intermediário Financeiro;
 - A instrução FOP está ligada à instrução PFoD, com o tipo de ligação "AFTE" (*After*).
- b) Não é permitida a liquidação parcial (a instrução é enviada com o indicador de liquidação parcial NPAR);
- c) No fim do processo de liquidação a Sociedade Gestora e/ou a Entidade Depositária/Liquidadora e o Intermediário Financeiro que efetuou o pedido, são informados do resultado através de mensagens via STD (confirmação da liquidação) - mnemónicas **SFid** (SG/ED) e **SFI** (IF's).

9.2. Falhas na liquidação das instruções de subscrição

- a) Nestas operações não existe falha física (de valores mobiliários) porque as unidades de participação são criadas no momento da liquidação, após liquidação da instrução de cash;
- b) Em caso de falha financeira, a instrução de pagamento manter-se-á no T2S a reciclar para novas tentativas de liquidação até ao *cut-off* do DVP do dia de liquidação e, caso não liquide nesse dia, tentará liquidar nos dias úteis seguintes;
- c) O cancelamento das instruções pendentes por falha financeira do Intermediário Financeiro é efetuado pela Interbolsa mediante pedido de ambas as partes (Intermediário Financeiro e Entidade Aprovadora).

9.3. Liquidação das instruções de resgate

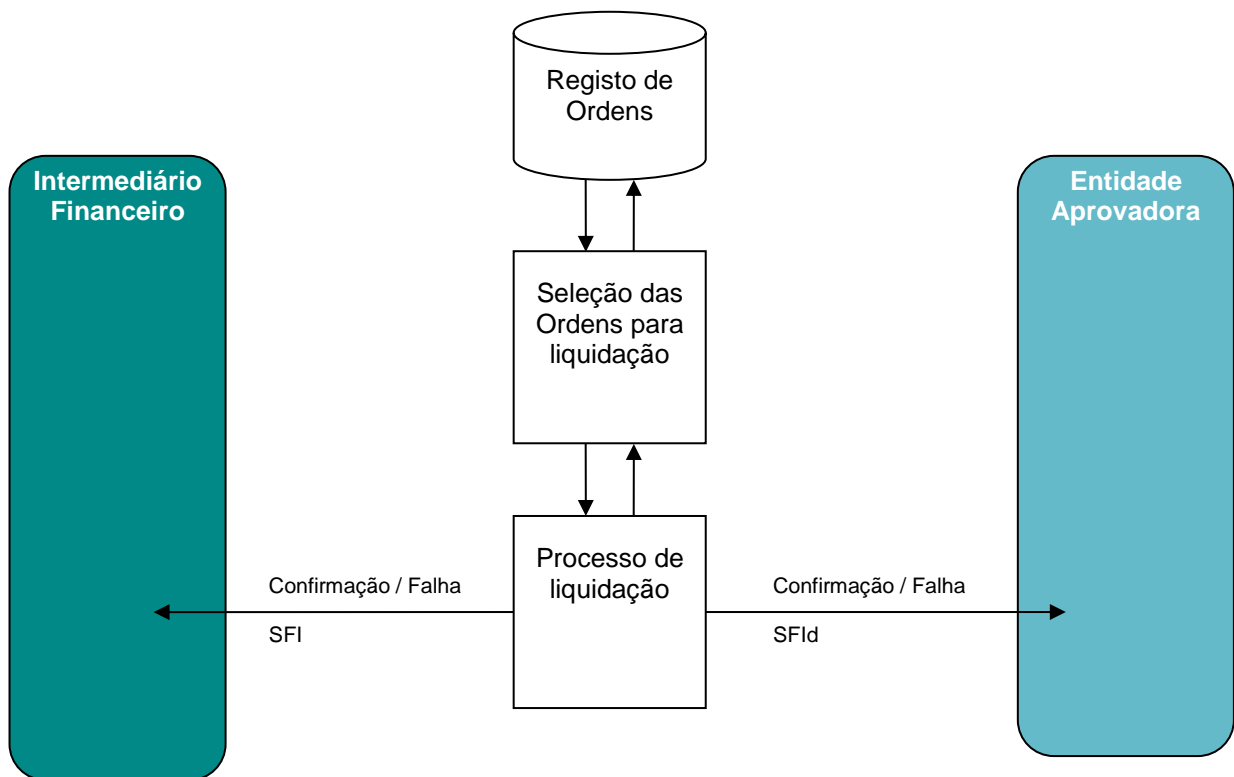
- a) Às 12:00 WET do dia de liquidação são enviadas para o T2S duas instruções:
- **Instrução de cash - Payment Free of Delivery (PFoD):** débito à Entidade Depositária/Liquidadora por crédito ao Intermediário Financeiro;

- **Instrução de valores mobiliários - *Free of Payment* (FOP):** débito das unidades de participação na conta de valores informada pelo Intermediário Financeiro (sit.BL29);
 - A instrução FOP está ligada à instrução PFoD, com o tipo de ligação "AFTE" (*After*).
- b) Não é permitida a liquidação parcial (as instruções são enviadas com o indicador de liquidação parcial NPAR);
- c) No fim do processo de liquidação a Sociedade Gestora e/ou a Entidade Depositária/Liquidadora e o Intermediário Financeiro que efetuou o pedido, são informados do resultado através de mensagens via STD (confirmação da liquidação) - mnemónicas **SFId** (Sociedade Gestora /Entidade Depositária) e **SFI** (Intermediários Financeiros)

9.4. Falhas na liquidação das instruções de resgate

- a) Nestas operações não existe falha física (de valores mobiliários) porque as unidades de participação são bloqueadas desde a aceitação e registo do pedido de resgate;
- b) Em caso de falha financeira, a instrução de pagamento manter-se-á no T2S a reciclar para novas tentativas de liquidação até ao *cut-off* do DVP do dia de liquidação e, caso não liquide nesse dia, tentará liquidar nos dias úteis seguintes;
- c) O cancelamento das instruções pendentes por falha financeira (da Entidade Depositária/Liquidadora) será efetuado pela Interbolsa mediante pedido de ambas as partes (Intermediário Financeiro e Entidade Aprovadora).

Diagrama funcional do processo de liquidação das operações



10. Informação e Consultas

São disponibilizados aos Intermediários Financeiros e à Sociedade Gestora e/ou a Entidade Depositária/Liquidadora, ficheiros e mensagens, em tempo real, via STD, que permitem o acompanhamento dos pedidos de subscrição e resgate, a aceitação/rejeição, o cancelamento e a liquidação dos pedidos.

- Mensagens/ficheiros de **“input”** disponibilizadas aos **Intermediários Financeiros**:
 - **SFImsg – Subscrição/Resgate UP Fundos de Investimento (mensagem);**
 - **SFIfile – Subscrição/Resgate UP Fundos de Investimento (Ficheiro).**

- Mensagens/ficheiros de **“input”** disponibilizadas à **Entidade Aprovadora** (Entidade Depositária ou Sociedade Gestora):

- **SFIormsg – Resposta SFI Entidade Depositária/Sociedade Gestora – Subscrição/Resgate;**
 - **SFIfile – Resposta SFI Entidade Depositária/Sociedade Gestora – Subscrição/Resgate (Ficheiro);**
 - **SFIORqry – Consulta SFI Order Routing;**
 - **SFIldgest – SFI Order Routing – Entidade Depositária/ Sociedade Gestora.**
- Mensagens/ficheiros de “**output**” disponibilizadas aos **Intermediários Financeiros**:
- Durante o dia:
 - **SFI – Sistema de Fundos de Investimento;**
 - Após o fim do dia de liquidação:
 - **SFI-PND - Ordens de Subscrição/Resgate Pendentes Gestora** (com todos os pedidos de subscrição e resgate pendentes de liquidação);
 - **SFI-RES - Ordens de Subscrição/Resgate – Resumo do dia** (com todos os pedidos de subscrição e resgate “liquidados e cancelados” no dia de liquidação anterior);
- Mensagens/ficheiros de “**output**” disponibilizadas à **Entidade Aprovadora** (Entidade Depositária ou Sociedade Gestora):
- Durante o dia:
 - **SFIid – Sistema de Fundos de Investimento - Entidade Depositária/Sociedade Gestora;**
 - **SFIORqryS – Consultas SFI** (consulta de subscrições/resgates) - apenas para a entidade aprovadora;
 - Após o fim do dia de liquidação:
 - **SFIid-PND - Ordens de Subscrição/Resgate Pendentes - Entidade Depositária/Sociedade Gestora** (com todos os pedidos de subscrição e resgate pendentes de liquidação);
 - **SFIid-RES - Ordens de Subscrição/Resgate - Entidade Depositária/Sociedade Gestora** (com todos os pedidos de subscrição e resgate “liquidados e cancelados” no dia de liquidação anterior);
 - **QSF - Quantidade Subscrita por Fundo e IF** (com a quantidade total registada na Interbolsa para cada fundo e por IF).

Caso a entidade aprovadora seja a Sociedade Gestora, a **Entidade Depositária/Liquidadora** terá acesso à seguinte informação, necessária para efetuar o acompanhamento dos pedidos de subscrição e resgate, tendo em vista a respetiva liquidação financeira:

- **SFid - Sistema de Fundos de Investimento - Entidade Depositária/Sociedade Gestora;**
- **SFid-PND - Ordens de Subscrição/Resgate Pendentes - Entidade Depositária/Sociedade Gestora;**
- **SFid-RES - Ordens de Subscrição/Resgate - Entidade Depositária/Sociedade Gestora;**
- **QSF - Quantidade Subscrita por Fundo e IF.**

11. Anexos

11.1. Layouts dos ficheiros/mensagens disponibilizados aos Intermediários Financeiros

SFifile - Subscrição/Resgate UP Fundos de Investimento

Mnemónica =	SFifile
Denominação =	SUBSCRIÇÃO/RESGATE UP FUNDOS DE INVESTIMENTO - FICHEIRO
Menu =	SFI
Descrição =	Este ficheiro permite aos Intermediários Financeiros registarem pedidos de subscrição e resgate de unidades de participação, assim como, pedidos de cancelamento de subscrições e resgates

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Descrição
01	01	A	Função: <ul style="list-style-type: none"> • "I" - Inclusão • "E" - Exclusão
02	13	A	Número de Ordem atribuído pelo SFI; deve conter espaços para a inclusão de uma nova ordem (função "I")
15	04	A	Código da Transação ISO: <ul style="list-style-type: none"> • "SUBS" - Subscrição • "REDM" - Resgate
19	11	A	Identificação do Intermediário Financeiro: <ul style="list-style-type: none"> • Código da Interbolsa (3 dígitos) ou • BIC (11 dígitos)
30	12	A	Código de Identificação do Valor Mobiliário - formato ISIN ou formato CVM (se preenchido com o código CVM, este código deve ser colocado à esquerda e preenchido com espaços em branco à direita)
42	04	A	Código Tipo de Quantidade: UNIT - Unidade
46	14+5	N	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> • para UNIT: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
65	12+2	N	Montante a subscrever ou resgatar, com 2 casas decimais
79	03	A	Código de Moeda de acordo com ISO 4217
82	10	A	Conta de Valores Mobiliários do Intermediário Financeiro
92	34	A	Cliente do Intermediário Financeiro
126	01	A	Indicador do Tipo de Cliente: <ul style="list-style-type: none"> • " " - Cliente é identificado pelo BIC • "P" - Cliente é identificado por um Código Próprio

Posição	Comp.	Tipo	Descrição
			Neste caso, código da Interbolsa será enviado para o T2S com a seguinte informação adicional: <ul style="list-style-type: none">○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco)○ Nome do Esquema: "T2S"
127	08	A	Data de liquidação pedida - (formato AAAAMMDD)

SFImsg - Subscrição/Resgate UP Fundos de Investimento

Mnemónica =	SFImsg
Denominação =	SUBSCRIÇÃO/RESGATE UP FUNDOS DE INVESTIMENTO (MENSAGEM)
Menu =	SFI
Descrição =	Esta mensagem permite aos Intermediários Financeiros registarem pedidos de subscrição e resgate de unidades de participação, assim como, incluir pedidos de cancelamento de subscrições e resgates

Conteúdo da mensagem:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	01	A	Func	Função: <ul style="list-style-type: none"> • "I" - Inclusão • "E" - Exclusão
02	13	A	Num-Ordem	Número de Ordem atribuído pelo SFI; deve conter espaços para a inclusão de uma nova ordem (função "I")
15	04	A	ISO-Tx-Cod	Código da Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>): <ul style="list-style-type: none"> • "SUBS" - Subscrição • "REDM" - Resgate
19	11	A	IF-Reg	Identificação do Intermediário Financeiro: <ul style="list-style-type: none"> • Código da Interbolsa (3 dígitos) ou • BIC (11 dígitos)
30	12	A	Cod-Val-Mob	Código de Identificação do Valor Mobiliário - formato ISIN ou formato CVM (se preenchido com o código CVM, este código deve ser colocado à esquerda e preenchido com espaços em branco à direita)
42	04	A	Tipo Quant.	<ul style="list-style-type: none"> • Código Tipo de Quantidade: UNIT - Unidade
46	14+5	N	Quantidade	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> • para UNIT: <ul style="list-style-type: none"> ○ para fundos: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
65	12+2	N	Montante	Montante a subscrever ou resgatar, com 2 casas decimais
79	03	A	Moeda	Código de Moeda de acordo com ISO 4217
82	10	A	Conta-CVM	Conta de Valores Mobiliários do Intermediário Financeiro
92	34	A	Cliente-IF	Cliente do Intermediário Financeiro
126	01	A	Ind-Cl	Indicador do Tipo de Cliente: <ul style="list-style-type: none"> • " " - Cliente é identificado pelo BIC • "P" - Cliente é identificado por um Código Próprio Neste caso, código da Interbolsa será enviado para o T2S com a seguinte informação adicional: <ul style="list-style-type: none"> ○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco) ○ Nome do Esquema: "T2S"

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
127	08	D	Data-Liq	Data de liquidação pedida - (formato AAAAMMDD)

SFI - Sistema de Fundos de Investimento

Mnemónica =	SFI
Denominação =	SISTEMA DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
Menu =	SFI
Descrição =	Esta mensagem permite o acompanhamento pelo Intermediário Financeiro do estado das ordens de subscrição e resgate de unidades de participação

Conteúdo da mensagem:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	01	A	Func	Função: <ul style="list-style-type: none"> • "I" - Inclusão • "E" - Exclusão - aparece apenas no caso de rejeição
02	13	A	Num-Ordem	Número de Ordem atribuído pelo SFI; deve conter espaços para a inclusão de uma nova ordem (função "I")
15	04	A	ISO-Tx-Cod	Código da Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>): <ul style="list-style-type: none"> • "SUBS" - Subscrição • "REDM" - Resgate
19	03	A	IF-Reg	Identificação do Intermediário Financeiro: Código da Interbolsa (3 dígitos)
22	11	A	IF-Reg(BIC)	Identificação do Intermediário Financeiro: BIC (11 dígitos)
33	03	A	IF-Dep	Identificação da Entidade Depositária: Código da Interbolsa (3 dígitos)
36	11	A	IF-Dep(BIC)	Identificação da Entidade Depositária: BIC (11 dígitos)
47	16	A	Referência-IB	Referência da Interbolsa
63	16	A	Referência-T2S	Referência do T2S
79	16	A	Ref-T2S-Match	Referência de <i>Matching</i> do T2S
95	04	A	Estado	Estado do pedido/ordem de subscrição/resgate: <ul style="list-style-type: none"> • "REJT" - Pedido Rejeitado • "REQU" - Pedido de Subscrição/Resgate • "CONF" - Pedido confirmado pela Entidade Depositária • "SETT" - Subscrição/Resgate liquidado com sucesso • "PCAN" - Pedido de Cancelamento Pendente • "CANC" - Pedido Cancelado
99	32	A	Motivo	Motivos das mensagens de alerta ou motivos de erro quando o estado da transação = "REJT". No caso de serem apresentados vários motivos, serão separados por ";". (Descrição dos motivos disponível separadamente). Formato: 0 - 8 vezes "nnn;" (8*(3+1))
131	32	A	Mot-Descr	<i>T2S Business Rule Identifications</i> . Até ao máximo de 4 <i>Business Rule Identifications</i> podem ser apresentadas, separadas ';'. Formato: 0 - 4 vezes "ABCDnnn;" (4*(7+1))
163	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
175	09	A	Cod-CVM	Identificação do Valor Mobiliário - Código CVM
184	04	A	Tipo Quant.	Código Tipo de Quantidade: UNIT - Unidade
188	14+5	N	Quantidade	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> • para UNIT: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
207	12+2	N	Montante	Montante a subscrever ou resgatar, com 2 casas decimais
221	03	A	Moeda	Código de Moeda de acordo com ISO 4217
224	01	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> • “D” - Débito • “C” - Crédito
225	10	A	Conta-CVM	Conta de Valores Mobiliários do Intermediário Financeiro
235	34	A	DCA	<i>Dedicated Cash Account</i>
269	34	A	Cliente-IF	Cliente do Intermediário Financeiro
303	01	A	Ind-Cl	Indicador do Tipo de Cliente: <ul style="list-style-type: none"> • “ ” - Cliente é identificado pelo BIC • “P” - Cliente é identificado por um Código Próprio Neste caso, código da Interbolsa será enviado para o T2S com a seguinte informação adicional: <ul style="list-style-type: none"> ○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco) ○ Nome do Esquema: “T2S”
304	08	D	Data-Liq	Data de Liquidação Pedida/Confirmada/Efetiva - (formato AAAAMMDD)
312	14	DT	<i>TimeStamp</i> T2S	Data e Hora relativa ao estado da instrução, informado pelo T2S (CET) para os estados CONF (após registo da instrução no T2S) e SETT
326	08	D	Data-Est	Data do Estado atualizada - (formato AAAAMMDD)
334	06	T	Hora-Est	Hora do Estado atualizada - (formato hhmmss)

SFI-PND - Ordens de Subscrição/Resgate Pendentes

Mnemónica =	SFI-PND
Denominação =	ORDENS DE SUBSCRIÇÃO/RESGATE PENDENTES
Menu =	SFI
Descrição =	Este ficheiro é disponibilizado aos Intermediários Financeiros e contém todas as ordens de subscrição e resgate pendentes (de confirmação ou liquidação)

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	IF	Identificação do Intermediário Financeiro: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	11	A	IF(BIC)	Identificação do Intermediário Financeiro: BIC (11 dígitos)
21	13	A	Num-Ordem	Número de Ordem atribuído pelo SFI; deve conter espaços para a inclusão de uma nova ordem (função "I")
34	04	A	ISO-Tx-Cod	Código da Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>): <ul style="list-style-type: none"> "SUBS" - Subscrição "REDM" - Resgate
38	03	A	IF-Dep	Identificação da Entidade Depositária: Código da Interbolsa (3 dígitos)
41	11	A	IF-Dep(BIC)	Identificação da Entidade Depositária: BIC (11 dígitos)
52	16	A	Referência-IB	Referência da Interbolsa
68	16	A	Referência-T2S	Referência do T2S
84	16	A	Ref-T2S-Match	Referência de Matching do T2S
100	04	A	Estado	Estado do pedido/ordem de subscrição/resgate: <ul style="list-style-type: none"> "REQU" - Pedido de Subscrição/Resgate "CONF" - Pedido confirmado pela Entidade Depositária
104	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
116	09	A	Cod-CVM	Identificação do Valor Mobiliário - Código CVM
125	04	A	Tipo-Quant	Código Tipo de Quantidade: UNIT - Unidade
129	14+5	N	Quantidade	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> para UNIT: <ul style="list-style-type: none"> para fundos: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
148	12+2	N	Montante	Montante a subscrever ou resgatar, com 2 casas decimais
162	03	A	Moeda	Código de Moeda de acordo com ISO 4217
165	01	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> "D" - Débito "C" - Crédito
166	10	A	Conta-CVM	Conta de Valores Mobiliários do Intermediário Financeiro

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
176	34	A	Cliente-IF	Cliente do Intermediário Financeiro
210	01	A	Ind-CI	Indicador do Tipo de Cliente: <ul style="list-style-type: none"> • “ ” - Cliente é identificado pelo BIC • “P” - Cliente é identificado por um Código Próprio Neste caso, código da Interbolsa será enviado para o T2S com a seguinte informação adicional: <ul style="list-style-type: none"> ○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco) ○ Nome do Esquema: “T2S”
211	08	D	Data-Liq	Data de Liquidação Pedida/Confirmada - (formato AAAAMMDD)
219	08	D	Data-Est	Data do Estado atualizada - (formato AAAAMMDD)
227	06	T	Hora-Est	Hora do Estado atualizada - (formato hhmss)

SFI-RES - Ordens de Subscrição/Resgate - Resumo do dia

Mnemónica =	SFI-RES
Denominação =	ORDENS DE SUBSCRIÇÃO/RESGATE - RESUMO DO DIA
Menu =	SFI
Descrição =	Este ficheiro é disponibilizado aos Intermediários Financeiros e contém todas as ordens de subscrição e resgate “fechadas” no dia de liquidação anterior (liquidadas e canceladas)

Conteúdo do ficheiro:

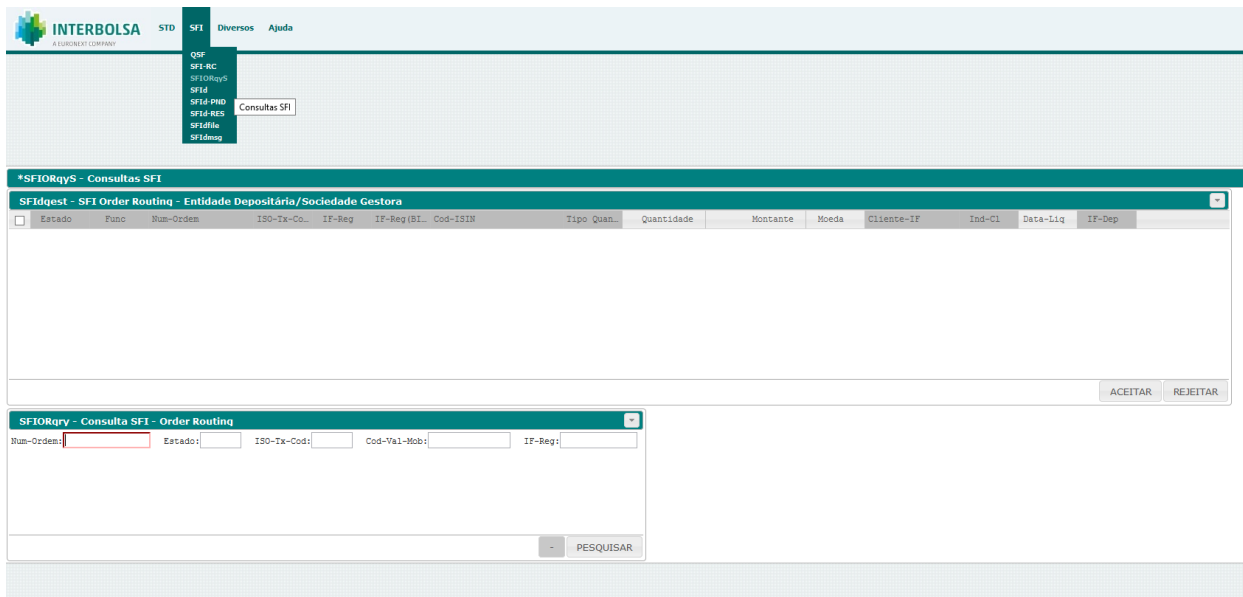
Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	IF	Identificação do Intermediário Financeiro a quem se destina a informação: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	11	A	IF (BIC)	Identificação do Intermediário Financeiro a quem se destina a informação: BIC (11 dígitos)
21	13	A	Num-Ordem	Número de Ordem atribuído pelo SFI; deve conter espaços para a inclusão de uma nova ordem (função " ")
34	04	A	ISO-Tx-Cod	Código da Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>): <ul style="list-style-type: none"> • "SUBS" - Subscrição • "REDM" - Resgate
38	03	A	IF-Dep.	Identificação da Entidade Depositária: Código da Interbolsa (3 dígitos)
41	11	A	IF-Dep(BIC)	Identificação da Entidade Depositária: BIC (11 dígitos)
52	16	A	Referência-IB	Referência da Interbolsa
68	16	A	Referência-T2S	Referência do T2S
84	16	A	Ref-T2S-Match	Referência de <i>Matching</i> do T2S
100	04	A	Estado	Estado do pedido/ordem de subscrição/resgate: <ul style="list-style-type: none"> • "CANC" - Pedido de Subscrição/Resgate cancelado • "SETT" - Pedido de Subscrição/Resgate liquidado
104	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
116	09	A	Cod-CVM	Identificação do Valor Mobiliário - Código CVM
125	04	A	Tipo Quant.	Código Tipo de Quantidade: UNIT - Unidade
129	14+5	N	Quantidade	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> • para UNIT: <ul style="list-style-type: none"> ○ para fundos: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
148	12+2	N	Montante	Montante a subscrever ou resgatar, com 2 casas decimais
162	03	A	Moeda	Código de Moeda de acordo com ISO 4217
165	01	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> • "D" - Débito • "C" - Crédito
166	10	A	Conta-CVM	Conta de valores mobiliários do Intermediário Financeiro
176	34	A	DCA	<i>Dedicated Cash Account</i>

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
210	34	A	Cliente-IF	
244	01	A	Ind-CI	Indicador do Tipo de Cliente: <ul style="list-style-type: none"> • “ “ - Cliente é identificado pelo BIC • “P” - Cliente é identificado por um Código Próprio Neste caso, código da Interbolsa será enviado para o T2S com a seguinte informação adicional: <ul style="list-style-type: none"> ○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco) ○ Nome do Esquema: “T2S”
245	08	D	Data-Liq	Data de Liquidação Pedida/Confirmada/Efetiva - (formato AAAAMMDD)
253	08	DT	<i>TimeStamp SF3</i>	Data e Hora de liquidação efetiva no T2S (SF3 - <i>Settlement Finality 3 - Settlement</i>) Formato AAAAMMDDhhmmss
261	06	D	Data-Inf	Data da informação (<i>Business Date</i>) - formato AAAAMMDD

11.2. Layouts dos ficheiros/mensagens disponibilizados à Sociedade Gestora ou Entidade Depositária/Liquidadora

Mnemonic SFIORqryS - disponibilizada à Sociedade Gestora ou Entidade Depositária/Liquidadora

Super Mnemónica, acessível através do menu "SFI" do STD.



The screenshot shows the INTERBOLSA application interface. At the top, there is a navigation bar with the logo and menu items: STD, SFI, Diversos, and Ajuda. A dropdown menu is open under 'SFI', listing options: QSP, SFI-RC, SFIORqryC, SFIId, SFIId-PHD, SFIId-RBS, SFIIdfile, and SFIIdmsg. A 'Consultas SFI' option is highlighted. Below this, a window titled '*SFIORqryS - Consultas SFI' is open. It features a header 'SFIIdqest - SFI Order Routing - Entidade Depositária/Sociedade Gestora' and a table with columns: Estado, Func, Num-Orden, ISO-Tx-Co..., IP-Reg, IF-Reg(BI...), Cod-ISIS, Tipo, Quan..., Quantidade, Montante, Moeda, Cliente-IF, Ind-Cl, Data-Liq, and IF-Dep. At the bottom of this window are 'ACEITAR' and 'REJEITAR' buttons. A second window, 'SFIORqry - Consulta SFI - Order Routing', is also visible, containing input fields for 'Num-Orden', 'Estado', 'ISO-Tx-Cod', 'Cod-Val-Mob', and 'IF-Reg', along with a 'PESQUISAR' button.

Após abrir a mnemónica são abertas automaticamente as mnemónicas SFIORqry, SFIIdgest.

Mnemónica SFIORqry [*Super-mnemonic*]

Janela de pesquisa.

Para executar uma consulta têm de ser preenchidos um ou vários filtros. A pesquisa é executada pelo carregamento do botão "PESQUISAR".

SFIgest - SFI Order Routing – Entidade Depositária ou Sociedade Gestora

Mnemónica =	SFIgest
Denominação =	SFI ORDER ROUTING – ENTIDADE DEPOSITÁRIA/SOCIEDADE GESTORA
Menu =	SFI
Descrição =	Este ficheiro permite à Entidade Depositária/Sociedade Gestora consultar, aceitar/rejeitar as ordens de subscrição e resgate de unidades de participação e os pedidos de cancelamento efetuados pelos Intermediários Financeiros

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Nome STD	Descrição
01	04	A	Estado	Estado da subscrição / resgate do pedido: <ul style="list-style-type: none"> • "REQU" – pedido de subscrição / resgate • "CONF" – pedido de confirmação pela entidade depositária / sociedade gestora • "CANC" – pedido cancelado
05	01	A	Func	Função: <ul style="list-style-type: none"> • "I" - Inclusão • "E" - Exclusão
06	13	A	Num-Ordem	Número da ordem atribuída pelo SFI
19	04	A	ISO-Tx-Cod	Código da Transação ISO: <ul style="list-style-type: none"> • SUBS - Subscrição • REDM - Resgate
23	03	A	IF-Reg	Identificação do participante: <ul style="list-style-type: none"> • Código da Interbolsa (3 digits)
26	11	A	IF-Reg(BIC)	Identificação do participante: <ul style="list-style-type: none"> • BIC (11 digits)
37	12	A	Cod-ISIN	Código do valor mobiliário – Código ISIN
49	04	A	Tipo-Quant	Tipo de quantidade: <ul style="list-style-type: none"> • UNIT - Unit
53	14+5	N	Quantidade	Quantidade: <ul style="list-style-type: none"> • Para UNIT: máximo 5 casas decimais (formato: (14+5))
72	12+2	N	Montante	Montante a liquidar com duas casas decimais
86	03	A	Moeda	Código da moeda de acordo com ISO 4217
89	34	A	Cliente-IF	Cliente do participante
123	01	A	Ind-Cl	Indicador do tipo de cliente: <ul style="list-style-type: none"> • " " – Cliente identificado por um BIC • "P" – Cliente identificado por um código proprietário; Neste caso o código proprietário será enviado pelo T2S com a seguinte informação adicional:

Posição	Comp.	Tipo	Nome STD	Descrição
				<ul style="list-style-type: none"> ○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco) ○ Nome do Esquema: "T2S"
124	08	A	Data-Liq	Data de Liquidação contratada (formato YYYYMMDD)
132	03	N	IF-Dep	Identificação da entidade depositária: código da Interbolsa (3 dígitos)

- Esta consulta apresenta dois "botões" ("ACEITAR" e "REJEITAR") para a **Entidade Depositária/Sociedade Gestora aceitar ou rejeitar os pedidos.**
- No caso de selecionar o botão "ACEITAR" podem ser alterados os campos "**Montante**", "**Moeda**", e "**Data-Liq**".
- No caso de consultar ordens Canceladas, o campo "**Func**" é carregado com Func" = "E" que indica um pedido de cancelamento, para aceitar ou rejeitar.

SFIfile - Resposta SFI Entidade Depositária ou Sociedade Gestora - Subscrição/Resgate

Mnemónica =	SFIfile
Denominação =	RESPOSTA SFI ENTIDADE DEPOSITARIA - SUBSCRIÇÃO/RESGATE-FICHEIRO
Menu =	SFI
Descrição =	Este ficheiro permite à Entidade Aprovadora aceitar/rejeitar as ordens de subscrição e resgate de unidades de participação e os pedidos de cancelamento efetuados pelos Intermediários Financeiros

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Descrição
01	01	A	Função: <ul style="list-style-type: none"> • "I" - Inclusão • "E" - Exclusão
02	13	A	Número de Ordem atribuído pelo SFI; deve conter espaços para a inclusão de uma nova ordem (função "I")
15	04	A	Código da Transação ISO: <ul style="list-style-type: none"> • "SUBS" - Subscrição • "REDM" - Resgate
19	11	A	Identificação do Intermediário Financeiro: <ul style="list-style-type: none"> • Código da Interbolsa (3 dígitos) ou • BIC (11 dígitos)
30	01	A	Resposta ao pedido de Inclusão/Exclusão: <ul style="list-style-type: none"> • "A" - Pedido Aceite • "R" - Pedido Rejeitado
31	03	A	Motivo, em caso de rejeição
34	12	A	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
46	04	A	Código Tipo de Quantidade: <ul style="list-style-type: none"> • UNIT - Unidade
50	14+5	N	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> • para UNIT: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
69	12+2	N	Montante a liquidar, com 2 casas decimais
83	03	A	Código de Moeda de acordo com ISO 4217
86	34	A	Cliente do Intermediário Financeiro
120	01	A	Indicador do Tipo de Cliente: <ul style="list-style-type: none"> • " " - Cliente é identificado pelo BIC • "P" - Cliente é identificado por um Código Próprio Neste caso, código da Interbolsa será enviado para o T2S com a seguinte informação adicional: <ul style="list-style-type: none"> ○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco) ○ Nome do Esquema: "T2S"
121	08	A	Data de liquidação pedida - (formato AAAAMMDD)

SFImsg – Resposta SFI Entidade Depositária ou Sociedade Gestora - Subscrição/Resgate

Mnemónica =	SFImsg
Denominação =	RESPOSTA SFI ENTIDADE DEPOSITARIA/SOCIEDADE GESTORA - SUBSCRIÇÃO/RESGATE
Menu =	SFI
Descrição =	Esta mensagem permite à Entidade Aprovadora aceitar/rejeitar as ordens de subscrição e resgate de unidades de participação e os pedidos de cancelamento efetuados pelos Intermediários Financeiros

Conteúdo da mensagem:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	01	A	Func	Função: <ul style="list-style-type: none"> • "I" - Inclusão • "E" - Exclusão
02	13	A	Num-Ordem	Número de Ordem atribuído pelo SFI; deve conter espaços para a inclusão de uma nova ordem (função "I")
15	04	A	ISO-Tx-Cod	Código da Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>): <ul style="list-style-type: none"> • "SUBS" - Subscrição • "REDM" - Resgate
19	11	A	IF-Reg	Identificação do Intermediário Financeiro: <ul style="list-style-type: none"> • Código da Interbolsa (3 dígitos) ou • BIC (11 dígitos)
30	01	A	Resp	Resposta ao pedido de Inclusão/Exclusão: <ul style="list-style-type: none"> • "A" - Pedido Aceite • "R" - Pedido Rejeitado
31	03	A	Motivo	Motivo, em caso de rejeição
34	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
46	04	A	Tipo Quant.	Código Tipo de Quantidade: <ul style="list-style-type: none"> • UNIT - Unidade
50	14+5	N	Quantidade	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> • para UNIT: <ul style="list-style-type: none"> ○ para fundos: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
69	12+2	N	Montante	Montante a liquidar, com 2 casas decimais
83	03	A	Moeda	Código de Moeda de acordo com ISO 4217
86	34	A	Cliente-IF	Cliente do Intermediário Financeiro
120	01	A	Ind-Cl	Indicador do Tipo de Cliente: <ul style="list-style-type: none"> • " " - Cliente é identificado pelo BIC • "P" - Cliente é identificado por um Código Próprio Neste caso, código da Interbolsa será enviado para o T2S com a seguinte informação adicional:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				<ul style="list-style-type: none"> ○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco) ○ Nome do Esquema: "T2S"
121	08	D	Data-Liq	Data de liquidação pedida - (formato AAAAMMDD)

SFIId - Sistema de Fundos de Investimento - Entidade Depositária e Sociedade Gestora

Mnemónica =	SFIId
Denominação =	SISTEMA DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - ENTIDADE DEPOSITARIA
Menu =	SFI
Descrição =	Esta mensagem permite o acompanhamento pela Entidade Depositária/Sociedade Gestora do estado das ordens de subscrição e resgate de unidades de participação

Conteúdo da mensagem:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	01	A	Func	Função: <ul style="list-style-type: none"> "I" - Inclusão "E" - Exclusão - aparece apenas no caso de rejeição
02	13	A	Num-Ordem	Número de Ordem atribuído pelo SFI; deve conter espaços para a inclusão de uma nova ordem (função "I")
15	04	A	ISO-Tx-Cod	Código da Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>): <ul style="list-style-type: none"> "SUBS" - Subscrição "REDM" - Resgate
19	03	A	IF-Reg	Identificação do Intermediário Financeiro: Código da Interbolsa (3 dígitos)
22	11	A	IF-Reg(BIC)	Identificação do Intermediário Financeiro: BIC (11 dígitos)
33	03	A	IF-Dep	Identificação da Entidade Depositária: Código da Interbolsa (3 dígitos)
36	11	A	IF-Dep(BIC)	Identificação da Entidade Depositária: BIC (11 dígitos)
47	16	A	Referência-IB	Referência da Interbolsa
63	16	A	Referência-T2S	Referência do T2S
79	16	A	Ref-T2S-Match	Referência de <i>Matching</i> do T2S
95	01	A	Resp	Resposta recebida da Entidade Depositária
96	04	A	Estado	Estado do pedido/ordem de subscrição/resgate: <ul style="list-style-type: none"> "REJT" - Pedido Rejeitado "REQU" - Pedido de Subscrição/Resgate "CONF" - Pedido confirmado pela Entidade Depositária "SETT" - Subscrição/Resgate liquidado com sucesso "PCAN" - Pedido de Cancelamento Pendente "CANC" - Pedido Cancelado
100	32	A	Motivo	Motivos das mensagens de alerta ou motivos de erro quando o estado da transação = "REJT". No caso de serem apresentados vários motivos, serão separados por ";". (Descrição dos motivos disponível separadamente). Formato: 0 - 8 vezes "nnn;" (8*(3+1))
132	32	A	Mot-Descr	<i>T2S Business Rule Identifications</i> . Até ao máximo de 4 <i>Business Rule Identifications</i> podem ser apresentadas, separadas ';'. Formato: 0 - 4 vezes "ABCDnnn;" (4*(7+1))

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
164	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
176	9	A	Cod-CVM	Identificação do Valor Mobiliário - Código CVM
185	04	A	Tipo Quant.	Código Tipo de Quantidade: UNIT - Unidade
189	14+5	N	Quantidade	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> • para UNIT: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
208	12+2	N	Montante	Montante a subscrever ou resgatar, com 2 casas decimais
222	03	A	Moeda	Código de Moeda de acordo com ISO 4217
225	01	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> • "D" - Débito • "C" - Crédito
226	34	A	DCA	<i>Dedicated Cash Account</i>
260	34	A	Cliente-IF	Cliente do Intermediário Financeiro
294	01	A	Ind-Cl	Indicador do Tipo de Cliente: <ul style="list-style-type: none"> • " " - Cliente é identificado pelo BIC • "P" - Cliente é identificado por um Código Próprio Neste caso, código da Interbolsa será enviado para o T2S com a seguinte informação adicional: <ul style="list-style-type: none"> ○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco) ○ Nome do Esquema: "T2S"
295	08	D	ISD	Data de Liquidação Pedida/Confirmada - (<i>Intended Settlement Date</i>) - formato AAAAMMDD
303	14	DT	<i>TimeStamp</i> T2S	Data e Hora relativa ao estado da instrução, informado pelo T2S (CET) para os estados CONF (após registo da instrução no T2S) e SETT
317	08	D	Data-Est	Data do Estado atualizada - (formato AAAAMMDD)
325	06	T	Hora-Est	Hora do Estado atualizada - (formato hhmmss)

SFid-PND - Ordens de Subscrição/Resgate Pendentes - Entidade Depositária e Sociedade Gestora

Mnemónica =	SFid-PND
Denominação =	ORDENS DE SUBSCRIÇÃO/RESGATE PENDENTES – ENTIDADE DEPOSITÁRIA/SOCIEDADE GESTORA
Menu =	SFI
Descrição =	Este ficheiro é disponibilizado à Entidade Depositária/ Sociedade Gestora e contém todas as ordens de subscrição e resgate pendentes (de confirmação ou liquidação)

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	IF-Dest	Identificação da entidade depositária/sociedade gestora: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	11	A	IF-Dep(BIC)	Identificação da Entidade Depositária: BIC (11 dígitos)
21	13	A	Num-Ordem	Número de Ordem atribuído pelo SFI; deve conter espaços para a inclusão de uma nova ordem (função " ")
34	04	A	ISO-Tx-Cod	Código da Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>): <ul style="list-style-type: none"> • "SUBS" - Subscrição • "REDM" - Resgate
38	03	A	IF-Reg	Identificação do Intermediário Financeiro: Código da Interbolsa (3 dígitos)
41	11	A	IF-Reg(BIC)	Identificação do Intermediário Financeiro: BIC (11 dígitos)
52	16	A	Referência-IB	Referência da Interbolsa
68	16	A	Referência-T2S	Referência do T2S
84	16	A	Ref-T2S-Match	Referência de <i>Matching</i> do T2S
100	04	A	Estado	Estado do pedido/ordem de subscrição/resgate: <ul style="list-style-type: none"> • "REQU" - Pedido de Subscrição/Resgate • "CONF" – Pedido confirmado pela Entidade Depositária
104	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
116	09	A	Cod-CVM	Identificação do Valor Mobiliário - Código CVM
125	04	A	Tipo Quant.	Código Tipo de Quantidade: UNIT - Unidade
129	14+5	N	Quantidade	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> • para UNIT: <ul style="list-style-type: none"> ○ para fundos: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
148	12+2	N	Montante	Montante a subscrever ou resgatar, com 2 casas decimais
162	03	A	Moeda	Código de Moeda de acordo com ISO 4217
165	01	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> • "D" - Débito • "C" - Crédito

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
166	34	A	Cliente-IF	Cliente do Intermediário Financeiro
200	01	A	Ind-CI	Indicador do Tipo de Cliente: <ul style="list-style-type: none"> • “ “ - Cliente é identificado pelo BIC “P” - Cliente é identificado por um Código Próprio Neste caso, código da Interbolsa será enviado para o T2S com a seguinte informação adicional: <ul style="list-style-type: none"> ○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco) ○ Nome do Esquema: “T2S”
201	08	D	Data-Liq	Data de Liquidação Pedida/Confirmada - (formato AAAAMMDD)
209	08	D	Data-Est	Data do Estado atualizada - (formato AAAAMMDD)
217	06	T	Hora-Est	Hora do Estado atualizada - (formato hhmmss)

SFid-RES - Ordens de Subscrição/Resgate - Entidade Depositária e Sociedade Gestora

Mnemónica = SFid-RES
Denominação = ORDENS DE SUBSCRIÇÃO/RESGATE - ENTIDADE DEPOSITÁRIA/SOCIEDADE GESTORA
Menu = SFI
Descrição = Este ficheiro é disponibilizado à Entidade Depositária/Sociedade Gestora e contém todas as ordens de subscrição e resgate “fechadas” no dia anterior (liquidadas e canceladas)

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	IF-Dest.	Identificação do Intermediário Financeiro a quem se destina a informação: Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	11	A	IF-Dep (BIC)	Identificação da Entidade Depositária: BIC (11 dígitos)
21	13	A	Num-Ordem	Número de Ordem atribuído pelo SFI; deve conter espaços para a inclusão de uma nova ordem (função " ")
34	04	A	ISO-Tx-Cod	Código da Transação ISO (<i>ISO Transaction Code</i>): <ul style="list-style-type: none"> • "SUBS" - Subscrição • "REDM" - Resgate
38	03	A	IF-Reg	Identificação do Intermediário Financeiro: Código da Interbolsa (3 dígitos)
41	11	A	IF-Reg(BIC)	Identificação do Intermediário Financeiro: BIC (11 dígitos)
52	16	A	Referência-IB	Referência da Interbolsa
68	16	A	Referência-T2S	Referência do T2S
84	16	A	Ref-T2S-Match	Referência de <i>Matching</i> do T2S
100	04	A	Estado	Estado do pedido/ordem de subscrição/resgate: <ul style="list-style-type: none"> • "CANC" - Pedido de Subscrição/Resgate cancelado • "SETT" - Pedido de Subscrição/Resgate liquidado
104	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
116	09	A	Cod-CVM	Identificação do Valor Mobiliário - Código CVM
125	04	A	Tipo Quant.	Código Tipo de Quantidade: UNIT - Unidade
129	14+5	N	Quantidade	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> • para UNIT: <ul style="list-style-type: none"> ○ para fundos: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
148	12+2	N	Montante	Montante a subscrever ou resgatar, com 2 casas decimais
162	03	A	Moeda	Código de Moeda de acordo com ISO 4217
165	01	A	D/C	Indicador de Débito/Crédito: <ul style="list-style-type: none"> • "D" - Débito • "C" - Crédito
166	34	A	DCA	<i>Dedicated Cash Account</i>
200	34	A	Cliente-IF	Cliente do Intermediário Financeiro
234	01	A	Ind-Cl	Indicador do Tipo de Cliente: <ul style="list-style-type: none"> • " " - Cliente é identificado pelo BIC

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
				<ul style="list-style-type: none"> • “P” - Cliente é identificado por um Código Próprio Neste caso, código da Interbolsa será enviado para o T2S com a seguinte informação adicional: <ul style="list-style-type: none"> ○ Emitente: 4 primeiros caracteres do BIC do Intermediário Financeiro (código do banco) ○ Nome do Esquema: “T2S”
235	08	D	Data-Liq	Data de Liquidação Pedida/Confirmada/Efetiva - (formato AAAAMMDD)
243	14	DT	TimeStamp SF3	Data e Hora de liquidação efetiva no T2S (SF3 - <i>Settlement Finality 3 - Settlement</i>) Formato AAAAMMDDhhmmss
257	08	D	Data-Inf	Data da informação (<i>Business Date</i>) - formato AAAAMMDD

11.3. Layout do ficheiro QSF - Quantidade Subscrita por Fundo e IF

QSF - Quantidade Subscrita por Fundo e IF

Mnemónica =	QSF
Denominação =	QUANTIDADE SUBSCRITA POR FUNDO E IF
Menu =	SFI
Descrição =	Este ficheiro é disponibilizado à Entidade Depositária e/ou à Sociedade Gestora e contém a quantidade subscrita por Fundo de Investimento/Participante

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	IF-Dest	Destino da informação (Sociedade Gestora/Entidade Depositária): Código da Interbolsa (3 dígitos)
04	06	N	Num-Seq	Número Sequencial do Registo
10	03	N	IF-Dep	Identificação da Entidade Depositária: Código da Interbolsa (3 dígitos)
13	12	A	Cod-ISIN	Identificação do Valor Mobiliário - Código ISIN
25	03	A	IF-Reg	Identificação do Intermediário Financeiro: Código da Interbolsa (3 dígitos)
28	11	A	IF-Reg(BIC)	Identificação do Intermediário Financeiro: BIC (11 dígitos)
39	04	A	Tipo Quant.	Código do Tipo de Quantidade: UNIT - Unidade
43	14+5	N	Quantidade	Quantidade de Valores Mobiliários: <ul style="list-style-type: none"> para UNIT: máximo 5 casas decimais (formato: 14+5)
62	08	D	Data-Ref	Data de Referência (formato AAAAMMDD)

Este ficheiro é disponibilizado após *Change of Business Day*.

11.4. Tabela de códigos utilizados nas mensagens SFI e SFId

SFI-RC - Tabela de códigos utilizados nas mensagens SFI e SFId

Mnemónica = SFI-RC
Denominação = TABELA DE CÓDIGOS UTILIZADOS NAS MENSAGENS SFI E SFID
Menu = SFI
Descrição = Este ficheiro contém os motivos (*reason codes*) utilizados nas mensagens de STD "SFI" e "SFId"

Conteúdo do ficheiro:

Posição	Comp.	Tipo	Designação STD	Descrição
01	03	N	Motivo	Código do motivo (<i>reason code</i>)
04	01	A		Contem ";" (não visualizado)
05	96	A	Descrição PT	Descrição do motivo em Português
101	01			Contem ";" (não visualizado)
102	96	A	Descrição EN	Descrição do motivo em Inglês

Tabela de estados e motivos constantes das mnemónicas SFI e SFIid

Estado	Mot	Descrição PT	Descrição EN
MACH	003	Instrução matched, aguarda liquidação	<i>Instruction matched, waiting for settlement</i>
CONF	006	Falha de liquidação financeira	<i>Fail on cash settlement</i>
CANC	011	Cancelada pela Interbolsa	<i>Cancelled by Interbolsa</i>
REQU	061	Pedido/Ordem de subscrição ou resgate registado	<i>Request for subscription or redemption registered</i>
REQU	062	Pedido/Ordem registado apos o cut-off time do fundo de investimento	<i>Request registered after cut-off time of investment fund</i>
CONF	063	Montante a liquidar alterado pela Entidade Depositária	<i>Settlement amount amended by Custodian Bank</i>
CONF	064	Data de Liquidação alterada pela Entidade Depositária	<i>Settlement date amended by Custodian Bank</i>
REQU CONF	065	Pedido/Ordem de cancelamento enviado para a Entidade Depositária, aguarda confirmação	<i>Cancellation request sent to Custodian Bank, awaiting confirmation</i>
REQU CONF	066	Pedido/Ordem de cancelamento rejeitado pela Entidade Depositária	<i>Cancellation request rejected by Custodian Bank</i>
CANC	067	Pedido/Ordem cancelada por instrução do IF	<i>Request/order cancelled by FI instruction</i>
CANC	068	Pedido/Ordem rejeitado pela Entidade Depositária, pedido cancelado	<i>Request rejected by Custodian Bank, request cancelled</i>
CANC	069	Prazo de confirmação pela Entidade Depositária expirado, pedido cancelado	<i>Custodian Bank confirmation deadline exceeded, request cancelled</i>
CANC	070	Quantidade a resgatar não disponível, pedido/ordem de resgate cancelada	<i>Quantity to redeem not available, redemption request cancelled</i>
REJT	100	IF a registar diferente do IF STD (IF não autorizado para registar esta operação)	<i>Registering FI different from STD (FI not authorized to register this operation)</i>
REJT	111	Data Liquidação inválida	<i>Invalid Settlement Date</i>
REJT	117	Valor Mobiliário ou Código ISIN inválido / não autorizado	<i>Security Code or ISIN invalid / not authorised</i>
REJT	119	Quantidade inválida	<i>Invalid quantity</i>
REJT	120	Tipo de quantidade inválido	<i>Quantity type indicator invalid</i>
REJT	122	Quantidade deve ser múltiplo do <i>Multiple Settlement Unit</i>	<i>Quantity not multiple of Multiple Settlement Unit</i>
REJT	125	Montante inválido	<i>Settlement amount and currency invalid</i>
REJT	127	Número de casas decimais na Quantidade inválido para este fundo de investimento	<i>Number of decimal digits in Quantity invalid for this investment fund</i>
REJT	133	Conta CVM inválida	<i>CVM Account invalid</i>
REJT	149	Moeda inválida	<i>Invalid currency</i>
REJT	162	Cliente-IF inválido	<i>Client invalid</i>
REJT	168	ISO Transaction Code inválido (SUBS, REDM)	<i>ISO Transaction Code invalid (SUBS, REDM)</i>
REJT	174	Cliente-IF: Indicador Cliente inválido (" "/"P") ou BIC inválido	<i>Customer: Invalid Customer Indicator or invalid BIC</i>
REJT	179	IF Registo não autorizado para subscrições/resgates SFI	<i>Registering FI not authorized to request SFI subscriptions/redemptions</i>
REJT	180	Função inválida (I, E)	<i>Invalid Function (I,E)</i>
REJT	181	Número de Ordem obrigatório para esta função	<i>Order Number mandatory for this function</i>
REJT	182	Não preencher Número de Ordem para esta função	<i>Do not fill in the Order Number for this function</i>
REJT	183	Cliente-IF obrigatório	<i>Client mandatory</i>
REJT	184	Quantidade ou Montante obrigatório	<i>Quantity or amount mandatory</i>
REJT	185	Preencher Quantidade ou Montante, não ambos	<i>Fill in Quantity or Amount, not both</i>
REJT	186	Pedido em quantidade: não preencher moeda	<i>Request in Quantity: do not fill in the currency</i>
REJT	187	Data Liquidação deve ser maior que data de hoje (para a E.D: maior ou igual à hoje)	<i>Settlement Date must be after today (for Custodian Bank: from today)</i>

Estado	Mot	Descrição PT	Descrição EN
REJT	188	Pedido recebido após <i>cut-off time</i> para este fundo de investimento	<i>Request received after cut-off time for this investment fund</i>
REJT	189	Quantidade a resgatar não disponível	<i>Quantity to redeem not available</i>
REJT	190	Número de Ordem indicada não pertence ao IF-Reg	<i>Order Number does not belong to registering FI</i>
REJT	191	Já existe um pedido de cancelamento para esta ordem	<i>Cancellation request for this order already registered</i>
REJT	192	Pedido recebido após <i>cut-off</i> diário (15 min antes do FOP <i>cut-off</i>)	<i>Request received after intraday cut-off</i>
		Só para a Entidade Depositária/Sociedade Gestora:	<i>Only for Custodian Bank/Management Company:</i>
REJT	200	IF não autorizado para funções de Entidade Depositária/Sociedade Gestora	<i>FI not authorized for Custodian Bank/Management Company functions</i>
REJT	201	Número de Ordem indicada não pertence a Entidade Depositária/Sociedade Gestora	<i>Order Number does not belong to Custodian Bank/Management Company</i>
REJT	202	Número de Ordem não existe	<i>Order Number does not exist</i>
REJT	203	Pedido/Ordem não esta pendente	<i>Requested Order number not pending</i>
REJT	204	Tipo registado diferente	<i>Registered Type differs</i>
REJT	205	IF Registo diferente	<i>Registered FI differs</i>
REJT	206	ISIN registado diferente	<i>Registered ISIN differs</i>
REJT	207	Quantidade registada diferente	<i>Registered Quantity differs</i>
REJT	208	Quantidade obrigatória	<i>Quantity mandatory</i>
REJT	209	Resposta inválida (A, R)	<i>Invalid Response (A, R)</i>
REJT	210	Motivo de rejeição informado inválido	<i>Invalid rejection reason code</i>