



# BANCO CENTRAL DO BRASIL

## CARTA-CIRCULAR Nº 2.972

Esclarece sobre a remessa das informações relativas à Circular nº 3.046, de 2001, que trata do acompanhamento e controle da exposição das operações denominadas em Real e remuneradas com base em taxas de juros prefixadas.

Esclarecemos que as informações mensais solicitadas no art. 1º, incisos III e IV, da Circular nº 3.046, de 12 de julho de 2001, devem ser prestadas via Internet, na forma das instruções em anexo, mediante utilização do aplicativo PSTAW10 (intercâmbio de informações), de que trata a Carta-Circular nº 2.847, de 13 de abril de 1999, disponível para **download** na página do Banco Central do Brasil na Internet (<http://www.bcb.gov.br>).

2. Havendo necessidade de retificação de algum valor informado deverá ser procedida a substituição de todo o arquivo referente a data-base. Nesse caso, o campo 'Tipo da Atualização', no registro de identificação, deverá ser preenchido com 'A'.

3. Após o envio do documento, deve ser acessada a transação PSTA300 para verificar se a transmissão foi efetuada com sucesso.

4. O documento somente será aceito se atendidos todos os critérios de consistência especificados no leiaute anexo, caso em que deverá aparecer a mensagem 'processamento efetuado sem erros' na transação PESP600 do Sistema de Informações Banco Central (SISBACEN).

5. Eventuais dúvidas poderão ser esclarecidas pelos Centros de Serviços de Informática e, na Sede, pela mesa de auxílio, telefone 0xx 61 414-2156.

Brasília, 27 de agosto de 2001.

DEPARTAMENTO DE CADASTRO E  
INFORMAÇÕES DO SISTEMA FINANCEIRO

Sergio Almeida de Souza Lima  
Chefe

DEPARTAMENTO DE  
INFORMÁTICA

Roberto Ozu  
Chefe

Este texto não substitui o publicado no DOU de 28/8/2001, Seção 1, p. 30-33, e no Sisbacen.



## **BANCO CENTRAL DO BRASIL**

### ANEXO A - Instruções de Preenchimento

Os leiautes descritos a seguir devem ser utilizados na geração de arquivos contendo os documentos 2310 e 2320, de que trata o art. 1º, incisos III e IV, da Circular nº 3.046, de 12 de julho de 2001.

Os campos numéricos:

- a) devem ser informados em valores absolutos no formato decimal externo ('DISPLAY');
- b) devem ser alinhados à direita e completados com zeros à esquerda;
- c) os valores devem ser informados em milhares de real.

Os campos alfanuméricos: devem ser alinhados à esquerda e completados com brancos à direita, exceção feita apenas aos campos de CNPJ, que devem ser alinhados à direita e completados com zero(s) à esquerda, quando for o caso.

Os registros de dados 1 (valores marcados a mercado) e os registros de dados 2 (valores título/vértice) cujos valores forem nulos podem ser omitidos.

Independentemente da manutenção dos dados que deram origem às informações, as instituições devem manter, pelo prazo mínimo de trinta dias, em meio magnético, cópia dos dados informados, de forma a ser possível pronta reposição do conteúdo primitivo, caso necessário.

**ATRIBUTOS/CONSISTÊNCIAS - OPERAÇÕES EXPOSTAS À VARIAÇÃO DE TAXA DE JUROS PREFIXADAS (AESP219)**



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

Anexo B (Instituições Financeiras/Conglomerados Financeiros)

### 1- REGISTRO DE IDENTIFICAÇÃO (LESP0022)

CAMPO	POSIÇÕES		PICTURE	CONTEÚDOS OBRIGATÓRIOS/CONSISTÊNCIAS
	DE	ATÉ		
Identificação do Registro	1	3	A(003)	#A1 ('#' = Valor hexa '23' em ASCII e '7B' em EBCDIC)
Código do documento	4	7	9(0004)	Fixo = 2310
Tipo da Atualização	8	8	A(0001)	'T' = Inclusão <ul style="list-style-type: none"><li>Somente para data referência ainda não informada</li></ul> 'A' = Alteração <ul style="list-style-type: none"><li>Somente para data referência já informada</li></ul>
CNPJ da Instituição	9	16	A(0008)	CNPJ da Instituição, com zeros à esquerda, se for o caso <ul style="list-style-type: none"><li>Cadastrado no Sisbacen</li></ul>
Data Referência	17	22	9(0006)	Data a que se refere os dados enviados, no formato AAAAMM <ul style="list-style-type: none"><li>Somente se o mês anterior tiver sido informado</li><li>Somente se os valores do último dia útil da transação diária do mês tiverem sido informados (EC e VAR)</li></ul>
Contato	23	52	A(0030)	Nome da pessoa a quem o Banco Central irá recorrer para solucionar eventuais problemas, relativos às informações prestadas <ul style="list-style-type: none"><li>Diferente de branco</li></ul>



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

DDD	53	54	9(0002)	DDD do telefone para contato <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li><li>• Diferente de zeros</li></ul>
Telefone	55	62	9(0008)	Telefone para contato <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li><li>• Diferente de zeros</li></ul>
Sequencial	63	66	N(0004)	Número sequencial do Registro <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li><li>• Sempre igual a 0001</li></ul>

### 2- REGISTRO DE DADOS 1 (LESP0023) - VALORES MARCADOS A MERCADO

CAMPO	POSIÇÕES		PICTURE	CONTEÚDOS OBRIGATÓRIOS/CONSISTÊNCIAS
	DE	ATÉ		
Tipo de registro	1	2	A(0002)	Fixo = 'D1', identifica registro de dados tipo 1
Código do Título	3	9	9(0007)	Código do Título, verificar tabela de códigos anexa
Valor marcado a mercado	10	20	9(0011)	Valor marcado a mercado, por título <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li></ul>
Filler	21	62	A(0042)	Espaços em branco
Sequencial	63	66	N(0004)	Número sequencial do Registro <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li><li>• Sempre igual ao anterior + 1</li></ul>



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

### 3- REGISTRO DE DADOS 2 (LESP0023) - VALORES TÍTULO/VÉRTICE

CAMPO	POSIÇÕES		PICTURE	CONTEÚDOS OBRIGATÓRIOS/CONSISTÊNCIAS
	DE	ATÉ		
Tipo de registro	1	2	A(0002)	Fixo = 'D2', identifica registro de dados tipo 2
Código do Título	3	9	9(0007)	Código do Título, verificar tabela de códigos anexa
Código do vértice	10	13	9(0004)	Código do vértice  = 21  = 42  = 63  = 126  = 252  = 504  = 756
Valor	14	24	9(0011)	Valor do título para o vértice  • Numérico
Filler	25	62	A(0038)	Espaços em branco
Sequencial	63	66	N(0004)	Número sequencial do Registro  • Numérico  Sempre igual ao anterior + 1

### 4- REGISTRO DE DADOS 3 (LESP0023) - VALORES VAR E EC

CAMPO	POSIÇÕES		PICTURE	CONTEÚDOS OBRIGATÓRIOS/CONSISTÊNCIAS
	DE	ATÉ		
Tipo de	1	2	A(0002)	Fixo = 'D3', identifica registro de dados tipo 3



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

registro				
Código do VAR ou EC	3	9	9(0007)	VAR = 9060000 EC = 9070000
Valor	10	20	9(0011)	Valor do VAR ou EC <ul style="list-style-type: none"> <li>Numérico</li> </ul>
Filler	21	62	A(0042)	Espaços em branco
Sequencial	63	66	N(0004)	Número sequencial do Registro <ul style="list-style-type: none"> <li>Numérico</li> </ul> Sempre igual ao anterior + 1

### 5- REGISTRO DE CONTROLE FINAL (LESP0024)

CAMPO	POSIÇÕES		PICTURE	CONTEÚDOS OBRIGATÓRIOS/CONSISTÊNCIAS
	DE	ATÉ		
Identificação do Registro	1	3	A(003)	@10 ('@' = Valor hexa '23' em ASCII e '7C' em EBCDIC)
Código do documento	4	7	9(0004)	Fixo = 2310
CNPJ da Instituição	8	15	A(0008)	CNPJ da Instituição, com zeros à esquerda, se for o caso <ul style="list-style-type: none"> <li>Cadastrado no Sisbacen</li> </ul>
Filler	16	62	A(0047)	Espaços em branco
Sequencial	63	66	N(0004)	Número sequencial do Registro <ul style="list-style-type: none"> <li>Numérico</li> <li>Sempre igual ao anterior + 1</li> </ul>

ATRIBUTOS/CONSISTÊNCIAS - OPERAÇÕES EXPOSTAS À VARIAÇÃO DE TAXA DE JUROS PREFIXADAS (AESP218)



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

ANEXO C (Consolidado na forma da Resolução nº 2.723/2000)

### 1- REGISTRO DE IDENTIFICAÇÃO (LESP0025)

CAMPO	POSIÇÕES		PICTURE	CONTEÚDOS OBRIGATÓRIOS/CONSISTÊNCIAS
	DE	ATÉ		
Identificação do Registro	1	3	A(003)	#A1 ('#' = Valor hexa '23' em ASCII e '7B' em EBCDIC)
Código do documento	4	7	9(0004)	Fixo = 2320
Tipo da Atualização	8	8	A(0001)	'I' = Inclusão <ul style="list-style-type: none"><li>Somente para data referência ainda não informada</li></ul> 'A' = Alteração <ul style="list-style-type: none"><li>Somente para data referência já informada</li></ul>
CNPJ da Instituição	9	16	A(0008)	CNPJ da Instituição, com zeros à esquerda, se for o caso <ul style="list-style-type: none"><li>Cadastrado no Sisbacen</li></ul>
Data Referência	17	22	9(0006)	Data a que se refere os dados enviados, no formato AAAAMM <ul style="list-style-type: none"><li>Somente se o mês anterior tiver sido informado</li><li>Somente se os valores do último dia útil da transação diária do mês tiverem sido informados (EC e VAR)</li></ul>
Contato	23	52	A(0030)	Nome da pessoa a quem o Banco Central irá recorrer para solucionar eventuais problemas, relativos às informações prestadas <ul style="list-style-type: none"><li>Diferente de branco</li></ul>



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

DDD	53	54	9(0002)	DDD do telefone para contato <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li><li>• Diferente de zeros</li></ul>
Telefone	55	62	9(0008)	Telefone para contato <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li><li>• Diferente de zeros</li></ul>
Seqüencial	63	66	N(0004)	Número seqüencial do Registro <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li><li>• Sempre igual a 0001</li></ul>

### 2- REGISTRO DE DADOS 1 (LESP0026) - VALORES MARCADOS A MERCADO

CAMPO	POSIÇÕES		PICTURE	CONTEÚDOS - OBRIGATÓRIOS/CONSISTÊNCIAS
	DE	ATÉ		
Tipo de registro	1	2	A(0002)	Fixo = 'D1', identifica registro de dados tipo 1
Código do Título	3	9	9(0007)	Código do Título, verificar tabela de códigos anexa
Valor marcado a mercado	10	20	9(0011)	Valor marcado a mercado, por título <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li></ul>
Filler	21	62	A(0042)	Espaços em branco
Seqüencial	63	66	N(0004)	Número seqüencial do Registro <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li><li>• Sempre igual ao anterior + 1</li></ul>





## BANCO CENTRAL DO BRASIL

### 3- REGISTRO DE DADOS 2 (LESP0026) - VALORES TÍTULO/VÉRTICE

CAMPO	POSIÇÕES		PICTURE	CONTEÚDOS OBRIGATÓRIOS/CONSISTÊNCIAS
	DE	ATÉ		
Tipo de registro	1	2	A(0002)	Fixo = ' D2', identifica registro de dados tipo 2
Código do Título	3	9	9(0007)	Código do Título, verificar tabela de códigos anexa
Código do vértice	10	13	9(0004)	Código do vértice  = 21  = 42  = 63  = 126  = 252  = 504  = 756
Valor	14	24	9(0011)	Valor do título para o vértice  • Numérico
Filler	25	62	A(0038)	Espaços em branco
Sequencial	63	66	N(0004)	Número sequencial do Registro  • Numérico  Sempre igual ao anterior + 1

### 4- REGISTRO DE DADOS 3 (LESP0026) - VALORES VAR E EC

CAMPO	POSIÇÕES		PICTURE	CONTEÚDOS OBRIGATÓRIOS/CONSISTÊNCIAS
	DE	ATÉ		
Tipo de registro	1	2	A(0002)	Fixo = ' D3', identifica registro de dados tipo 3



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

Código do VAR ou EC	3	9	9(0007)	VAR = 9060000 EC = 9080000
Valor	10	20	9(0011)	Valor do VAR ou EC <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li></ul>
Filler	21	62	A(0042)	Espaços em branco
Seqüencial	63	66	N(0004)	Número seqüencial do Registro <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li><li>• Sempre igual ao anterior + 1</li></ul>

### 5 - REGISTRO DE CONTROLE FINAL (LESP0027)

CAMPO	POSIÇÕES		PICTURE	CONTEÚDOS OBRIGATÓRIOS/CONSISTÊNCIAS
	DE	ATÉ		
Identificação do Registro	1	3	A(003)	@10 ('@' = Valor hexa '23' em ASCII e '7C' em EBCDIC)
Código do documento	4	7	9(0004)	Fixo = 2320
CNPJ da Instituição	8	15	A(0008)	CNPJ da Instituição, com zeros à esquerda, se for o caso <ul style="list-style-type: none"><li>• Cadastrado no Sisbacen</li></ul>
Filler	16	62	A(0047)	Espaços em branco
Seqüencial	63	66	N(0004)	Número seqüencial do Registro <ul style="list-style-type: none"><li>• Numérico</li><li>• Sempre igual ao anterior + 1</li></ul>



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

### CÓDIGOS DE TÍTULOS DE OPERAÇÕES EXPOSTAS À VARIAÇÃO DE TAXAS DE JUROS PREFIXADAS - DOCUMENTO 2310

Código	Descrição
<b>1. Ativos</b>	
1.01.00.00	Disponibilidades
1.02.00.00	Aplicações Interfinanceiras de Liquidez
1.02.01.00	Operações Compromissadas
1.02.02.00	Depósitos Interfinanceiros
1.02.03.00	Outras Aplicações Interfinanceiras de Liquidez
1.03.00.00	Títulos e Valores Mobiliários
1.03.01.00	No País
1.03.02.00	No Exterior
1.04.00.00	Relações Interfinanceiras
1.05.00.00	Relações Interdependências
1.06.00.00	Operações de Crédito
1.07.00.00	Arrendamento Mercantil
1.08.00.00	Outros Créditos
<b>2. Passivos</b>	
2.01.00.00	Depósitos
2.01.01.00	Depósitos à Vista
2.01.02.00	Depósitos Interfinanceiros
2.01.03.00	Depósitos a Prazo
2.01.04.00	Outros Depósitos
2.02.00.00	Obrigações por Operações Compromissadas
2.03.00.00	Recursos de Aceites Cambiais
2.04.00.00	Relações Interfinanceiras
2.05.00.00	Relações Interdependências
2.06.00.00	Obrigações por Empréstimos e Repasses
2.06.01.00	No País
2.06.02.00	No Exterior



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

2.07.00.00	Outras Obrigações
2.07.01.00	No País
2.07.02.00	No Exterior
<b>3. Demais Posições Ativas e Passivas</b>	
3.01.00.00	Operações de Mercado Futuro
3.02.00.00	Operações de Swaps
3.03.00.00	Operações de Mercado a Termo
3.04.00.00	Opções de Compra Flexíveis
3.05.00.00	Opções de Venda Flexíveis
3.06.00.00	Opções de Compra Padronizadas
3.07.00.00	Opções de Venda Padronizadas
3.08.00.00	Opções de Swaps
3.09.00.00	Outras



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

### CÓDIGOS DE TÍTULOS DE OPERAÇÕES EXPOSTAS À VARIAÇÃO DE TAXAS DE JUROS PREFIXADAS - DOCUMENTO 2320

Código	Descrição
<b>1. Ativos - Empresas Financeiras</b>	
1.01.00.00	Disponibilidades
1.02.00.00	Aplicações Interfinanceiras de Liquidez
1.02.01.00	Operações Compromissadas
1.02.02.00	Depósitos Interfinanceiros
1.02.03.00	Outras Aplicações Interfinanceiras de Liquidez
1.03.00.00	Títulos e Valores Mobiliários
1.03.01.00	No País
1.03.02.00	No Exterior
1.04.00.00	Relações Interfinanceiras
1.05.00.00	Relações Interdependências
1.06.00.00	Operações de Crédito
1.07.00.00	Arrendamento Mercantil
1.08.00.00	Outros Créditos
<b>2. Passivos - Empresas Financeiras</b>	
2.01.00.00	Depósitos
2.01.01.00	Depósitos à Vista
2.01.02.00	Depósitos Interfinanceiros
2.01.03.00	Depósitos a Prazo
2.01.04.00	Outros Depósitos
2.02.00.00	Obrigações por Operações Compromissadas
2.03.00.00	Recursos de Aceites Cambiais
2.04.00.00	Relações Interfinanceiras
2.05.00.00	Relações Interdependências
2.06.00.00	Obrigações por Empréstimos e Repasses
2.06.01.00	No País
2.06.02.00	No Exterior
2.07.00.00	Outras Obrigações



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

2.07.01.00	No País
2.07.02.00	No Exterior
<b>3. Demais Posições Ativas e Passivas - Empresas Financeiras</b>	
3.01.00.00	Operações de Mercado Futuro
3.02.00.00	Operações de Swaps
3.03.00.00	Operações de Mercado a Termo
3.04.00.00	Opções de Compra Flexíveis
3.05.00.00	Opções de Venda Flexíveis
3.06.00.00	Opções de Compra Padronizadas
3.07.00.00	Opções de Venda Padronizadas
3.08.00.00	Opções de Swaps
3.09.00.00	Outras
<b>4. Ativos-Empresas Não-Financeiras</b>	
4.01.00.00	Atividade Seguradora
4.02.00.00	Atividade de Previdência Privada
4.03.00.00	Atividade de Capitalização
4.04.00.00	Atividade de Cartão de Crédito
4.05.00.00	Demais Atividades
<b>5. Passivos-Empresas Não-Financeiras</b>	
5.01.00.00	Atividade Seguradora
5.02.00.00	Atividade de Previdência Privada
5.03.00.00	Atividade de Capitalização
5.04.00.00	Atividade de Cartão de Crédito
5.05.00.00	Demais Atividades
<b>6. Demais Posições Ativas e Passivas - Empresas Não-Financeiras</b>	
6.01.00.00	Atividade Seguradora
6.02.00.00	Atividade de Previdência Privada
6.03.00.00	Atividade de Capitalização
6.04.00.00	Atividade de Cartão de Crédito
6.05.00.00	Demais Atividades



## BANCO CENTRAL DO BRASIL

### CÓDIGOS DE TÍTULOS DE OPERAÇÕES EXPOSTAS À VARIAÇÃO DE TAXAS DE JUROS PREFIXADAS - DOCUMENTOS 2310/2320

Código	Descrição
<b>9-Totais</b>	
9.01.00.00	A1-Fluxo I (1+2)
9.02.00.00	A2-Fluxo II (3)
9.03.00.00	A3-Fluxo II (4+5)
9.04.00.00	A4-Fluxo III (3+6)
9.05.00.00	A5-Fluxo Marcado a Mercado - Circular No.2972/00
9.06.00.00	B-VAR da Carteira na Data
9.07.00.00	C- Exigência de Capital- Instituições Financeiras
9.08.00.00	D- Exigência de Capital- Conglomerado Econômico