

MANUAL DE OPERAÇÕES – OPÇÕES FLEXÍVEIS

CONTEÚDO

1	ATUALIZAÇÕES	3
2	INTRODUÇÃO ÀS OPÇÕES FLEXÍVEIS	8
2.1	Conhecendo o produto	8
2.2	Ações dos botões das telas.....	10
3	LANÇAMENTOS	10
3.1	Registro de Contrato.....	10
3.2	Registro de Mercadoria	13
3.3	Registro Opção de Ações Nacionais.....	22
3.4	Registro Opção de Paridade	30
3.5	Registro Opção de Índice	43
3.6	Registro Opção de Índices Internacionais.....	49
3.7	Alteração.....	58
3.8	Exclusão	62
3.9	Antecipação de Contrato	63
3.10	Avaliação de Contrato de Opção.....	67
3.11	(Não) Exercício de Contrato de Opção	71
3.12	Cancelamento de Operações.....	75
3.13	Cessão de Contrato de Opção	76
3.14	Confirmação de Cessão de Contrato de Opção	79
3.15	Informação de Valor de Rebate.....	82
4	CONSULTAS	83
4.1	Características de Contratos	83
4.2	Erros em Arquivos	87
4.3	Lançamentos	87
5	INFORMAÇÕES ADICIONAIS	89
5.1	Cruzamento de funcionalidades	89
5.2	Regras para Registro de Contrato de Paridade conforme Fonte de Informação	90
5.3	Regras para Registro de Contrato de Ações/ Índice/Mercadoria.....	91
5.4	Metodologia de cálculo de valores financeiros para liquidação	92
5.5	Informações Adicionais	92
5.6	Tratamento de Proventos	94
5.7	Ativos Subjacentes Disponíveis	96
5.8	Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros	96

1 ATUALIZAÇÕES

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
29/06/2020	19/11/2020	Tratamento de Proventos	Ajuste na descrição de Tratamento de Proventos
29/06/2020	29/06/2020	Avaliação de Contrato de Opção	Atualização de telas de Avaliação de contrato, conforme divulgado no comunicado 019/2020-VPC.
29/06/2020	29/06/2020	Alteração de Contrato	Informação que o contrato de Opção poderá ter mais de uma alteração no dia, conforme divulgado no comunicado 019/2020-VPC.
29/06/2020	29/06/2020	Intermediação de Contrato	Ajuste no texto referente à grade da Intermediação de um contrato de Opção.
28/05/2019	14/10/2019	Consultas	Alteração na descrição do quadro de situações possíveis.
28/05/2019	08/10/2019	Avaliação de Contrato de Opção	Inclusão das telas de lançamentos para Índices Internacionais.
28/05/2018	26/12/2018	Registro de Mercadoria	Melhoria da descrição dos campos “Datas de Verificação” e “Cotação para o Vencimento”.
28/05/2018	26/12/2018	Regras de Negócios	Alteração do nome para “Informações Adicionais” e melhoria da descrição.
28/05/2018	26/12/2018	Glossário	Exclusão do trecho.
28/05/2018	30/08/2018	Registro Opção de Ações Nacionais Registro Opção de Paridade Registro Opção de Índice Registro Opção de Índices Internacionais	Atualização da descrição do campo “Data de Liquidação do Prêmio”.
28/05/2018	29/08/2018	Registro de Contrato	Atualização da descrição do campo “Data de Liquidação do Prêmio”.
28/05/2018	28/05/2018	Lançamentos – Antecipação de Contrato	Alteração no comportamento das antecipações de derivativos com Redutor do Risco de Crédito, conforme divulgado no COMUNICADO EXTERNO 006/2018-VPC, 008/2018 – VPC e 012/2017 – DN.
11/09/2017	29/01/2018	Registro Opção de Índices Internacionais Registro Opção de Índice Registro Opção de Paridade Registro Opção de Ações Nacionais Registro de Mercadoria	Alteração de regra para combinação de Parte e Contraparte nos contratos.
11/09/2017	29/01/2018	Registro Opção de Índices Internacionais Registro Opção de Índice Registro Opção de Paridade Registro Opção de Ações Nacionais Registro de Mercadoria	Melhoria nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
11/09/2017	05/01/2018	Cessão de Contrato de Opção	Atualização da descrição do campo “Valor do Prêmio em R\$”
11/09/2017	11/09/2017	Características de Contratos	Atualização das telas Filtro, Relação e Detalhe.
11/09/2017	11/09/2017	Registro de Contrato – Registro Opção de Índice	Inclusão do campo Fonte de Consulta.
31/07/2017	09/08/2017	Registro Opção de Paridade	Melhoria da descrição do campo “Preço de Exercício”
31/07/2017	31/07/2017	Registro Opção de Ações Nacionais	Inclusão dos domínios D-2, D-3, D-4 e D-5 no campo “Cotação para o Vencimento” de acordo com o comunicado 038/17.
27/05/2016	31/01/2017	Regras para Registro de Contrato de Ações/ Índice/Mercadoria Registro Opção de Índices Internacionais Registro Opção de Índice Registro Opção de Paridade Registro Opção de Ações Nacionais Registro de Mercadoria	Alteração de descrição de alguns campos.
27/05/2016	31/01/2017	Ações Negociadas Moedas Negociadas	Exclusão dos seguintes arquivos.
27/05/2016	31/01/2017	Ativos Subjacentes Disponíveis	Inclusão do arquivo “Ativos Subjacentes Disponíveis” .
27/05/2016	26/12/2016	Conhecendo o produto	Alteração na Observação de Opções Flexíveis com Agenda de Redutor de Risco Crédito.
27/05/2016	22/11/2016	Cessão de Contrato de Opção	Exclusão do termo “quando houver” do Campo “Valor do Premio em R\$”.
27/05/2016	01/07/2016	Registro Opção de Índices Internacionais	Atualização nas descrições dos campos: “Fonte de Informação, Fonte de Consulta, Praça de Negociação e Data de avaliação”.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
27/05/2016	22/06/2016	Informações Adicionais	Inclusão do item: Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros
27/05/2016	27/05/2016	Histórico de ajustes de Proventos	Exclusão do tópico.
25/01/2016	26/04/2016	Registro Opção de Paridade Registro Opção de Índice Registro Opção de Índices Internacionais	Alteração nas descrições dos campos “Outra Fonte de Consulta, Tela ou Função de Consulta, Praça de Negociação e Horário de Consulta”.
25/01/2016	25/04/2016	Registro Opção de Índices Internacionais	Alteração na descrição do campo “Cotação para o Vencimento”.
25/01/2016	09/03/2016	Registro de Mercadoria Registro Opção de Ações Nacionais Registro Opção de Paridade Registro Opção de Índice Registro Opção de Índices Internacionais	Alteração na descrição do campo “Forma de Disparo”.
25/01/2016	02/03/2016	Conhecendo o Produto (Opções Flexíveis com Agenda de Redutor de Risco Crédito)	Inclusão da observação 1).
25/01/2016	12/02/2016	Tratamento de Proventos	Inclusão da observação 6 sobre Trigger – Proporção.
25/01/2016	25/01/2016	Registro Opção de Índice	Inclusão de caixa de seleção com as opções: D0, D-1, D-2 e D-3 na descrição do campo “Cotações para Vencimento”.
23/11/2015	23/11/2015	Registro Opção de Paridade	Alteração da tela Registro Opção de Paridade - Feeder ou Spot (tela) e inclusão dos campos “Fonte de Informação e Cotação para o vencimento”, conforme comunicados 015/15, 042/15 e 087/15.
18/05/2015	27/08/2015	Registro de Mercadoria Registro Opção de Ações Nacionais Registro Opção de Paridade Registro Opção de Índice Registro Opção Índices Internacionais	Alteração na descrição do campo “Forma de Disparo”.
18/05/2015	21/07/2015	Registro Opção de Ações Nacionais e Índices	Melhoria na descrição do campo Valor Base/Quantidade.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
18/05/2015	01/07/2015	Todo o manual	Inclusão do Índice Selic.
18/05/2015	29/06/2015	Ações Negociadas	Atualização da tabela.
18/05/2015	19/06/2015	Registro de Mercadoria	Exclusão da informação “não deve possuir barreiras (Knock In, Knock Out e Knock in/Knock Out)”, no campo Data de Liquidação do Prêmio.
18/05/2015	16/06/2015	Registro Opção de Paridade	Exclusão da informação “não deve possuir barreiras (Knock In, Knock Out e Knock in/Knock Out)”, no campo Data de Liquidação do Prêmio.
18/05/2015	18/05/2015	Registro de Contrato	Não é permitido o registro de opção ou box com o Titular e Lançador com o mesmo CPF/CNPJ.
02/06/2014	04/03/2015	Cruzamento de Funcionalidades	“Opção Quanto” deve ter “Impossível” na coluna da “Opção de Paridade”.
02/06/2014	27/01/2015	Alteração na descrição dos campos “Quantidade”	Mudança na descrição do campo “Quantidade” para Registro de Opção de Índices Internacionais, Opção de Índice, Opção de Paridade e Ações Nacionais.
02/06/2014	25/11/2014	Diversas funções	Alteração de tela (layout, forma e cor).
02/06/2014	31/10/2014	Registro de Mercadoria; Registro de Opção de Ações Nacionais; Registro Opção de Paridade; Registro Opção de Índice; Registro Opção de Índices Internacionais.	No campo Data de Liquidação do Prêmio, alterar: DE: A data deve ser um dia útil e menor que a data do Vencimento. PARA: A data deve ser um dia útil e menor ou igual que a data do Vencimento.
02/06/2014	31/10/2014	Atualização da Versão	Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais nova para a mais antiga.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
02/06/2014	10/09/2014	Todo o manual	Nas descrições dos campos, inclusão da informação se o preenchimento é obrigatório ou não.
02/06/2014	08/08/2014	Conhecendo o Produto	Inclusão do texto sobre Opções Flexíveis com Agenda de Redutor de Risco Crédito.
02/06/2014	28/07/2014	Todo o manual	Inclusão do caminho completo da função no NoMe.
02/06/2014	15/07/2014	Regras de Negócios	Inclusão de informações sobre a atualização de contratos de Opções de Mercadorias.
02/06/2014	02/06/2014	Moedas Negociadas	Inclusão da moeda CNH.
02/06/2014	02/06/2014	Registro de Opção de Ações Nacionais, Registro de Ação de Índice e Índices Internacionais	Mudança na descrição do campo "Data de Liquidação do Prêmio". Conforme comunicado 061/14.
10/12/2012	24/02/2014	Ações Negociadas	Inclusão da ação BBTG11.
10/12/2012	04/11/2013	Registro de Mercadoria e Opção de Paridade	Mudança na descrição do campo "Data de Liquidação do Prêmio".
10/12/2012	07/08/2013	Informações Adicionais	Inclusão da linha índice internacional em Regras para Registro de Contrato de Ações/Índice/Mercadoria.
10/12/2012	21/02/2013	Campos com a descrição opcional.	Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
10/12/2012	14/02/2013	Registro/Exclusão	Mudança: Exclusão mercado x mercado será permitida apenas em D0.
10/12/2012	10/12/2012	Registro de Mercadoria	Inclusão do campo "Cotação para Moeda".
19/09/2012	10/05/2012	Ações Negociadas	Inclusão das ações negociadas
18/06/2012	25/09/2012	Campo: Data da Liquidação do Prêmio	Melhoria no texto.
18/06/2012	17/09/2012	Alteração de Contrato	Impossibilidade de alteração de CPF/CNPJ.
18/06/2012	18/06/2012	Registro de Opções	Registro de contrato referenciado em cotação de índices Internacionais e valor de cotas de ETFs internacionais
18/06/2012	18/06/2012	Registro de Opções	É possível o registro de contrato de opções onde o lançador e o titular podem ser uma conta cliente.
19/09/2011	07/05/2012	Registro de Ações	Melhorias no texto do campo "Data de Avaliação" do Registro de Contrato.

2 INTRODUÇÃO ÀS OPÇÕES FLEXÍVEIS

2.1 Conhecendo o produto

O contrato de Opções Flexíveis concede ao seu titular o direito de comprar ou de vender determinada moeda/ação/índice/mercadoria, a um preço de exercício determinado em uma data de exercício.

O exercício de Opções Flexíveis sobre Taxa de Câmbio, Ações, Índice ou Mercadoria pode ser efetuado a partir do dia útil seguinte ao registro até a data de vencimento (opção do tipo **Americana**) ou exclusivamente na data de vencimento (opção do tipo **Europeu**).

É possível registrar contratos referenciados em moedas estrangeiras cotadas contra o real, bem como, registrar contratos com Opções de Paridade que permitem fechar contratos entre duas moedas estrangeiras distintas.

A opção permite a inclusão de um limitador, de alta (Cap) se a opção for de compra (Call) ou de baixa (Floor) se a opção for de venda (Put). Este limitador tem por objetivo estabelecer um preço máximo para efeito de exercício da opção de compra e um preço mínimo para efeito de exercício de opção de venda.

Não havendo limitador de alta ou de baixa, ou se o mesmo não for atingido, a opção será exercida pelo diferencial entre o preço de exercício e o preço do instrumento financeiro à vista.

Caso o preço à vista na data de exercício ultrapasse o limite existente, a opção é exercida pelo diferencial entre o referido limite e o preço de exercício.

O Módulo permite que os Participantes realizem o registro de Opções Flexíveis baseado em contratos futuros ou à vista de mercadoria, sem previsão de entrega física, referenciadas em preços praticados no mercado em bolsas de mercadorias nacionais ou internacionais.

Além disso, é permitido registrar Opções Flexíveis na modalidade Média Asiática, em que a taxa de câmbio ou preço da ação/índice, utilizada para liquidação da operação, é resultante da média de taxas/preços vigentes em datas previamente fixadas no registro do contrato.

É permitido também, fixar um gatilho para efetivar (knock in) e/ou cancelar (knock out) os Contratos de Opções com a prerrogativa de indicação de Rebate para tais funcionalidades.

Na hipótese de o Preço/Valor, por qualquer que seja o motivo, não estar disponível na data de exercício, a captura das cotações não será realizada e o processamento da Liquidação Financeira do Valor do Exercício ocorrerá fora do ambiente da Cetip.

É responsabilidade do(s) Participante(s) entregar correspondência a Cetip, na data da ocorrência do referido exercício, informando as condições acordadas para o encerramento da operação. Na

data do exercício o contrato assumirá a situação **Aguardando Avaliação** sendo retirado automaticamente do Módulo após seu fechamento.

Opções Flexíveis de Ações

Os contratos de Opções Flexíveis de Ações têm como ativo objeto Ações ou cotas de ETF – Exchange Trade Fund (Fundos de Índices) com negociação e divulgação nacional.

A captura automática das cotações, para cálculo do diferencial financeiro do exercício, é baseada em D-1 da data do exercício da opção.

Tratamento de Proventos de Ações

As Opções Flexíveis de Ações tem, no registro, a possibilidade de indicação de **proteção contra proventos em dinheiro** para ação objeto da opção. Conforme o preenchimento desta informação, o Módulo efetuará o seguinte tratamento:

Sim - Na ocorrência de todos os tipos de proventos, Bonificação, Dividendos e/ou Subscrição, os contratos terão seus valores de referência alterados automaticamente pelo Módulo refletindo sua situação em proventos; ou.

Não - Na ocorrência de proventos dos tipos Dividendos e/ou Subscrição os contratos não terão seus valores de referência alterados automaticamente pelo Módulo.

Observação: Para maiores informações sobre como acessar o módulo, consulte o manual do NoMe.

Opções Flexíveis com Agenda de Redutor de Risco Crédito

É possível registrar no Módulo de Informações de Derivativos os eventos e as condições de agenda de Redutor de Risco de Crédito, para os seguintes contratos de Opções:

Paridades, Ações, Índices e Mercadorias.

A agenda de redutor de risco de crédito poderá ser incluída no MID a partir da finalização do registro do derivativo original, bem como a indicação de agente de cálculo para o referido contrato.

Entende-se por evento de redutor de risco de crédito o momento em que o contrato de derivativo é avaliado e para qual deve ser informado seu preço de mercado (MtM).

Cada preço de mercado (MtM) informado terá uma liquidação financeira, desde que as condições do acordo de redutor de risco de crédito sejam atingidas. Em decorrência da liquidação financeira desses eventos existirá um saldo (teórico) atualizado por um indexador, arbitrado no ato da inclusão dos eventos de redutor de risco de crédito.

Os cancelamentos dos contratos originais, inclusive os decorrentes de funcionalidades, cancelarão automaticamente as agendas de eventos de Derivativos com Redutor de Risco de Crédito do MID.

Observação:

- 1) Opções com redutor de risco de crédito não podem ser gravados no módulo de Registro de Contrato de Garantia.

2.2 Ações dos botões das telas

Os botões das telas exibidas ao longo do manual estão relacionados às seguintes ações:

Botão	Funcionalidade
Enviar	Envia os dados informados para validação. Havendo algum dado incorreto é apresentada mensagem de erro
Limpar campos	Limpa todos os campos selecionados e digitados
Voltar	Retorna à tela inicial com os últimos dados selecionados/digitados
Desistir	Retorna à tela inicial com os dados editáveis em branco
Confirmar	Confirma os dados informados em tela
Corrigir	Retorna à tela anterior com os dados editados para eventual correção
Pesquisar	Submete os dados selecionados para pesquisa
Avançar	Envia os dados para validação. Caso haja algum dado incorreto é apresentada mensagem de erro.

3 LANÇAMENTOS

3.1 Registro de Contrato

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Registro de Contrato

Visão Geral

Através desta função, o participante pode realizar duas ações: **registrar** ou **alterar** um contrato, quando permitido.

É possível o registro de contrato de opções onde o lançador e o titular podem ser uma conta cliente. Estas operações podem ser registradas entre contra cliente 10 do mesmo titular e entre contas clientes 20 de titulares diferentes.

O registro do contrato é considerado aprovado pelo módulo após o casamento dos lançamentos efetuados pelas partes e após a liquidação financeira do prêmio, se a data de liquidação do prêmio for igual à data de registro do contrato, a ser pago pelo *Titular* no registro da operação.

As operações com cliente próprio, conta tipo 1 ou 2, tem a liquidação do prêmio finalizada por comando único.

Registro de Opções Flexíveis com barreiras, o titular paga prêmio em Reais à contraparte, embutido no prêmio da opção, para ter o direito de fazer valer determinada condição prevista em um contrato. O contrato produz direito e obrigações a seus contratantes, somente se o trigger for disparado, ou seja, se a barreira Knock In for atingida ou ultrapassada, ou o contrato perde a validade se a barreira Knock Out for atingida ou ultrapassada.

Nos contratos com barreiras as partes têm a prerrogativa de indicação de rebate de prêmio caso o contrato vença e não seja disparado o trigger.

Registro de Opções Flexíveis com média asiática, o valor financeiro para liquidação do contrato é resultante da média aritmética simples ou ponderada das cotações vigentes para as datas de verificação definidas no contrato.

O capítulo **Informações Adicionais** exibe as possíveis combinações de registro por objeto da opção flexível. Neste capítulo, é apresentada também, uma tabela de cruzamento de funcionalidades existentes no módulo.

Para registrar o contrato de opção, o participante deve selecionar na Tela de Filtro, o **Tipo de Instrumento Financeiro**, o Tipo Indicador, a ação **Inclusão** e informar o código que os participantes atribuem ao instrumento financeiro.

Tela de Filtro

Registro/Emissão			
Instrumento Financeiro			Ação
Tipo	Código	Tipo Indicador	
BOX2	RIO M146789	PARIDADE	INCLUSÃO

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Tipo	Tipo de Instrumento Financeiro. Informar a Opção: BOX2, OFCC e OFVC.
Código	Código do Instrumento Financeiro.
Tipo Indicador	Informar o tipo de indicador: PARIDADE, AÇÕES NACIONAIS, ÍNDICES, ÍNDICES INTERNACIONAIS OU MERCADORIA.
Ação	Informar o tipo de ação: INCLUSÃO, EXCLUSÃO ou ALTERAÇÃO.

As informações são validadas e a Tela de Registro do contrato somente é disponibilizada se não houver erro, como por exemplo, código já cadastrado, mnemônico incorreto, ano, caracteres da sequência inválidos etc.

Clique no botão **Avançar** para exibir a tela para o Registro de Contrato.

3.2 Registro de Mercadoria

Registro de Opção - OFCC RIO M146541			
Parte:	05000	, 00	- 5 TITULAR
CPF / CNPJ (Parte):			
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO		
Contraparte:	05000	, 10	- 8
CPF / CNPJ (Contraparte):	98765432100		
Mercadoria:	MAL0		
Data Início:	21	/ 11	/ 2014
Data Vencimento:	22	/ 12	/ 2014
Preço Exercício:	100000	,	
Preço de Exercício em Reais:	<input type="checkbox"/>		
Prêmio Unitário:	1000	,	
Data de Liquidação do Prêmio:	21	/ 11	/ 2014
Opção Quanto:	<input type="checkbox"/>		
Cotação para Opção Quanto:		,	
Valor Base / Quantidade:	100000	,	
Limite:		,	
Tipo de Exercício:	EUROPÉIA		
Barreiras:	SELECIONE:		
Liquidante:	70180	, 00	- 8
Modalidade:	SEM MODALIDADE		
Adesão a Contrato:	SEM ADESAO		
Meu Número:	6541		
Intermediador:		.	-
Comissão paga pelo Titular em R\$:		,	
Comissão paga pelo Lançador em R\$:		,	
Média para Opção Asiática:	SELECIONE:		

(continua)

<p>Datas de Verificação:</p>	<div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%; position: relative;"> <div style="position: absolute; top: -10px; right: -10px;">↑</div> <div style="position: absolute; bottom: -10px; right: -10px;">↓</div> <div style="position: absolute; left: -10px; bottom: -10px;">←</div> <div style="position: absolute; right: -10px; bottom: -10px;">→</div> </div> <div style="text-align: center; margin-top: 5px;"> <input type="button" value="Informar Datas"/> </div>
<p>Cotação para o Vencimento:</p>	<input type="text" value="D-1"/>
<p>Cotação para Moeda:</p>	<input type="text" value="D-1"/>
<p>Observação :</p>	<div style="border: 1px solid black; height: 80px; width: 100%; position: relative;"> <div style="position: absolute; top: -10px; right: -10px;">↑</div> <div style="position: absolute; bottom: -10px; right: -10px;">↓</div> </div>

(fim)

Descrição dos campos da Tela de Registro

Campo	Descrição
Parte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip do participante (Própria 00, 70 a 89 ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato e Caixa de Seleção para identificar o participante no registro (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>).</p>
CPF / CNPJ (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Parte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC</p> <p>CPF ou CNPJ da Parte. Há necessidade de <i>matching</i> das informações.</p> <p>Não é permitido o registro de opção ou box com o Titular e Lançador com o mesmo CPF/CNPJ.</p>
Cesta de Garantias - Lançador	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Não (default) ou Sim. Deve ser selecionada a opção Não</p> <p>Funcionalidade descontinuada pelo Módulo de Gestão de Colateral.</p>
Contraparte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip da contraparte (Própria 00, 70 a 89 ou Cliente 1 e 2) envolvido na operação (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>).</p>
CPF / CNPJ (Contraparte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Contraparte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC</p> <p>CPF ou CNPJ da Contraparte. Há necessidade de <i>matching</i> das informações.</p> <p>Não é permitido o registro de opção ou box com o Titular e Lançador com o mesmo CPF/CNPJ.</p>

Campo	Descrição
Mercadoria	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Ativo subjacente da opção.</p> <p>Deve ser indicado o código da mercadoria.</p> <p>O código da mercadoria pode ser consultado no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias.</p>
Data Início	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data de seu registro no Módulo. Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Nos contratos que envolvam clientes 10, pode ser anterior a Data de Registro em até d-2, inclusive.</p> <p>Exclusivamente para Opção de Mercadoria a data de início pode ser maior ou igual à data de registro - Termo.</p>
Data de Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data do exercício da opção Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Formato: DD/MM/AAAA</p>
Preço de Exercício	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor da mercadoria contratada entre <i>Titular</i> e <i>Lançador</i> para o exercício da opção. Preencher com 8 (oito) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros.</p>
Preço de Exercício em Reais	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Permitido para mercadoria cotada em moeda diferente do real.</p> <p>Indica que o preço de exercício, o limitador e os triggers informados no registro do contrato estão expressos em reais.</p>
Prêmio Unitário	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Preço unitário, em Reais, pago pelo <i>Titular</i> ao <i>Lançador</i>, na data de registro. Até 8 casas decimais</p>
Data de liquidação do Prêmio	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>É permitido para operações com cliente e mercado.</p> <p>Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada o Módulo usa a data de registro para data de liquidação do prêmio</p> <p>Se data informada, o Módulo utiliza a data indicada para liquidação prêmio.</p> <p>A data deve ser dia útil e menor que a data do vencimento quando o registro de opção for Ações Nacionais, Índices, Índices Internacionais ou Mercadorias.</p> <p>A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento quando o registro de opção for Paridade.</p> <p>Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da Cetip.</p>

Campo	Descrição
Opção Quanto	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Permitido para mercadoria cotada em moeda diferente do real.</p> <p>Indica que a liquidação financeira em reais do contrato é apurada somente com a variação da diferença de cotações em moeda estrangeira, sem conversão das cotações para o real.</p> <p>O valor do exercício é apurado pela multiplicação da diferença de cotações (em moeda estrangeira) e a quantidade do contrato.</p>
Cotação para Opção Quanto	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando campo "Opção Quanto" for indicado.</p> <p>Valor da cotação para Opção Quanto.</p>
Valor Base/Quantidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Quantidade de mercadorias com 14 inteiros e 8 casas decimais.</p>
Limite	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Limite de alta (caso a opção seja Compra) ou de baixa (caso seja Venda) para o exercício, a ser utilizado em lugar do preço à vista, se for o caso.</p> <p>Preço da Mercadoria até 14 casas inteiras e 8 casas decimais. Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda.</p> <p>Pode ser informado para contrato com Barreira.</p>
Tipo de Exercício	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção:</p> <p>Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício. Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática</p> <p>Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de vencimento.</p>
Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Modalidade de Contrato. Caixa de seleção com as opções: Knock In, Knock Out e Knock In-Out. Pode ser informado para contrato com Limite.</p>
Trigger In	<p>Campo de preenchimento obrigatório se contrato se indicada opção "Knock In" ou "Knock In-Out" no campo "Barreiras".</p> <p>Preço da mercadoria ou percentual (trigger proporcional) indicado para determinar a efetivação do contrato, quando este for atingido.</p>
Trigger Out	<p>Campo de preenchimento obrigatório se contrato se indicada opção "Knock Out" ou "Knock In-Out" no campo "Barreiras".</p> <p>Preço da mercadoria ou percentual (trigger proporcional) indicado para determinar a rescisão do contrato, quando este for atingido.</p>

Campo	Descrição
Trigger - Proporção	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Quando marcado indica que o Trigger In e/ou Trigger Out é na forma de percentual do Preço de Exercício.</p> <p>A indicação de Trigger Proporcional é que o registro do valor da barreira é feito de forma percentual ao preço de exercício, mantendo assim a proporcionalidade no contrato. Para maiores informações, consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Tipo de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: ALTA e BAIXA</p> <p>Consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Forma de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: CONTINUO e DISCRETO</p> <p>Forma de Disparo Discreto: Opções de Ações, Índices, Índices Internacionais, Mercadorias e Paridade.</p> <p>Forma de Disparo Contínuo: Opções de Ações, Índice Ibovespa, Índices Internacionais SISBACEN e Mercadorias.</p> <p>Consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Forma de Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: diária ou final.</p> <p>Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.</p>
Rebate	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos Trigger In e/ou Trigger Out.</p> <p>Caixa de seleção com as opções:</p> <p>Registro (o valor do rebate deve ser informado no registro do contrato, no campo Valor do Rebate e é gerado pela modalidade bilateral na data de sua liquidação);</p> <p>Liquidação (o valor do rebate pode ser definido até a data da ocasião da liquidação do contrato por meio da função Informação de Valor de Rebate e é gerado pela modalidade bilateral ou bruta);</p> <p>Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).</p> <p>Determina a ocasião de definição do valor do rebate de prêmio do contrato com prerrogativa de barreiras Knock In e/ou Knock Out.</p>
Rebate Unitário	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate.</p> <p>(Define o valor unitário do Rebate em Reais ao titular do contrato, caso não ocorra o disparo do parâmetro do trigger In), ou caso ocorra o disparo do parâmetro do trigger (Trigger Out), até a data de vencimento do contrato. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro. Formato: Com até 10 inteiros e 8 casas decimais.</p>

Campo	Descrição
Liquidação do Rebate	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Vencimento e Trigger Out.</p> <p>Vencimento é válida para contratos com Trigger In e/ou Trigger Out, a liquidação do rebate deve ser no vencimento do contrato.</p> <p>Opção Trigger Out é válida para contratos com Trigger Out ou Trigger In-Out, a liquidação ocorre no disparo do Trigger Out.</p> <p>Define a ocasião da liquidação financeira do rebate.</p>
Liquidante	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante.</p> <p>Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda.</p>
Modalidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Modalidade de Liquidação Financeira do Prêmio. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.</p> <p>Observação: este campo se refere exclusivamente à modalidade de liquidação do prêmio e não interfere na modalidade de liquidação da comissão de intermediação, se houver.</p>
Adesão ao Contrato	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se o contrato que está sendo registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.</p>
Meu Número	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número interno de identificação do lançamento. Com até 10 dígitos</p>
Intermediador	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se um dos campos de comissão for preenchido.</p> <p>Código Cetip da conta de intermediação do Participante <i>intermediador</i> na operação de opção. Tipo de conta: 69</p> <p>Modalidade de liquidação da comissão: a liquidação será gerada na grade que estiver aberta no momento de registro do contrato. Ou seja, na janela Bilateral ou Bruta (nas operações com o mercado) ou na janela Sem Modalidade (nas operações com cliente).</p>
Comissão paga pelo Titular em R\$	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Titular ao Intermediador</i>.</p> <p>Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros</p>
Comissão paga pelo Lançador em R\$	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Lançador ao Intermediador</i>.</p> <p>Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros</p>

Campo	Descrição
Média para opção Asiática	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Branco (quando opção não for Asiática), Aritmética simples ou Aritmética ponderada.</p> <p>Ao escolher uma das opções Asiáticas é apresentada a tela para informação das datas de verificação e do Valor de referência (quando média asiática ponderada).</p> <p>Quando opção Aritmética ponderada, a soma dos valores de referência informados na Tela de Registro das datas de verificação deve ser igual ao Valor Base.</p> <p>Nos contratos com média asiática, não é possível a indicação de Barreiras e tipo de exercício Americana.</p>
Datas de Verificação	<p>Campo Obrigatório quando opção for Média Asiática.</p> <p>Clique no botão Informar Datas. É exibida tela para indicar as datas de referência para cálculo da média.</p> <p>As datas devem ser dias úteis (considerando calendário nacional). A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de verificação informada aplicando-se o deslocamento* indicado no campo “Cotação para o Vencimento”.</p> <p>Devem ser indicadas, pelo menos, duas datas de verificação e no máximo 70. A última data deve coincidir com o vencimento do contrato.</p> <p>* mais informações sobre o deslocamento, consultar a seção “Opção de Mercadoria – Datas de <i>Fixing</i>”.</p>
Cotação para o Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando as fontes de informação forem FEEDER ou SPOT.</p> <p>Cotação para o Vencimento da Mercadoria. Determina a data da cotação da mercadoria objeto da opção.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.. O deslocamento informado nesse campo também valerá para as datas informadas no campo “Datas de Verificação”.</p>
Cotação para Moeda	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.</p>
Observação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo de livre preenchimento - 200 (duzentos) caracteres.</p>

Observação:

1. As cotações de Mercadoria são capturadas automaticamente pelo Módulo.
2. Quando a data da liquidação do prêmio não for preenchida no registro do contrato de mercadoria, é assumida a data de início do contrato para o pagamento do prêmio.

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

Parte	Contraparte	Permitido?
Conta própria	Conta própria mercado	Sim
Conta própria	Conta cliente 1 próprio	Sim
Conta própria	Conta cliente 2 próprio	Sim
Conta própria	Conta cliente 2 mercado	Sim
Conta própria	Conta cliente 1 mercado	Não
Conta cliente 1	Conta cliente 1 mercado	Não
Conta cliente 1	Conta cliente 1 próprio	Sim
Conta cliente 2	Conta cliente 2 próprio	Não
Conta cliente 2	Conta cliente 2 mercado	Sim

Confirmação de Registro de Mercadoria

Confirmação de Registro de Opção - OFCC RIO M148541			
Titular 05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	Lançador 05000.10-8 BCO RIO S/A	Tipo de Exercício EUROPEIA	
CPF / CNPJ do Titular	CPF / CNPJ do Lançador 98765432100	Cesta de Garantia - Lançador NÃO	
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)	
Data de Início 21/11/2014	Data de Vencimento 22/12/2014	Prazo em Dias Úteis 21	
Moeda Base / Ações / Índice / Produto ALUMINIO (A VISTA)	Moeda Cotada / Moeda para Negociação DOLAR DOS EUA	Mercadoria MAL0	
Valor Base / Quantidade 100.000,00000000	Valor Remanescente 100.000,00000000		
Barreira	Trigger In	Trigger Out	
Trigger - Proporção Não	Forma de Disparo	Tipo de Disparo	
Forma de Verificação	Adesão a Contrato SEM ADESAO	Cross-Rate na Avaliação Não	
Rebate	Rebate Unitário	Liquidação do Rebate	
Opção de Compra			
Prêmio Unitário 1.000,00000000	Preço de Exercício 100.000,00000000	Limite	
Data de Liquidação do Prêmio 21/11/2014	Preço de Exercício em Reais Não	Opção Quanto Não	Cotação para Opção Quanto
Liquidação Financeira			
Liquidante 70180.00-8 TESTE - BANCO BRACCE S/A	Modalidade de Liquidação SEM MODALIDADE	Meu Número 6541	
Dados Adicionais			
Fonte de Informação COMMODITIES	Cotação para o Vencimento D-1	Cotação para Moeda da Mercadoria D-1	Boletim
Fonte de Captura	Fonte de Consulta LME	Outra Fonte de Consulta	Tela ou Função de Consulta
Praça de Negociação	Horário de Consulta	Ação / Ação Internacional / Índice Internacional	
Ajuste de Proventos pelas Partes	Proteção contra Provento em Dinheiro		
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Data de Avaliação	Média para Opção Asiática
Observação			

Nesta tela, além dos campos digitados na Tela de Registro de Opção, são mostradas as seguintes informações:

Campo	Descrição
Prazo em dias úteis	Quantidade de dias úteis entre a Data de Início e a Data de Vencimento do Contrato.
Valor Remanescente	No registro do contrato, este valor é igual ao Valor Base/Quantidade.
Fonte de Informação	COMMODITIES

Em caso de confirmação, é enviada mensagem com o número do registro.

3.3 Registro Opção de Ações Nacionais

Registro de Opção - OFCC RIO M143214	
Parte:	05000 . 00 - 5 TITULAR
CPF / CNPJ (Parte):	
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO
Contraparte:	05000 . 10 - 8
CPF / CNPJ (Contraparte):	98765432100
Moeda Base / Ações / Índice:	AÇÕES NACIONAIS
Moeda Cotada:	REAL
Data Início:	21 / 11 / 2014
Data Vencimento:	22 / 12 / 2014
Preço Exercício:	100000 , 00
Prêmio Unitário:	1000 ,
Data de Liquidação do Prêmio:	21 / 11 / 2014
Valor Base / Quantidade:	10 ,
Limite:	,
Tipo de Exercício:	EUROPÉIA
Barreiras:	SELECIONE:
Liquidante:	70180 . 00 - 8
Modalidade:	SEM MODALIDADE
Adesão a Contrato:	SEM ADESAO
Meu Número:	3214
Intermediador:	, -
Comissão paga pelo Titular em R\$:	,
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	,
Cross-Rate na Avaliação?:	<input type="checkbox"/>
Média para Opção Asiática:	SELECIONE:

(continua)

<p>Datas de Verificação:</p>	<div style="border: 1px solid gray; padding: 5px;"> <div style="display: flex; justify-content: space-between; align-items: center;"> < > </div> </div>
	<input type="button" value="Informar Datas"/>
Cotação para o Vencimento:	D-1 <input type="button" value="v"/>
Ação:	BBAS3 <input type="button" value="v"/>
Ajuste de Proventos pelas Partes:	NÃO <input type="button" value="v"/>
Proteção contra Provento em Dinheiro:	NÃO <input type="button" value="v"/>
Observação :	<div style="border: 1px solid gray; padding: 5px;"> <div style="display: flex; justify-content: space-between; align-items: center;"> < > </div> </div>

(fim)

Descrição dos campos da Tela de Registro para Ações Nacionais

Campo	Descrição
Parte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip do participante (Própria 00, 70 a 89 ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato e Caixa de Seleção para identificar o participante no registro (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>).</p>
CPF / CNPJ (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Parte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC.</p> <p>CPF ou CNPJ da Parte. Há necessidade de <i>matching</i> das informações.</p>
Cesta de Garantias - Lançador	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Não (default) ou Sim. Deve ser selecionada a opção Não</p> <p>Funcionalidade descontinuada pelo Módulo de Gestão de Colateral.</p>
Contraparte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip da contraparte (Própria 00, 70 a 89 ou Cliente 1 e 2) envolvido na operação (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>).</p>
CPF / CNPJ (Contraparte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Contraparte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC.</p> <p>CPF ou CNPJ da Contraparte. Há necessidade de <i>matching</i> das informações.</p>

Campo	Descrição
Moeda Base/Ações/Índice	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a classe do ativo-subjacente. Opção única: Ações Nacionais.</p> <p>De acordo com o tipo de opção e a fonte de informação a ser utilizado para a consulta de cotação, o Módulo apresenta campos diferentes a serem preenchidos na Tela de Registro. O capítulo Informações Adicionais exibe as possíveis combinações.</p>
Moeda Cotada	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a moeda de referência em que a Ação é cotada. . Opção única: Real.</p>
Data Início	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data de seu registro no Módulo. Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Nos contratos que envolvam clientes 10, pode ser anterior a Data de Registro em até d-2, inclusive.</p>
Data de Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data do exercício da opção Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Formato: DD/MM/AAAA</p>
Preço de Exercício	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor da taxa de câmbio ou preço da Ação/Índice contratado entre <i>Titular</i> e <i>Lançador</i> para o exercício da opção.</p> <p>Preencher com até 6 (seis) casas decimais para moeda US\$ (Dólar dos Estados Unidos), com até 8 (oito) casas decimais para demais moedas e com até 2 (duas) casas decimais para ações ou índices, caso contrário, o Módulo preenche com zeros.</p>
Prêmio Unitário	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Preço unitário, em Reais, pago pelo <i>Titular</i> ao <i>Lançador</i>, na data de registro. Até 8 casas decimais</p>
Data de Liquidação do Prêmio	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>É permitido para operações com cliente e mercado.</p> <p>Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada o Módulo usa a data de registro para data de liquidação do prêmio</p> <p>Se data informada, o Módulo utiliza a data indicada para liquidação prêmio.</p> <p>A data deve ser dia útil e menor que a data do vencimento quando o registro de opção for Ações Nacionais, Índices, Índices Internacionais ou Mercadorias.</p> <p>A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento quando o registro de opção for Paridade.</p> <p>Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da Cetip.</p>
Valor Base/ Quantidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Quantidade de ações, permitido até 8 casas decimais.</p>

Campo	Descrição
Limite	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Limite de alta (caso a opção seja Compra) ou de baixa (caso seja Venda) para o exercício, a ser utilizado em lugar do preço à vista, se for o caso.</p> <p>Taxa Câmbio R\$/Moeda. Caso US\$, até 6 decimais; demais moedas até 8 decimais. Preço de Ações/Índice até 2 decimais.</p> <p>Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda.</p> <p>Pode ser informado para contrato com Barreira.</p>
Tipo de Exercício	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção</p> <p>Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício.</p> <p>Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de exercício.</p> <p>Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática</p>
Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Modalidade de Contrato. Caixa de seleção com as opções: <i>Knock In</i>, <i>Knock Out</i> e <i>Knock In-Out</i>.</p>
Trigger In	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Cotação ou ação/índice indicado para determinar a efetivação do contrato, quando este for atingido. Informar quando tipo de Barreira for igual à <i>Knock In</i> ou <i>Knock In-Out</i>.</p>
Trigger Out	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Cotação ou ação/índice indicado para determinar a rescisão do contrato, quando este for atingido. Informar quando tipo de Barreira for igual à <i>Knock Out</i> ou <i>Knock In-Out</i>.</p>
Trigger - Proporção	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Quando marcado indica que o Trigger In e/ou Trigger Out é na forma de percentual do Preço de Exercício.</p> <p>A indicação de Trigger Proporcional é que o registro do valor da barreira é feito de forma percentual ao preço de exercício, mantendo assim a proporcionalidade no contrato. Para maiores informações, consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Tipo de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: ALTA e BAIXA</p> <p>Consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>

Campo	Descrição
Forma de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i> forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: CONTINUO e DISCRETO</p> <p><u>Forma de Disparo Discreto:</u> Opções de Ações, Índices, Índices Internacionais, Mercadorias e Paridade.</p> <p><u>Forma de Disparo Contínuo:</u> Opções de Ações, Índice Ibovespa, Índices Internacionais SISBACEN e Mercadorias.</p> <p>Consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Forma de Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i> forem preenchidos.</p> <p>Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger. Caixa de seleção com as opções: diária ou final</p>
Rebate	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>.</p> <p>Determina a ocasião de definição do valor do rebate de prêmio do contrato com prerrogativa de barreiras <i>Knock In</i> e/ou <i>Knock Out</i>.</p> <p>Caixa de seleção com as opções:</p> <p>Registro (o valor do rebate deve ser informado no registro do contrato, no campo Valor do Rebate e é gerado pela modalidade bilateral na data de sua liquidação);</p> <p>Liquidação (o valor do rebate pode ser definido até a data da ocasião da liquidação do contrato por meio da função Informação de Valor de Rebate e é gerado pela modalidade bilateral ou bruta);</p> <p>Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).</p>
Rebate Unitário	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate.</p> <p>Define o valor unitário da devolução do prêmio ao titular do contrato, caso não ocorra o disparo do parâmetro do trigger (<i>Knock In</i>), ou ocorra o disparo do parâmetro do trigger (<i>Knock Out</i>), até a data de vencimento do contrato. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro. Formato: Com 10 inteiros e 8 casas decimais.</p>
Liquidação do Rebate	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Liquidação, no campo Rebate.</p> <p>Define a ocasião da liquidação financeira do rebate.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Vencimento e <i>Trigger Out</i>.</p> <p>Vencimento é válida para contratos com <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>, a liquidação do rebate deve ser no vencimento do contrato.</p> <p>Opção Trigger Out é válida para contratos com <i>Trigger Out</i> ou <i>Trigger In-Out</i>, a liquidação ocorre no disparo do <i>Trigger Out</i>.</p>
Liquidante	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda. Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante.</p>

Campo	Descrição
Modalidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.</p> <p>Forma de liquidação financeira do valor correspondente ao prêmio e ao valor da comissão a ser paga pela intermediação.</p>
Adesão do Contrato	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.</p>
Meu Número	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número interno de identificação do lançamento. Com até 8 dígitos</p>
Intermediador	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se um dos campos de comissão for preenchido.</p> <p>Código Cetip da conta de intermediação do Participante <i>intermediador</i> na operação de opção. Tipo de conta: 69</p>
Comissão paga pelo <i>Titular</i> em R\$	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Titular</i> ao <i>Intermediador</i>. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros</p>
Comissão paga pelo <i>Lançador</i> em R\$	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Lançador</i> ao <i>Intermediador</i>. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros</p>
Cross Rate Avaliação	<p>na Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Exclusivo para opção de paridade.</p> <p>É a taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.</p> <p>O uso desta opção não é permitido, quando Moeda Base ou Moeda Cotada for Dólar dos EUA, Ação, Índice ou quando a Fonte de Informação for Sisbacen ou Spot.</p>
Média para Asiática	<p>opção Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Branco (quando opção não for asiática), Aritmética simples ou Aritmética ponderada.</p> <p>Ao escolher uma das opções Asiáticas é apresentada a tela para informação das datas de verificação e do Valor de referência (quando média asiática ponderada).</p> <p>Quando opção Aritmética ponderada, a soma dos valores de referência informados na Tela de Registro das datas de verificação deve ser igual ao Valor Base.</p> <p>Nos contratos com média asiática, não é possível a indicação de Barreiras e tipo de exercício Americana.</p>

Campo	Descrição
Datas de Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando opção for Média Asiática.</p> <p>Clique no botão Informar Datas. É exibida tela para indicar as datas de referência para avaliação e posterior apuração do valor financeiro da opção.</p> <p>Indica as datas de referência para avaliação e posterior apuração do valor financeiro da opção. Devem ser indicadas, pelo menos, duas datas de verificação e no máximo 70. A última deve coincidir com o vencimento do contrato.</p> <p>A menor data informada neste campo deve ser igual à Data de Avaliação, quando opção Média Asiática e Fonte de Informação Feeder, Spot ou Sisbacen/Feeder. Nas datas agendadas o participante pode efetuar a avaliação do contrato na respectiva função.</p>
Cotação para o Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Cotação para o Vencimento da Mercadoria. Determina a data da cotação da mercadoria objeto da opção. Caixa de seleção: D-1; D-2; D-3; D-4; D-5.</p>
Ação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o ativo-subjacente da opção. Caixa de seleção com os códigos das ações disponíveis.</p> <p>As ações disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCAO.</p> <p>Se a ação selecionada estiver em condição de Ex-proventos - Bonificação (EX B), Dividendos (EX D) e/ou Subscrição (EX S), a tela é atualizada exibindo ao lado da Ação selecionada o(s) tipo(s) de provento(s). Os valores de referência do contrato deverão ser registrados com base no preço EX Proventos.</p>
Ajuste de Proventos pelas partes	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando objeto da opção flexível for Ação.</p> <p>Deve ser selecionada a opção Não.</p>
Proteção contra Provento em Dinheiro	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando objeto da opção flexível for Ação.</p> <p>Caixa de seleção com as opções Sim ou Não</p> <p>SIM: Na ocorrência de todos os tipos de proventos, Bonificação, Dividendos e/ou Subscrição da ação objeto, os contratos têm seus valores de referência alterados automaticamente pelo Módulo, refletindo sua situação em proventos; ou.</p> <p>NÃO: Na ocorrência de proventos dos tipos Dividendos e/ou Subscrição, da ação objeto, os contratos não têm seus valores de referência alterados automaticamente pelo Módulo.</p> <p>Consulte Capítulo – Informações Adicionais – Tratamento de Proventos.</p>
Observações	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo de livre preenchimento - 200 (duzentos) caracteres.</p>

Observação:

1. As cotações relativas às opções de Ações são capturadas automaticamente pelo Módulo.

2. Codificação de Ações:

a) O preço de fechamento da ação é idêntico ao código divulgado em Bolsa, por exemplo:

Código divulgado em Bolsa - PETR3

Código da cotação de fechamento no Módulo de Opções Flexíveis - PETR3

b) O preço médio da ação é o código negociado em Bolsa acrescido da letra "M" ao final, por exemplo:

Código divulgado em Bolsa - PETR3

Código da cotação média no Módulo de Opções Flexíveis - PETR3M.

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

Parte	Contraparte	Permitido?
Conta própria	Conta própria mercado	Sim
Conta própria	Conta cliente 1 próprio	Sim
Conta própria	Conta cliente 2 próprio	Sim
Conta própria	Conta cliente 2 mercado	Sim
Conta própria	Conta cliente 1 mercado	Não
Conta cliente 1	Conta cliente 1 mercado	Não
Conta cliente 1	Conta cliente 1 próprio	Sim
Conta cliente 2	Conta cliente 2 próprio	Não
Conta cliente 2	Conta cliente 2 mercado	Sim

3.4 Registro Opção de Paridade

Registro de Opção - OFCC RIO M141456	
Parte:	05000 . 00 - 5 TITULAR ▼
CPF / CNPJ (Parte):	
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO ▼
Contraparte:	05000 . 10 - 8
CPF / CNPJ (Contraparte):	98765432100
Moeda Base / Ações / Índice:	DOLAR DOS EUA ▼
Moeda Cotada:	EURO/COM.EUROPEIA ▼
Data Início:	21 / 11 / 2014
Data Vencimento:	22 / 12 / 2014
Preço Exercício:	100000 , 000000
Prêmio Unitário:	1000 ,
Data de Liquidação do Prêmio:	21 / 11 / 2014
Valor Base / Quantidade:	123 ,
Limite:	,
Tipo de Exercício:	EUROPÉIA ▼
Barreiras:	SELECIONE: ▼
Liquidante:	70180 . 00 - 8
Modalidade:	SEM MODALIDADE ▼
Adesão a Contrato:	SEM ADESAO ▼
Meu Número:	1456
Intermediador:	.
Comissão paga pelo Titular em R\$:	,
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	,
Cross-Rate na Avaliação?:	<input checked="" type="checkbox"/>
Média para Opção Asiática:	SELECIONE: ▼

(continua)

Datas de Verificação:	<div style="border: 1px solid gray; height: 100px; width: 100%;"></div> <div style="text-align: center; margin-top: 5px;"><input type="button" value="Informar Datas"/></div>
Fonte de Informação:	SISBACEN/FEEDER <input type="button" value="v"/>
Cotação para o Vencimento:	D-1 <input type="button" value="v"/>
Boletim:	PTAX800 <input type="button" value="v"/> 18:00 - FECHAMENTO <input type="button" value="v"/>
Fonte de Consulta:	BLOOMBERG <input type="button" value="v"/>
Outra Fonte de Consulta:	<input type="text"/>
Tela ou Função de Consulta:	111111 <input type="text"/>
Praça de Negociação:	555555 <input type="text"/>
Horário de Consulta:	11:50 <input type="text"/>
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD:	VENDA <input type="button" value="v"/>
Operacionalidade (Moeda/USD ou USD/Moeda):	COMPRA <input type="button" value="v"/>
Data de Avaliação:	19 / 12 / 2014 <input type="text"/>
Observação :	<div style="border: 1px solid gray; height: 100px; width: 100%;"></div>

(fim)

Descrição dos campos da Tela de Registro Opção de Paridade

Campo	Descrição
Parte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip do participante (Própria 00, 70 a 89 ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato e Caixa de Seleção para identificar o participante no registro (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>).</p>
CPF / CNPJ (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Parte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC.</p> <p>CPF ou CNPJ da Parte. Há necessidade de <i>matching</i> das informações.</p>
Cesta de Garantias - Lançador	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Não (default) ou Sim. Deve ser selecionada a opção Não</p> <p>Funcionalidade descontinuada pelo Módulo de Gestão de Colateral.</p>
Contraparte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip da contraparte (Própria 00, 70 a 89 ou Cliente 1 e 2) envolvido na operação (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>).</p>
CPF / CNPJ (Contraparte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Contraparte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC.</p> <p>CPF ou CNPJ da Contraparte. Há necessidade de <i>matching</i> das informações.</p>
Moeda Base/Ações/Índice	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>É o ativo-subjacente da opção. Caixa de seleção com a lista de moedas.</p> <p>As moedas disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCAO.</p> <p>De acordo com o tipo de opção e a fonte de informação a ser utilizado para a consulta de cotação, o Módulo apresenta campos diferentes a serem preenchidos na Tela de Registro. O capítulo Informações Adicionais exibe as possíveis combinações.</p>
Moeda Cotada	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a moeda de referência em que a Moeda Base é cotada.</p> <p>Caixa de seleção com a lista de moedas.</p> <p>As moedas disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCAO.</p> <p>A Moeda Cotada não pode ser igual à Moeda Base.</p>
Data Início	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data de seu registro no Módulo. Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Nos contratos que envolvam clientes 10, pode ser anterior a Data de Registro em até d-2, inclusive.</p>

Campo	Descrição
Data de Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data do exercício da opção. Formato: DD/MM/AAAA Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil.</p>
Preço de Exercício	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor da taxa de câmbio ou preço da Ação/Índice contratado entre <i>Titular</i> e <i>Lançador</i> para o exercício da opção.</p> <p>Preencher com até 6 (seis) casas decimais para moeda US\$ (Dólar dos Estados Unidos), com até 8 (oito) casas decimais para demais moedas e com até 2 (duas) casas decimais para ações ou índices, caso contrário, o Módulo preenche com zeros.</p> <p>A precisão da paridade se dá de acordo com a Moeda Base.</p>
Prêmio Unitário	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Preço unitário, em Reais, pago pelo <i>Titular</i> ao <i>Lançador</i>, na data de registro. Até 8 casas decimais</p>
Data de Liquidação do Prêmio	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>É permitido para operações com cliente e mercado.</p> <p>Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada o Módulo usa a data de registro para data de liquidação do prêmio</p> <p>Se data informada, o Módulo utiliza a data indicada para liquidação prêmio.</p> <p>A data deve ser dia útil e menor que a data do vencimento quando o registro de opção for Ações Nacionais, Índices, Índices Internacionais ou Mercadorias.</p> <p>A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento quando o registro de opção for Paridade.</p> <p>Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da Cetip.</p>
Valor Base/ Quantidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor Base em moeda estrangeira, com 14 casas inteiras e 8 casas decimais.</p>
Limite	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Limite de alta (caso a opção seja Compra) ou de baixa (caso seja Venda) para o exercício, a ser utilizado em lugar do preço à vista, se for o caso.</p> <p>Taxa Câmbio R\$/Moeda. Caso US\$, até 6 decimais; demais moedas até 8 decimais. Preço de Ações/Índice até 2 decimais.</p> <p>Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda.</p> <p>Pode ser informado para contrato com Barreira.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Exercício	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção</p> <p>Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício.</p> <p>Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de exercício.</p> <p>Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática</p>
Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Modalidade de Contrato. Caixa de seleção com as opções: <i>Knock In</i>, <i>Knock Out</i> e <i>Knock In-Out</i>.</p>
Trigger In	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Cotação ou ação/índice indicado para determinar a efetivação do contrato, quando este for atingido. Informar quando tipo de Barreira for igual à <i>Knock In</i> ou <i>Knock In-Out</i>.</p>
Trigger Out	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Cotação ou ação/índice indicado para determinar a rescisão do contrato, quando este for atingido. Informar quando tipo de Barreira for igual à <i>Knock Out</i> ou <i>Knock In-Out</i>.</p>
Trigger - Proporção	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Quando marcado indica que o Trigger In e/ou Trigger Out é na forma de percentual do Preço de Exercício.</p> <p>A indicação de Trigger Proporcional é que o registro do valor da barreira é feito de forma percentual ao preço de exercício, mantendo assim a proporcionalidade no contrato. Para maiores informações, consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Tipo de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: ALTA e BAIXA</p> <p>Consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Forma de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: CONTINUO e DISCRETO</p> <p><u>Forma de Disparo Discreto:</u> Opções de Ações, Índices, Índices Internacionais, Mercadorias e Paridade.</p> <p><u>Forma de Disparo Contínuo:</u> Opções de Ações, Índice Ibovespa, Índices Internacionais SISBACEN e Mercadorias.</p> <p>Consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>

Campo	Descrição
Forma de Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i> forem preenchidos</p> <p>Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: diária ou final</p>
Rebate	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>.</p> <p>Determina a ocasião de definição do valor do rebate de prêmio do contrato com prerrogativa de barreiras <i>Knock In</i> e/ou <i>Knock Out</i>.</p> <p>Caixa de seleção com as opções:</p> <p>Registro (o valor do rebate deve ser informado no registro do contrato, no campo Valor do Rebate e é gerado pela modalidade bilateral na data de sua liquidação);</p> <p>Liquidação (o valor do rebate pode ser definido até a data da ocasião da liquidação do contrato por meio da função Informação de Valor de Rebate e é gerado pela modalidade bilateral ou bruta);</p> <p>Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).</p>
Rebate Unitário	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate.</p> <p>Define o valor unitário da devolução do prêmio ao titular do contrato, caso não ocorra o disparo do parâmetro do trigger (<i>Knock In</i>), ou ocorra o disparo do parâmetro do trigger (<i>Knock Out</i>), até a data de vencimento do contrato. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro.</p> <p>Formato: Com 10 inteiros e 8 casas decimais.</p>
Liquidação do Rebate	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Liquidação, no campo Rebate.</p> <p>Define a ocasião da liquidação financeira do rebate. Caixa de seleção com as opções: Vencimento e <i>Trigger Out</i>.</p> <p>Vencimento é válida para contratos com <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>, a liquidação do rebate deve ser no vencimento do contrato.</p> <p>Opção Trigger Out é válida para contratos com <i>Trigger Out</i> ou <i>Trigger In-Out</i>, a liquidação ocorre no disparo do <i>Trigger Out</i>.</p>
Liquidante	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda.</p> <p>Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante.</p>
Modalidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.</p> <p>Forma de liquidação financeira do valor correspondente ao prêmio e ao valor da comissão a ser paga pela intermediação.</p>

Campo	Descrição
Adesão do Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número interno de identificação do lançamento. Com até 8 dígitos
Intermediador	Campo de preenchimento obrigatório se um dos campos de comissão for preenchido. Código Cetip da conta de intermediação do Participante <i>intermediador</i> na operação de opção. Tipo de conta: 69
Comissão paga pelo Titular em R\$	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Titular</i> ao <i>Intermediador</i> . Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros
Comissão paga pelo Lançador em R\$	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Lançador</i> ao <i>Intermediador</i> . Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros
Cross Rate na Avaliação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Exclusivo para opção de paridade. É a taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda. O uso desta opção não é permitido, quando Moeda Base ou Moeda Cotada for Dólar dos EUA, Ação, Índice ou quando a Fonte de Informação for Sisbacen ou Spot.
Média para opção Asiática	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa de seleção com as opções: Branco (quando opção não for asiática), Aritmética simples ou Aritmética ponderada. Ao escolher uma das opções Asiáticas é apresentada a tela para informação das datas de verificação e do Valor de referência (quando média asiática ponderada). Quando opção Aritmética ponderada, a soma dos valores de referência informados na Tela de Registro das datas de verificação deve ser igual ao Valor Base. Nos contratos com média asiática, não é possível a indicação de Barreiras e tipo de exercício Americana.
Data da Verificação	Campo de preenchimento obrigatório somente quando o contrato tiver opção Asiática. O campo indica qual data da verificação está sendo avaliada.

Observação: As cotações relativas ao Sisbacen são capturadas automaticamente pelo Módulo.

Registro Opção de Paridade - Feeder ou Spot (tela)

Fonte de Informação:	FEEDER
Cotação para o Vencimento:	SELECIONE:
Fonte de Consulta:	SELECIONE:
Outra Fonte de Consulta:	
Tela ou Função de Consulta:	
Praça de Negociação:	
Horário de Consulta:	
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD:	SELECIONE:
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda):	SELECIONE:
Data de Avaliação:	/ /
Observação:	

(Fim)

Descrição dos campos Feeder ou Spot

Campo	Descrição
Fonte de informação	Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder e Spot.
Cotação para o Vencimento	Para a fonte de informação Feeder ou Spot são apresentadas as opções: D0, D-1 e D-2.
Fonte de Consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório, Caixa de seleção. Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda ou ação de referência.</p> <p>Quando Fonte de Informação Feeder é exibida as opções: Reuters, Bloomberg, Broadcast e Outros.</p> <p>Quando Fonte de Informação Spot é exibida a opção: Spot.</p>
Outra fonte de consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo livre para descrição de outra fonte de consulta, caso o item Outros tenha sido escolhido na caixa de seleção Fonte de Consulta.</p>
Tela ou função de consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo livre. Nome da função de consulta ou código da tela, que será utilizada pelos participantes para cotação.</p>
Praça de negociação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo livre. Local de negociação da moeda se Opção sobre taxa de câmbio e fonte de informação Feeder, Sisbacen/Feeder ou Spot.</p>
Horário de consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo livre. Horário de verificação da taxa de câmbio. Não pode ser informado quando indicador financeiro forem Ações.</p>

Campo	Descrição
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informação do tipo de cotação para a taxa de câmbio, a ser informada na tela de avaliação.</p> <p>Para Fonte de Informação Feeder compra, venda média ou nenhuma.</p> <p>Para Fonte de Informação Spot: compra, venda ou média.</p> <p>Se indicador financeiro for Ação, deve ser selecionada a opção nenhuma.</p>
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informação da paridade a ser utilizada na tela de avaliação.</p> <p>Para Fonte de Informação Feeder: compra, venda média ou nenhuma.</p> <p>Se indicador financeiro for Ação, deve ser selecionada a opção nenhuma.</p> <p>Para Fonte de Informação Spot: nenhuma.</p>
Data de avaliação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data pactuada entre as partes para avaliação do contrato mediante informação da paridade ou Cotação. Deve ser maior que a Data de Início e até D-1 da Data de Vencimento e quando opção asiática deve coincidir com a primeira data de verificação.</p>
Observação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver,</p> <p>Com até 280 caracteres. Complemento da descrição do contrato.</p>

Registro Opção de Paridade - Sisbacen/Feeder

Fonte de Informação:	SISBACEN/FEEDER	
Cotação para o Vencimento:	SELECIONE:	
Boletim:	PTAX800	SELECIONE:
Fonte de Consulta:	OUTROS	
Outra Fonte de Consulta:		
Tela ou Função de Consulta:		
Praça de Negociação:		
Horário de Consulta:		
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD:	SELECIONE:	
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda):	SELECIONE:	
Data de Avaliação:	/ /	
Observação:		

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para a confirmação dos dados preenchidos na tela de Registro de Opção.

Descrição dos campos Sisbacen/Feeder

Campo	Descrição
Cotação para o vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Cotação para o Vencimento da Mercadoria. Determina a data da cotação da mercadoria objeto da opção. Caixa de seleção com as opções: D-1 e D-2
Boletim	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com a opção PTAX800 e horário do boletim (18h00minh-Fechamento). Boletins intermediários e de fechamento de cotação de venda da moeda.
Fonte de Consulta	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as seguintes opções: Reuters, Bloomberg, Broadcast, Spot e Outros. Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda.
Outra fonte de consulta	Campo de preenchimento obrigatório. Campo livre para descrição de outra fonte de consulta, caso o item Outros tenha sido escolhido na caixa de seleção Fonte de Consulta.

Campo	Descrição
Tela ou função de consulta	Campo de preenchimento obrigatório. Campo livre. Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que será utilizada pelos participantes para cotação.
Praça de negociação	Campo de preenchimento obrigatório. Campo livre. Local de negociação da moeda se Opção sobre taxa de câmbio e fonte de informação Feeder, Sisbacen/Feeder ou Spot.
Horário de consulta	Campo de preenchimento obrigatório. Campo livre. Horário de verificação da taxa de câmbio.
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção Informação do tipo de cotação para a taxa de câmbio, a ser informada na tela de avaliação: venda .
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Campo de preenchimento obrigatório. Informação da paridade a ser utilizada na tela de avaliação: compra, venda ou média .
Data de avaliação	Campo de preenchimento obrigatório. Data pactuada entre as partes para avaliação do contrato mediante informação da taxa de câmbio e paridade. Deve ser maior que a Data de Início e até D-1 da Data de Vencimento e quando opção asiática deve coincidir com a primeira data de verificação.
Observação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Com até 280 caracteres. Complemento da descrição do contrato.

Confirmação de Registro de Opção Paridade

Confirmação de Registro de Opção - OFCC RIO M141454			
Titular 05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A CPF / CNPJ do Titular	Lançador 05000.10-8 BCO RIO S/A CPF / CNPJ do Lançador 98765432100	Tipo de Exercício EUROPÉIA Cesta de Garantia - Lançador NÃO	
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)	
Data de Início 21/11/2014	Data de Vencimento 22/12/2014	Prazo em Dias Úteis 21	
Moeda Base / Ações / Índice / Produto DOLAR DOS EUA	Moeda Cotada / Moeda para Negociação EURO/COM.EUROPEIA	Mercadoria	
Valor Base / Quantidade 10,00000000	Valor Remanescente 10,00000000		
Barreira	Trigger In	Trigger Out	
Trigger - Proporção Não	Forma de Disparo	Tipo de Disparo	
Forma de Verificação	Adesão a Contrato SEM ADESAO	Cross-Rate na Avaliação Sim	
Rebate	Rebate Unitário	Liquidação do Rebate	
Opção de Compra			
Prêmio Unitário 1.000,00000000	Preço de Exercício 100.000,00000000	Limite	
Data de Liquidação do Prêmio 21/11/2014	Preço de Exercício em Reais Sim	Opção Quanto Não	Cotação para Opção Quanto
Liquidação Financeira			
Liquidante 70180.00-8 TESTE - BANCO BRACCE S/A	Modalidade de Liquidação SEM MODALIDADE	Meu Número 1454	
Dados Adicionais			
Fonte de Informação SISBACEN/FEEDER	Cotação para o Vencimento D-1	Cotação para Moeda da Mercadoria	Boletim PTAX800 18:00 - FECHAMENTO
Fonte de Captura	Fonte de Consulta REUTERS	Outra Fonte de Consulta	Tela ou Função de Consulta 11111
Praça de Negociação 55555	Horário de Consulta 11:55	Ação / Ação Internacional / Índice Internacional	
Ajuste de Proventos pelas Partes	Proteção contra Provento em Dinheiro		
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD VENDA	Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda) COMPRA	Data de Avaliação 19/12/2014	Média para Opção Asiática
Observação			

Confirmar

Desistir

Corrigir

Nesta tela, além dos campos digitados na Tela de Registro de Opção, são mostradas as seguintes informações:

Campo	Descrição
Prazo em dias úteis	Quantidade de dias úteis entre a Data de Início e a Data de Vencimento do Contrato.
Valor Remanescente	No registro do contrato, este valor é igual ao Valor Base/Quantidade.
Fonte de Informação	Se campo Moeda Base/Ações/Índice for Taxa de Câmbio – SISBACEN, FEEDER, SPOT ou SISBACEN/FEEDER.
Fonte de Consulta	Se campo Moeda Base/Ações/Índice for Taxa de Câmbio – REUTERS, BLOOMBERG, BROADCAST ou OUTROS.

Em caso de confirmação, é enviada mensagem com o número do registro.

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

Parte	Contraparte	Permitido?
Conta própria	Conta própria mercado	Sim

Parte	Contraparte	Permitido?
Conta própria	Conta cliente 1 próprio	Sim
Conta própria	Conta cliente 2 próprio	Sim
Conta própria	Conta cliente 2 mercado	Sim
Conta própria	Conta cliente 1 mercado	Não
Conta cliente 1	Conta cliente 1 mercado	Não
Conta cliente 1	Conta cliente 1 próprio	Sim
Conta cliente 2	Conta cliente 2 próprio	Não
Conta cliente 2	Conta cliente 2 mercado	Sim

3.5 Registro Opção de Índice

Registro de Opção - OFCC RIO M172366	
Parte:	05000 . 00 - 5 TITULAR
CPF / CNPJ (Parte):	
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO
Contraparte:	05000 . 10 - 8
CPF / CNPJ (Contraparte):	98765432100
Moeda Base / Ações / Índice:	INDICE DI
Moeda Cotada:	REAL
Data Início:	04 / 09 / 2017
Data Vencimento:	04 / 09 / 2018
Preço Exercício:	1000
Prêmio Unitário:	10
Data de Liquidação do Prêmio:	04 / 09 / 2017
Valor Base / Quantidade:	10
Limite:	
Tipo de Exercício:	EUROPÉIA
Barreiras:	KNOCK IN
Trigger In:	
Trigger - Proporção:	<input type="checkbox"/>
Tipo de Disparo:	SELECIONE:
Forma de Disparo:	SELECIONE:
Forma de Verificação:	SELECIONE:
Rebate:	SELECIONE:
Rebate Unitário:	
Liquidação do Rebate:	SELECIONE:
Liquidante:	
Modalidade:	SELECIONE:
Adesão a Contrato:	SELECIONE:
Meu Número:	
Intermediador:	
Comissão paga pelo Titular em R\$:	
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	
Cross-Rate na Avaliação?:	<input type="checkbox"/>
Média para Opção Asiática:	SELECIONE:
Datas de Verificação:	<div style="border: 1px solid gray; height: 100px; width: 100%;"></div> <input type="button" value="Informar Datas"/>
Cotação para o Vencimento:	SELECIONE:
Fonte de Consulta:	B3
Observação:	<div style="border: 1px solid gray; height: 100px; width: 100%;"></div>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/>	

Descrição dos campos da Tela de Registro Opção de Índice

Campo	Descrição
Parte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip do participante (Própria 00, 70 a 89 ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato e Caixa de Seleção para identificar o participante no registro (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>).</p>

CPF / CNPJ (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Parte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC.</p> <p>CPF ou CNPJ da Parte. Há necessidade de <i>matching</i> das informações.</p>
Cesta de Garantias - Lançador	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Não (default) ou Sim. Deve ser selecionada a opção Não</p> <p>Funcionalidade descontinuada pelo Módulo de Gestão de Colateral.</p>
Contraparte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip da contraparte (Própria 00, 70 a 89 ou Cliente 1 e 2) envolvido na operação (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>).</p>
CPF / CNPJ (Contraparte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Contraparte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC.</p> <p>CPF ou CNPJ da Contraparte. Há necessidade de <i>matching</i> das informações</p>
Moeda Base/Ações/Índice	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>É o ativo-subjacente da opção. Caixa de seleção com a lista de índices.</p> <p>Os Índices disponíveis podem ser consultados no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCAO.</p> <p>De acordo com o tipo de opção e a fonte de informação a ser utilizado para a consulta de cotação, o Módulo apresenta campos diferentes a serem preenchidos na Tela de Registro. O capítulo Informações Adicionais exibe as possíveis combinações.</p>
Moeda Cotada	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Opção única: Real.</p>
Data Início	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data de seu registro no Módulo. Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Nos contratos que envolvam clientes 10, pode ser anterior a Data de Registro em até d-2, inclusive.</p>
Data de Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data do exercício da opção Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Formato: DD/MM/AAAA</p>
Preço de Exercício	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor da taxa de câmbio ou preço da Ação/Índice contratado entre <i>Titular</i> e <i>Lançador</i> para o exercício da opção.</p> <p>Preencher com até 6 (seis) casas decimais para moeda US\$ (Dólar dos Estados Unidos), com até 8 (oito) casas decimais para demais moedas e com até 2 (duas) casas decimais para ações ou índices, caso contrário, o Módulo preenche com zeros.</p>
Prêmio Unitário	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Preço unitário, em Reais, pago pelo <i>Titular</i> ao <i>Lançador</i>, na data de registro. Até 8 casas decimais</p>

Data de Liquidação do Prêmio	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>É permitido para operações com cliente e mercado.</p> <p>Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada o Módulo usa a data de registro para data de liquidação do prêmio</p> <p>Se data informada, o Módulo utiliza a data indicada para liquidação prêmio.</p> <p>A data deve ser dia útil e menor que a data do vencimento quando o registro de opção for Ações Nacionais, Índices, Índices Internacionais ou Mercadorias.</p> <p>A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento quando o registro de opção for Paridade.</p> <p>Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da Cetip.</p>
Valor Base/ Quantidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Quantidade de contratos de índice, permitido até 8 casas decimais.</p>
Limite	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Limite de alta (caso a opção seja Compra) ou de baixa (caso seja Venda) para o exercício, a ser utilizado em lugar do preço à vista, se for o caso.</p> <p>Taxa Câmbio R\$/Moeda. Caso US\$, até 6 decimais; demais moedas até 8 decimais. Preço de Ações/Índice até 2 decimais.</p> <p>Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda.</p> <p>Pode ser informado para contrato com Barreira.</p>
Tipo de Exercício	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção</p> <p>Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício.</p> <p>Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de exercício.</p> <p>Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática</p>
Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Modalidade de Contrato. Caixa de seleção com as opções: <i>Knock In, Knock Out e Knock In-Out.</i></p>
Trigger In	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Cotação ou ação/índice indicado para determinar a efetivação do contrato, quando este for atingido. Informar quando tipo de Barreira for igual à <i>Knock In</i> ou <i>Knock In-Out.</i></p>
Trigger Out	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Cotação ou ação/índice indicado para determinar a rescisão do contrato, quando este for atingido. Informar quando tipo de Barreira for igual à <i>Knock Out</i> ou <i>Knock In-Out.</i></p>

Trigger - Proporção	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Quando marcado indica que o Trigger In e/ou Trigger Out é na forma de percentual do Preço de Exercício.</p> <p>A indicação de Trigger Proporcional é que o registro do valor da barreira é feito de forma percentual ao preço de exercício, mantendo assim a proporcionalidade no contrato. Para maiores informações, consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Tipo de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: ALTA e BAIXA</p> <p>Consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Forma de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: CONTINUO e DISCRETO</p> <p><u>Forma de Disparo Discreto:</u> Opções de Ações, Índices, Índices Internacionais, Mercadorias e Paridade.</p> <p><u>Forma de Disparo Contínuo:</u> Opções de Ações, Índice Ibovespa, Índices Internacionais SISBACEN e Mercadorias.</p> <p>Consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Forma de Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i> forem preenchidos</p> <p>Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: diária ou final</p>
Rebate	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>.</p> <p>Determina a ocasião de definição do valor do rebate de prêmio do contrato com prerrogativa de barreiras <i>Knock In</i> e/ou <i>Knock Out</i>.</p> <p>Caixa de seleção com as opções:</p> <p>Registro (o valor do rebate deve ser informado no registro do contrato, no campo Valor do Rebate e é gerado pela modalidade bilateral na data de sua liquidação);</p> <p>Liquidação (o valor do rebate pode ser definido até a data da ocasião da liquidação do contrato por meio da função Informação de Valor de Rebate e é gerado pela modalidade bilateral ou bruta);</p> <p>Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).</p>
Rebate Unitário	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate.</p> <p>Define o valor unitário da devolução do prêmio ao titular do contrato, caso não ocorra o disparo do parâmetro do trigger (Knock In), ou ocorra o disparo do parâmetro do trigger (Knock Out), até a data de vencimento do contrato. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro. Formato: Com 10 inteiros e 8 casas decimais.</p>

Liquidação do Rebate	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Liquidação, no campo Rebate.</p> <p>Define a ocasião da liquidação financeira do rebate.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Vencimento e <i>Trigger Out</i>.</p> <p>Vencimento é válida para contratos com <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>, a liquidação do rebate deve ser no vencimento do contrato.</p> <p>Opção Trigger Out é válida para contratos com <i>Trigger Out</i> ou <i>Trigger In-Out</i>, a liquidação ocorre no disparo do <i>Trigger Out</i>.</p>
Liquidante	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda.</p> <p>Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante.</p>
Modalidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral. Forma de liquidação financeira do valor correspondente ao prêmio e ao valor da comissão a ser paga pela intermediação.</p>
Adesão do Contrato	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.</p>
Meu Número	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número interno de identificação do lançamento. Com até 8 dígitos</p>
Intermediador	<p>Campo de preenchimento obrigatório se um dos campos de comissão for preenchido.</p> <p>Código Cetip da conta de intermediação do Participante <i>intermediador</i> na operação de opção. Tipo de conta: 69</p>
Comissão paga pelo <i>Titular</i> em R\$	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Titular</i> ao <i>Intermediador</i>. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros</p>
Comissão paga pelo <i>Lançador</i> em R\$	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Lançador</i> ao <i>Intermediador</i>. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros</p>
Cross Rate na Avaliação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Exclusivo para opção de paridade. É a taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.</p> <p>O uso desta opção não é permitido, quando Moeda Base ou Moeda Cotada for Dólar dos EUA, Ação, Índice ou quando a Fonte de Informação for Sisbacen ou Spot.</p>

Média para opção Asiática	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Branco (quando opção não for asiática), Aritmética simples ou Aritmética ponderada.</p> <p>Ao escolher uma das opções Asiáticas é apresentada a tela para informação das datas de verificação e do Valor de referência (quando média asiática ponderada).</p> <p>Quando opção Aritmética ponderada, a soma dos valores de referência informados na Tela de Registro das datas de verificação deve ser igual ao Valor Base.</p> <p>Nos contratos com média asiática, não é possível a indicação de Barreiras e tipo de exercício Americana.</p>
Data da Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando o contrato tiver opção Asiática.</p> <p>O campo indica qual data da verificação está sendo avaliada.</p>
Cotação para o Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Cotação para o Vencimento da Mercadoria. Determina a data da cotação da mercadoria objeto da opção.</p> <p>Caixa de seleção: D0, D-1, D-2, D-3.</p>
Fonte de Consulta	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Caixa combo-box com as opções: B3 e CETIP.</p>
Observações	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Com até 280 caracteres. Complemento da descrição do contrato.</p>

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

Parte	Contraparte	Permitido?
Conta própria	Conta própria mercado	Sim
Conta própria	Conta cliente 1 próprio	Sim
Conta própria	Conta cliente 2 próprio	Sim
Conta própria	Conta cliente 2 mercado	Sim
Conta própria	Conta cliente 1 mercado	Não
Conta cliente 1	Conta cliente 1 mercado	Não
Conta cliente 1	Conta cliente 1 próprio	Sim
Conta cliente 2	Conta cliente 2 próprio	Não
Conta cliente 2	Conta cliente 2 mercado	Sim

3.6 Registro Opção de Índices Internacionais

Registro de Opção - OFCC RIO M145599	
Parte:	05000 . 00 - 5 TITULAR
CPF / CNPJ (Parte):	
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO
Contraparte:	05000 . 10 - 8
CPF / CNPJ (Contraparte):	98765432100
Moeda Base / Ações / Índice:	ÍNDICES INTERNACIONAIS
Data Início:	21 / 11 / 2014
Data Vencimento:	22 / 12 / 2014
Preço Exercício:	100000 ,
Prêmio Unitário:	1000 ,
Data de Liquidação do Prêmio:	21 / 11 / 2014
Valor Base / Quantidade:	10 ,
Limite:	,
Tipo de Exercício:	EUROPÉIA
Barreiras:	SELECIONE:
Liquidante:	70180 . 00 - 8
Modalidade:	SEM MODALIDADE
Adesão a Contrato:	SEM ADESAO
Meu Número:	5599
Intermediador:	. -
Comissão paga pelo Titular em R\$:	,
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	,
Cross-Rate na Avaliação?:	<input type="checkbox"/>
Média para Opção Asiática:	SELECIONE:

(continua)

Datas de Verificação:	<div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div> <div style="text-align: center; margin-top: 5px;"> <input type="button" value="Informar Datas"/> </div>	
Fonte de Informação:	INDICES INTERNACIONAIS [SISBACEN] ▼	
Cotação para o Vencimento:	D-1 ▼	
Boletim:	PTAX800 ▼	18:00 - FECHAMENTO ▼
Índice Internacional:	INI001 ▼	
Observação:	<div style="border: 1px solid black; height: 80px; width: 100%;"></div>	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/>		

(fim)

Descrição dos campos da Tela de Registro Opção de Índices Internacionais

Campo	Descrição
Parte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip do participante (Própria 00, 70 a 89 ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato e Caixa de Seleção para identificar o participante no registro (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>).</p>
CPF / CNPJ (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Parte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC</p> <p>CPF ou CNPJ da Parte. Há necessidade de <i>matching</i> das informações.</p>
Cesta de Garantias - Lançador	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Não (default) ou Sim. Deve ser selecionada a opção Não</p> <p>Funcionalidade descontinuada pelo Módulo de Gestão de Colateral.</p>
Contraparte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip da contraparte (Própria 00, 70 a 89 ou Cliente 1 e 2) envolvido na operação (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>).</p>
CPF / CNPJ (Contraparte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Contraparte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC</p> <p>CPF ou CNPJ da Contraparte. Há necessidade de <i>matching</i> das informações.</p>

Campo	Descrição
Moeda Base/Ações/Índice	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>É o ativo-subjacente da opção. Caixa de seleção com a lista dos Índices Internacionais.</p> <p>Os Índices Internacionais disponíveis podem ser consultados no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCAO.</p> <p>De acordo com o tipo de opção e a fonte de informação a ser utilizado para a consulta de cotação, o Módulo apresenta campos diferentes a serem preenchidos na Tela de Registro. O capítulo Informações Adicionais exibe as possíveis combinações.</p>
Data Início	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data de seu registro no Módulo. Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Nos contratos que envolvam clientes 10, pode ser anterior a Data de Registro em até d-2, inclusive.</p>
Data de Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data do exercício da opção Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Formato: DD/MM/AAAA</p>
Preço de Exercício	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor da taxa de câmbio ou preço da Ação/Índice contratado entre <i>Titular</i> e <i>Lançador</i> para o exercício da opção.</p> <p>Preencher com até 6 (seis) casas decimais para moeda US\$ (Dólar dos Estados Unidos), com até 8 (oito) casas decimais para demais moedas e com até 2 (duas) casas decimais para ações ou índices, caso contrário, o Módulo preenche com zeros.</p>
Prêmio Unitário	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Preço unitário, em Reais, pago pelo <i>Titular</i> ao <i>Lançador</i>, na data de registro. Até 8 casas decimais</p>
Data de Liquidação do Prêmio	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>É permitido para operações com cliente e mercado.</p> <p>Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada o Módulo usa a data de registro para data de liquidação do prêmio</p> <p>Se data informada, o Módulo utiliza a data indicada para liquidação prêmio.</p> <p>A data deve ser dia útil e menor que a data do vencimento quando o registro de opção for Ações Nacionais, Índices, Índices Internacionais ou Mercadorias.</p> <p>A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento quando o registro de opção for Paridade.</p> <p>Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da Cetip.</p>
Valor Base/ Quantidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Quantidade de contratos de índice, sem casas decimais.</p>

Campo	Descrição
Limite	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Limite de alta (caso a opção seja Compra) ou de baixa (caso seja Venda) para o exercício, a ser utilizado em lugar do preço à vista, se for o caso.</p> <p>Taxa Câmbio R\$/Moeda. Caso US\$, até 6 decimais; demais moedas até 8 decimais. Preço de Ações/Índice até 2 decimais.</p> <p>Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda.</p> <p>Pode ser informado para contrato com Barreira.</p>
Tipo de Exercício	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção</p> <p>Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício.</p> <p>Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de exercício.</p> <p>Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática</p>
Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Modalidade de Contrato. Caixa de seleção com as opções: <i>Knock In</i>, <i>Knock Out</i> e <i>Knock In-Out</i>.</p>
Trigger In	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Cotação ou ação/índice indicado para determinar a efetivação do contrato, quando este for atingido. Informar quando tipo de Barreira for igual à <i>Knock In</i> ou <i>Knock In-Out</i>.</p>
Trigger Out	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Cotação ou ação/índice indicado para determinar a rescisão do contrato, quando este for atingido. Informar quando tipo de Barreira for igual à <i>Knock Out</i> ou <i>Knock In-Out</i>.</p>
Trigger - Proporção	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Quando marcado indica que o Trigger In e/ou Trigger Out é na forma de percentual do Preço de Exercício.</p> <p>A indicação de Trigger Proporcional é que o registro do valor da barreira é feito de forma percentual ao preço de exercício, mantendo assim a proporcionalidade no contrato. Para maiores informações, consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Tipo de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: ALTA e BAIXA</p> <p>Consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>

Campo	Descrição
Forma de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i> forem preenchidos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: CONTINUO e DISCRETO</p> <p><u>Forma de Disparo Discreto:</u> Opções de Ações, Índices, Índices Internacionais, Mercadorias e Paridade.</p> <p><u>Forma de Disparo Contínuo:</u> Opções de Ações, Índice Ibovespa, Índices Internacionais SISBACEN e Mercadorias</p> <p>Consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.</p>
Forma de Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i> forem preenchidos</p> <p>Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger. Caixa de seleção com as opções: diária ou final</p>
Rebate	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>.</p> <p>Determina a ocasião de definição do valor do rebate de prêmio do contrato com prerrogativa de barreiras <i>Knock In</i> e/ou <i>Knock Out</i>.</p> <p>Caixa de seleção com as opções:</p> <p>Registro (o valor do rebate deve ser informado no registro do contrato, no campo Valor do Rebate e é gerado pela modalidade bilateral na data de sua liquidação);</p> <p>Liquidação (o valor do rebate pode ser definido até a data da ocasião da liquidação do contrato por meio da função Informação de Valor de Rebate e é gerado pela modalidade bilateral ou bruta);</p> <p>Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).</p>
Rebate Unitário	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate.</p> <p>Define o valor unitário da devolução do prêmio ao titular do contrato, caso não ocorra o disparo do parâmetro do trigger (<i>Knock In</i>), ou ocorra o disparo do parâmetro do trigger (<i>Knock Out</i>), até a data de vencimento do contrato. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro.</p> <p>Formato: Com 10 inteiros e 8 casas decimais.</p>
Liquidação do Rebate	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Liquidação, no campo Rebate.</p> <p>Define a ocasião da liquidação financeira do rebate.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Vencimento e <i>Trigger Out</i>.</p> <p>Vencimento é válida para contratos com <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>, a liquidação do rebate deve ser no vencimento do contrato.</p> <p>Opção Trigger Out é válida para contratos com <i>Trigger Out</i> ou <i>Trigger In-Out</i>, a liquidação ocorre no disparo do <i>Trigger Out</i>.</p>

Campo	Descrição
Liquidante	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda. Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante.</p>
Modalidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.</p> <p>Forma de liquidação financeira do valor correspondente ao prêmio e ao valor da comissão a ser paga pela intermediação.</p>
Adesão do Contrato	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.</p>
Meu Número	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número interno de identificação do lançamento. Com até 8 dígitos</p>
<i>Intermediador</i>	<p>Campo de preenchimento obrigatório se um dos campos de comissão for preenchido.</p> <p>Código Cetip da conta de intermediação do Participante <i>intermediador</i> na operação de opção. Tipo de conta: 69</p>
Comissão paga pelo <i>Titular</i> em R\$	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Titular</i> ao <i>Intermediador</i>. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros</p>
Comissão paga pelo <i>Lançador</i> em R\$	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Lançador</i> ao <i>Intermediador</i>. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros</p>
Cross Rate Avaliação	<p>na Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Exclusivo para opção de paridade.</p> <p>É a taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.</p> <p>O uso desta opção não é permitido, quando Moeda Base ou Moeda Cotada for Dólar dos EUA, Ação, Índice ou quando a Fonte de Informação for Sisbacen ou Spot.</p>

Campo	Descrição
Média para opção Asiática	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Branco (quando opção não for Asiática), Aritmética simples ou Aritmética ponderada.</p> <p>Ao escolher uma das opções Asiáticas é apresentada a tela para informação das datas de verificação e do Valor de referência (quando média asiática ponderada).</p> <p>Quando opção Aritmética ponderada, a soma dos valores de referência informados na Tela de Registro das datas de verificação deve ser igual ao Valor Base.</p> <p>Nos contratos com média asiática, não é possível a indicação de Barreiras e tipo de exercício Americana.</p>
Data da Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando o contrato tiver opção Asiática.</p> <p>O campo indica qual data da verificação está sendo avaliada.</p>

Observação: As cotações relativas ao Sisbacen são capturadas automaticamente pelo Módulo.

Registro Opção de Índices Internacionais – Fonte de Informação: Índices Internacionais (SISBACEN)

Fonte de Informação:	INDICES INTERNACIONAIS [SISBACEN] ▼		
Cotação para o Vencimento:	D-1 ▼		
Boletim:	PTAX800 ▼	18:00 - FECHAMENTO ▼	
Índice Internacional:	INI001 ▼		
Observação :	<div style="border: 1px solid gray; height: 80px; width: 100%;"></div>		
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/>			

Descrição dos campos Índices Internacionais (SISBACEN)

Campo	Descrição
Fonte de Informação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção: Índices Internacionais SISBACEN ou Índices Internacionais FEEDER.</p> <p>Para a opção "Índices Internacionais SISBACEN", a cotação do índice e a cotação da moeda em que o índice é expresso serão capturadas automaticamente pelo sistema.</p> <p>Para a opção "Índices Internacionais FEEDER", a cotação do índice será capturada automaticamente pelo sistema, e somente a cotação da moeda poderá ser informada na data de avaliação.</p>
Cotação para o Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Determina a data da cotação do índice internacional objeto da opção, e a mesma data será utilizada como data de cotação da moeda do índice.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: D-1 e D-2.</p>
Boletim	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com a opção PTAX800 e horário do boletim (18h00minh-Fechamento). Boletins intermediários e de fechamento de cotação de venda da moeda.</p>
Índice Internacional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>É o objeto da opção flexível. Caixa de seleção com a lista dos tipos de Índices.</p>
Observação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Com até 280 caracteres. Complemento da descrição do contrato.</p>

Descrição dos campos Índices Internacionais (FEEDER)

Campo	Descrição
Fonte de Informação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção: Índices Internacionais SISBACEN ou Índices Internacionais FEEDER.</p> <p>Para a opção "Índices Internacionais SISBACEN", a cotação do índice e a cotação da moeda em que o índice é expresso serão capturadas automaticamente pelo sistema.</p> <p>Para a opção "Índices Internacionais FEEDER", a cotação do índice será capturada automaticamente pelo sistema, e somente a cotação da moeda poderá ser informada na data de avaliação.</p>
Fonte de Consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as seguintes opções: Reuters, Bloomberg, Broadcast, Spot e Outros.</p> <p>Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda.</p>

Campo	Descrição
Outra Fonte de Consulta	Campo de preenchimento obrigatório. Campo livre para descrição de outra fonte de consulta, caso o item Outros tenha sido escolhido na caixa de seleção Fonte de Consulta.
Tela ou Função de Consulta	Campo de preenchimento obrigatório. Campo livre. Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que será utilizada pelos participantes para cotação.
Praça de Negociação	Campo de preenchimento obrigatório. Campo livre. Local de negociação da moeda em que o índice internacional é cotado.
Horário de Consulta	Campo de preenchimento obrigatório. Campo livre. Horário de verificação da taxa de câmbio.
Da Índice Internacional	Campo de preenchimento obrigatório. É o objeto da opção flexível. Caixa de seleção com a lista dos tipos de Índices.
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção Informação do tipo de cotação para a taxa de câmbio, a ser informada na tela de avaliação: venda.
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Campo de preenchimento obrigatório. Informação da paridade a ser utilizada na tela de avaliação: compra, venda ou média.
Data de avaliação	Campo de preenchimento obrigatório. Data pactuada entre as partes para avaliação do contrato mediante informação da taxa de câmbio e paridade. Obs: a cotação do índice internacional é capturada automaticamente pelo sistema. Deve ser maior que a Data de Início e até D-1 da Data de Vencimento e quando opção asiática deve coincidir com a primeira data de verificação.
Observação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Com até 280 caracteres. Complemento da descrição do contrato.

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

Parte	Contraparte	Permitido?
Conta própria	Conta própria mercado	Sim
Conta própria	Conta cliente 1 próprio	Sim
Conta própria	Conta cliente 2 próprio	Sim
Conta própria	Conta cliente 2 mercado	Sim

Parte	Contraparte	Permitido?
Conta própria	Conta cliente 1 mercado	Não
Conta cliente 1	Conta cliente 1 mercado	Não
Conta cliente 1	Conta cliente 1 próprio	Sim
Conta cliente 2	Conta cliente 2 próprio	Não
Conta cliente 2	Conta cliente 2 mercado	Sim

3.7 Alteração

(Menu Lançamentos)

Visão Geral

Para alterar um contrato, o participante deve acessar a função Registro/Emissão de contrato e solicitar a ação **Alteração**.

Deve ser selecionado, na tela de filtro, o Tipo de Instrumento Financeiro (BOX2, OFCC ou OFVC), a ação **Alteração** e informar o código que os participantes atribuíram ao instrumento financeiro.

Os contratos antecipados, avaliados ou cedidos não são passíveis de alteração.

Caso o contrato tenha Média Asiática e os campos, Data de Verificação e Valor de Referência sejam alterados, o participante deve redefinir os campos Valor Base/Quantidade, Data de Vencimento e Preço de Exercício.

É permitida alteração nos contratos, nas seguintes condições:

Agente alteração	Tipo da Operação	D0	D1	D2	D3	Dn
Mercado	Mercado x Mercado	Não	Não	Não	Não	Não
	Mercado x Cliente 1 ou 2 próprio	Não	Possível	Possível	Possível	Não
	Mercado x Cliente 2 de outros	Não	Não	Não	Não	Não

Observação: Os contratos de Opções de Mercadorias poderão ser alterados quantas vezes forem necessárias por dia, respeitando as regras acima mencionadas.

Tela de Filtro

Registro/Emissão			
Instrumento Financeiro			Ação
Tipo	Código	Tipo Indicador	
OFCC ▼	RIO M146541	MERCADORIAS ▼	CORREÇÃO ▼

Após clicar no botão **Avançar** é apresentada a tela com os dados de registro para alteração.

Efetuada as alterações cabíveis, é exibida a tela para confirmação da alteração.

O contrato pode ser alterado mais de uma vez no mesmo dia desde que a alteração anterior esteja confirmada ou cancelada.

Tela de Alteração de Mercadoria

Alteração de Contrato de Opção - OFCC RIO M146541	
Titular:	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A
Novo Titular:	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>
CPF / CNPJ do Titular:	<input type="text"/>
Lançador:	05000.10-8 BCO RIO S/A
Novo Lançador:	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>
CPF / CNPJ do Lançador:	98765432100
Novo Tipo IF:	SELECIONE: <input type="text"/>
Novo Código IF:	<input type="text"/>
Cesta Garantia - Lançador:	NÃO
Mercadoria:	MAL0
Data Registro:	21 / 11 / 2014
Data Início:	21 / 11 / 2014
Data Vencimento:	22 / 12 / 2014
Preço Exercício:	100000 , 0
Preço de Exercício em Reais:	<input type="checkbox"/>
Prêmio Unitário:	1000 , 0
Data de Liquidação do Prêmio:	21 / 11 / 2014
Opção Quanto:	<input type="checkbox"/>
Cotação para Opção Quanto:	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Valor Base / Quantidade:	100000 , 0
Valor Base / Quantidade Antecipado(a):	0 , 0
Limite:	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Tipo de Exercício:	EUROPÉIA <input type="text"/>
Barreiras:	SELECIONE: <input type="text"/>
Adesão a Contrato:	SEM ADESAO <input type="text"/>
Intermediador:	
Comissão paga pelo Titular em R\$:	
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	

Média para Opção Asiática:	SELECIONE: <input type="button" value="v"/>
Datas de Verificação:	<div style="border: 1px solid gray; height: 80px; width: 100%;"></div> <input type="button" value="Informar Datas"/>
Cotação para o Vencimento:	D-1 <input type="button" value="v"/>
Observação:	<div style="border: 1px solid gray; height: 50px; width: 100%;"></div>
Valor Base / Quantidade Remanescente no Início IOF:	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Existem Operações nesse contrato entre as Datas de Início e de Correção:	NÃO <input type="button" value="v"/>
Data da Cessão:	<input type="text"/> / <input type="text"/> / <input type="text"/>
Valor Base / Quantidade na Data da Cessão:	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Datas de Antecipação:	<div style="border: 1px solid gray; height: 80px; width: 100%;"></div> <input type="button" value="Informar Datas"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Voltar"/>	

Campos que NÃO podem ser alterados**Campos**

Parte/Titular

CPF/CNPJ Titular

Contraparte/Lançador

CPF/CNPJ Lançador

Cesta de Garantias Lançador

Barreiras

(Se trigger disparado)

Trigger In

(Se trigger disparado)

Trigger Out

(Se trigger disparado)

Trigger- Proporção

(Se trigger disparado)

Tipo de Disparo

(Se trigger disparado)

Campos

Forma de Disparo

(Se trigger disparado)

Intermediador

Comissão paga pelo Titular

Comissão paga pelo Lançador

3.8 Exclusão

(Menu Lançamentos)

Visão Geral

Para excluir um contrato, o participante deve acessar a função Registro/Emissão de contrato e solicitar a ação **Exclusão**.

Deve ser selecionado, na tela de filtro, o Tipo de Instrumento Financeiro (BOX2, OFCC ou OFCV), a ação **Exclusão** e informar o código que os participantes atribuíram ao instrumento financeiro.

Os contratos antecipados, avaliados ou cedidos não são passíveis de exclusão.

É permitida exclusão de contratos, nas seguintes condições:

Agente alteração	Tipo da Operação	D0	D1	D2	D3	Dn
Mercado	Mercado x Mercado	Possível	Não	Não	Não	Não
	Mercado x Cliente 1 ou 2 próprio	Possível	Possível	Possível	Possível	Não
	Mercado x Cliente 2 de outros	Possível	Possível	Possível	Possível	Não

Tela Filtro

Registro/Emissão			
Instrumento Financeiro			Ação
Tipo	Código	Tipo Indicador	
BOX2 ▾	RIO M149876	PARIDADE ▾	EXCLUSÃO ▾
Avançar		Limpar Campos	

Após clicar no botão **Avançar** é apresentada a tela com os dados de registro para exclusão.

Tela de Exclusão de Mercadoria

Confirmação de Exclusão de Contrato de Estratégia - BOX2 RIO M149876		
Titular 05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	Lançador 05000.10-8 BCO RIO S/A	Tipo de Exercício EUROPEIA
CPF / CNPJ do Titular	CPF / CNPJ do Lançador 98765432100	Adesão a Contrato SEM ADESAO
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)
Data de Início 18/11/2014	Data de Vencimento 18/11/2015	Prazo em Dias Úteis 250
Valor da Aplicação (R\$) 499.999,95	Valor do Resgate (R\$) 573.219,00	Taxa da Aplicação (%) 14,7692
Valor Base em Moeda Estrangeira 1.273.820,00	Valor Remanescente 1.273.820,00	Moeda DOLAR DOS EUA
Opção de Compra		
Prêmio Unitário de Call 0,19040100000000	Preço de Exercício de Call 2,03000000000000	Limite de Alta 2,48000000
Opção de Venda		
Prêmio Unitário de Put 0,20211910000000	Preço de Exercício de Put 2,48000000000000	Limite de Baixa 2,03000000

3.9 Antecipação de Contrato

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Antecipação de Contrato

Visão Geral

É possível a partir do primeiro dia útil subsequente ao seu registro no Módulo e até o dia útil anterior (D-1) ao vencimento da opção.

Nos contratos que envolvam clientes é permitido o lançamento somente se o contrato tiver sido previamente identificado.

Esta função permite aos participantes realizar a antecipação parcial ou total de contrato.

A antecipação total permite o encerramento do contrato antes da data de vencimento enquanto a antecipação parcial reduz o seu valor base/quantidade.

O valor da antecipação deve ser apurado com base no indicador econômico e nas demais condições pactuadas no contrato, refletindo as condições de mercado na ocasião de seu lançamento.

O lançamento de antecipação não deve ser realizado com o objetivo de cancelamento do contrato, em função de identificação de registro incorreto, nem ser combinado com o registro de um novo contrato para refletir qualquer alteração das condições originalmente pactuadas. Nestes casos, o participante deve remeter a documentação comprobatória para a avaliação da área operacional da Cetip.

Ressaltamos que a utilização da função de antecipação com a finalidade de realizar alteração e/ou cancelamento de contrato poderá caracterizar a inadimplência regulamentar do participante, sujeitando-o às penalidades previstas no regulamento da Cetip.

Antecipação de Opções / Estratégias										
Participante			Instrumento Financeiro			Contraparte				
			Código							
05000	.	00	-	5	RIO M149876	05000	.	10	-	8
			Avançar			Limpar Campos				

Observações:

- 1) A antecipação de contrato de opção flexível de ação deve ter seu Prêmio Unitário da Antecipação baseado no preço negociado em D-1 da data da antecipação.
- 2) A operação de antecipação pode ser estornada, através da função de Cancelamento de Operações neste módulo.

Após clicar no botão **Avançar**, é exibida Tela de Inclusão dos Detalhes para Antecipação de Opção.

Tela de Inclusão dos Detalhes para Antecipação

Antecipação de Contrato de Estratégia - BOX2 RIO M149876		
Quantidade a antecipar:	1.000,00000000	
Prêmio Unitário da Antecipação - R\$:	100,00000000	
Meu Número:	9876	
Liquidante:	70180 . 00 - 8	
Modalidade:	SEM MODALIDADE	
Dados do Contrato		
Titular 05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	Lançador 05000.10-8 BCO RIO S/A	Tipo de Exercício EUROPEIA
CPF / CNPJ do Titular 999.999.999-99	CPF / CNPJ do Lançador 999.999.999-99	Adesão a Contrato SEM ADESAO
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)
Data de Início 18/11/2014	Data de Vencimento 18/11/2015	Prazo em Dias Úteis 250
Valor da Aplicação (R\$) 499.999,95	Valor do Resgate (R\$) 573.219,00	Taxa da Aplicação (%) 14,7692
Valor Base em Moeda Estrangeira 1.273.820,00	Valor Remanescente 1.273.820,00	Moeda DOLAR DOS EUA
Opção de Compra		
Prêmio Unitário de Call 0,19040100000000	Preço de Exercício de Call 2,03000000000000	Limite de Alta 2,48000000
Opção de Venda		
Prêmio Unitário de Put 0,20211910000000	Preço de Exercício de Put 2,48000000000000	Limite de Baixa 2,03000000
Enviar Limpar Campos Voltar		

Confirmação de Antecipação de Contrato de Estratégia - BOX2 RIO M149876		
Quantidade a antecipar 1.000,00000000	Prêmio Unitário da Antecipação - R\$ 100,00000000	Meu Número 9876
Liquidante 70180.00-8 TESTE - BANCO BRACCE S/A	Modalidade SEM MODALIDADE	Valor Financeiro a Antecipar - R\$ 100.000,00
Dados do Contrato		
Titular 05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	Lançador 05000.10-8 BCO RIO S/A	Tipo de Exercício EUROPEIA
CPF / CNPJ do Titular	CPF / CNPJ do Lançador 987.654.321-00	Adesão a Contrato SEM ADESAO
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)
Data de Início 18/11/2014	Data de Vencimento 18/11/2015	Prazo em Dias Úteis 250
Valor da Aplicação (R\$) 499.999,95	Valor do Resgate (R\$) 573.219,00	Taxa da Aplicação (%) 14,7692
Valor Base em Moeda Estrangeira 1.273.820,00	Valor Remanescente 1.273.820,00	Moeda DOLAR DOS EUA
Opção de Compra		
Prêmio Unitário de Call 0,19040100000000	Preço de Exercício de Call 2,03000000000000	Limite de Alta 2,48000000
Opção de Venda		
Prêmio Unitário de Put 0,20211910000000	Preço de Exercício de Put 2,48000000000000	Limite de Baixa 2,03000000

Antecipação realizada. Operação de Antecipação No. 2014112117189902.

Antecipação de Opções / Estratégias		
Participante	Instrumento Financeiro	Contraparte
	Código	
<input type="text"/> - <input type="text"/> - <input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/> - <input type="text"/> - <input type="text"/>

O **Valor a Antecipar** deve ser menor ou igual à quantidade remanescente do contrato.

Após clicar no botão **Enviar** da tela de inclusão de detalhes, é exibida tela para confirmação dos dados preenchidos, acrescida do campo **Valor Financeiro a Antecipar**. Em caso de confirmação, é enviada mensagem com o número da operação de antecipação e direciona para liquidação financeira, quando for o caso.

Descrição dos campos da tela de inclusão de detalhes

Campo	Descrição
Prêmio unitário da antecipação em R\$	Campo de preenchimento obrigatório. Prêmio unitário da antecipação. É creditado ao <i>Titular</i> e debitado do <i>Lançador</i> . Preencher com até 8 (oito) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros.
Data Original da Operação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Deve ser dia útil, anterior a Data Atual em até D-2 e que envolva Cliente 1.
Novo Valor de Rebate	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Exclusivo para antecipação de Opção de Mercadoria Define o novo valor unitário do rebate do contrato, caso não ocorra o disparo do parâmetro do trigger (Knock In), ou ocorra o disparo do parâmetro do trigger (Knock Out), até a data de vencimento do contrato. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro.

Campo	Descrição
Meu número	Campo de preenchimento obrigatório. Número de identificação do lançamento. Não é necessário que o <i>Titular</i> e o <i>Lançador</i> informem o mesmo número. Com até 10 dígitos.
Liquidante	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Banco que deve liquidar o prêmio da antecipação. Se não for preenchido, a aplicação informa automaticamente o nome do banco liquidante principal.
Modalidade	Campo de preenchimento obrigatório. Sem modalidade, Bruta ou Bilateral. Forma de liquidação financeira do valor do prêmio da antecipação. Modalidade Bruta: quando contrato celebrado entre contas próprias (contas do tipo 00 e 70 a 89 conta própria e cliente 2 de outro participante). Sem modalidade: quando contrato celebrado entre Instituição Financeira e seus clientes do tipo 1 ou 2.
Valor a Antecipar	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor Base ou Quantidade a ser antecipada. Com duas casas decimais. Este campo não é exibido quando contrato com opção de média asiática ponderada.

Dados Asiáticos

(Os campos referentes a este item são exibidos quando opção Asiática com média Aritmética ponderada)

Data	Data de referência para a apuração do trigger.
Valor Referência Remanescente	Valor remanescente do Valor Base.
Valor a Antecipar	Campo de preenchimento obrigatório, Valor da opção a ser antecipada do Valor Remanescente. Deve ser menor ou igual ao Valor de Referência Remanescente informado na data indicada. Campo apresentado para cada data de verificação do contrato com média asiática.

Observações:

Valor de Rebate - Atualizações da consulta

O registro de antecipação de Opção de Mercadoria com novo valor de rebate indicado atualiza a consulta de contrato da seguinte forma:

1) Valor de Rebate definido no registro do contrato, o novo valor será incluído no campo "Valor do Rebate" e o antigo valor passa a ocupar o campo "Valor Original do Rebate".

- 2) Valor de Rebate definido na liquidação do contrato:
- Se valor de Rebate informado, pela função "Informação de Valor de Rebate", o novo valor será incluído no campo "Valor de Rebate" e o antigo valor passa a ocupar o campo "Valor Original do Rebate".
 - Se valor de Rebate não informado anteriormente, pela função "Informação de Valor de Rebate", o novo valor de rebate não poderá ser incluído na antecipação.

Contratos com Agenda de Redutor de Risco de Crédito

1) O registro de antecipação total de contrato vai gerar antecipação de agenda de redutor de risco de crédito com liquidação financeira do saldo pela mesma modalidade de liquidação da operação do contrato original. Para esses casos também é gerado um novo evento na agenda do DRRC indicando seu tipo e sua situação.

2) As antecipações parciais também vão gerar operações de antecipação de agenda de redutor de risco de crédito, nesse caso o saldo do redutor de risco de crédito liquidado será proporcional ao percentual antecipado do contrato original. Para esses casos também é gerado um novo evento na agenda do DRRC indicando seu tipo e sua situação. Para maiores detalhes a respeito da metodologia de cálculo aplicada para esses casos, consulte o "Cadernos de Fórmulas – DRRC" disponível no site: (http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/negociacao/caderno-de-formulas/).

3.10 Avaliação de Contrato de Opção

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Avaliação de Contrato de Opção

Visão Geral

Função exclusiva para contratos registrados com Índices Internacionais e Parida cuja fonte de informação seja um Feeder, Spot ou Sisbacen Feeder, independente da moeda.

Proporciona o reconhecimento de resultados, permitindo avaliação diária do contrato com base nas taxas de câmbio, **a partir da data de avaliação acordada no registro de contrato** e até a data de vencimento da opção.

Avaliação de Contrato de Opção		
Participante	Instrumento Financeiro	Contraparte
	Código	
05000 . 00 - 5	RIO M141456	05000 . 10 - 8
<input type="button" value="Avançar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/>		

É necessário que a avaliação seja feita para que a opção possa ser calculada e exercida automaticamente na data de vencimento se o valor for positivo para o Titular. A falta de avaliação faz com que o contrato fique com a situação **Pendente de Avaliação**. Caso a avaliação não seja informada na data de vencimento do contrato, até o horário de fechamento da grade de referência, o contrato continua com a situação Pendente de Avaliação e é retirado do Módulo.

Tela de inclusão dos detalhes da Avaliação - Moedas

Avaliação de Contrato de Opção - OFCC RIO M141456	
Paridade (USD/Moeda Base):	1 <input type="text"/> , 0 <input type="text"/>
Paridade (USD/Moeda Cotada):	1 <input type="text"/> , 0 <input type="text"/>
Meu Número:	111 <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/>	

Confirmação de Avaliação de Contrato de Opção - OFCC RIO M141456		
Paridade (Moeda Base/USD ou USD/Moeda Base)	Paridade (Moeda Cotada/USD ou USD/Moeda Cotada)	
1,00000000	1,00000000	
Meu Número		Valor do Exercício
111		
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Desistir"/> <input type="button" value="Corrigir"/>		

Avaliação registrada. Operação de Avaliação No. 2014112417222529.

Avaliação de Contrato de Opção		
Participante	Instrumento Financeiro	Contraparte
	Código	
<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>
<input type="button" value="Avançar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/>		

Tela de inclusão dos detalhes da Avaliação – Índices Internacionais

Modelo sem Cross rate

Avaliação de Contrato de Opção - OFCC GORGO190312	
Paridade a Vista/Preço do Índice:	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Cotação(R\$/Moeda Cotada):	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Meu Número:	<input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/>	

Modelo com Cross rate

Avaliação de Contrato de Opção - OFCC GORGO190311	
Paridade (Moeda Base/USD):	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Paridade (Moeda Cotada/USD):	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Cotação - Taxa de Câmbio R\$/USD:	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Meu Número:	<input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/>	

Confirmação de Avaliação de Contrato de Opção - OFCC GORGO190311		
Paridade (Moeda Base/USD ou USD/Moeda Base) 1,00000000	Paridade (Moeda Cotada/USD ou USD/Moeda Cotada) 1,00000000	Cotação - Taxa de Câmbio R\$/USD 1,00000000
Meu Número 321		Valor do Exercício -99.900,00

Avaliação registrada. Operação de Avaliação No. 2019100810370731.

Avaliação de Contrato de Opção		
Participante	Instrumento Financeiro	Contraparte
	Código	
<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>

De acordo com a **Fonte de Informação** a ser utilizada para a consulta de cotação, são apresentados campos diferentes a serem preenchidos na tela de Inclusão dos Detalhes da Avaliação.

Após clicar no botão **Enviar** é exibida tela para confirmação dos dados preenchidos, acrescida do campo **Valor do Exercício**. Em caso de confirmação, é enviada mensagem com o número da operação de avaliação.

Observação: Não há cancelamento para as operações de Avaliação de Contrato de Opção. Uma nova avaliação deve ser realizada, sobrepondo a anterior.

Descrição dos campos da tela de inclusão de detalhes

Campo	Descrição
Meu número	Campo de preenchimento obrigatório. Número com até 10 dígitos que identifica a operação para controle do participante.

Campo	Descrição
São apresentados de acordo com a Fonte de Informação utilizada para a consulta de cotação. (Veja TAB1).	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Campo exibido conforme Fonte de Informação. Com 8 (oito) casas decimais.</p> <p>Paridade a Vista Quando objeto da opção flexível for:</p> <p>Moeda: é a paridade à vista, entendida como sendo o valor em moeda cotada que é necessário para comprar/vender uma unidade de moeda base.</p> <p>Cotação (R\$/Moeda cotada) Valor em Reais que é necessário para comprar/vender uma unidade de "moeda cotada"</p> <p>Paridade (Moeda Base/USD) ou (USD/Moeda Base) É a paridade entre a moeda base e o dólar dos EUA, entendida como sendo o valor em moeda base que é necessário para comprar/vender uma unidade de dólar.</p> <p>Paridade (Moeda Cotada/USD) ou (USD/Moeda Cotada) É a paridade entre o dólar dos EUA e a moeda cotada, entendida como sendo o valor em dólar que é necessário para comprar/vender uma unidade de "moeda cotada".</p> <p>Cotação – Taxa de Câmbio R\$/USD É a cotação do dólar em Reais, que será utilizada para cálculo da taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.</p>
Data de verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando o contrato tiver opção Asiática.</p> <p>O campo indica qual data da verificação está sendo avaliada.</p>

TAB1-Campos exibidos conforme Fonte de Informação

Fonte de Informação					
Campos	Feeder (sem Cross Rate)	Feeder (com Cross Rate)	Sisbacen/Feeder (com Cross Rate)	Sisbace n	Spot
Paridade a Vista	Paridade a Vista	NA	NA	NA	NA
Cotação (R\$/Moeda Cotada)	Cotação (R\$/Moeda cotada)	NA	NA	NA	NA
Paridade (Moeda Base/USD) ou (USD/Moeda a Base)	NA	Paridade (Moeda Base/USD) ou (USD/Moeda a Base)	Paridade (Moeda Base/USD) ou (USD/Moeda Base)	NA	NA

Fonte de Informação					
Paridade (Moeda Cotada/USD) ou (USD/Moeda Cotada)	NA	Paridade (Moeda Cotada/USD) ou (USD/Moeda Cotada)	Paridade (Moeda Cotada/USD) ou (USD/Moeda Cotada)	NA	NA
Cotação – Taxa de Câmbio R\$/USD	NA	Cotação – Taxa de Câmbio R\$/USD	NA	NA	NA

*NA = Não se aplica.

3.11 (Não) Exercício de Contrato de Opção

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > (Não) Exercício de Contrato de Opção

Visão Geral

Os Contratos de opção de compra ou de venda nas modalidades de exercício **americana** e **européia** que apresentarem **resultado positivo** na **data de vencimento** são exercidos **automaticamente** pelo Módulo nesta data. Porém, caso o participante **não queira** realizar tal exercício, deve acessar esta função na data de vencimento do contrato. O Módulo reconhece que se trata da opção **Não-Exercício** e envia tela para confirmação do participante.

Quando a situação do contrato estiver **finalizada** e o contrato for efetuado entre contas próprias, não é possível a opção **Não exercer**. No caso do contrato entre conta própria e seu cliente 1 ou 2, é possível a opção **Não exercer** até o final da grade **Sem Modalidade**.

Os Contratos de opção que apresentarem resultado **igual ou menor que 0 (zero)** no vencimento do contrato são automaticamente assumidos como **não exercidos**.

Os contratos de opção de compra ou de venda na modalidade de exercício **americana** podem ser exercidos antes da data do vencimento do contrato. Ao acessar a função, o módulo reconhece que se trata de opção de exercício e envia tela para confirmação do participante.

Observação:

O registro de exercício de contrato de opção flexível de ação, tipo americana, tem seu valor diferencial de exercício baseado no preço negociado conforme data de cotação indicada no registro da opção.

Exercício de Opções / Estratégia			
Meu N°	Dados da Operação Original		
	Participante	Instrumento Financeiro Código	Contraparte
111111	05000 . 00 - 5	RIO M141456	05000 . 10 - 8
<input type="button" value="Avançar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/>			

Descrição dos campos do Exercício de Opções/Estratégias

Campo	Descrição
-------	-----------

Campos de preenchimento obrigatório.

Meu Número	Número interno de identificação da operação. Com até 10 dígitos.
Participante	Código Cetip do participante que está efetuando o lançamento.
Instrumento Financeiro Código	Código do ativo da operação.
Contraparte	Código Cetip do outro membro envolvido na operação.

Tela Exemplo – Não-Exercício

Confirmação de Exercício Negativo de Opção OFCC RIO M141456			
Quantidade a Exercer 123,00000000	Valor Financeiro a Exercer - R\$ -31.096.549,03	Meu Número 111111	
Liquidante TESTE - BANCO BRACCE S/A	Modalidade SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	Prêmio Unitário do Exercício - R\$ -252.817,47180000	
Dados do Contrato			
Titular 05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	Lançador 05000.10-8 BCO RIO S/A	Tipo de Exercício EUROPEIA	
CPF / CNPJ do Titular	CPF / CNPJ do Lançador 987.654.321-00	Mercadoria	
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)	
Data de Início 21/11/2014	Data de Vencimento 25/11/2014	Prazo em Dias Úteis 2	
Moeda Base / Ações / Índice / Produto DOLAR DOS EUA	Moeda Cotada / Moeda para Negociação EURO/COM.EUROPEIA	Média para Opção Asiática	
Valor Base / Quantidade 123,00000000	Valor Remanescente 123,00000000	Valor da Aplicação 123.000,00	
Barreira	Trigger In	Trigger Out	
Trigger - Proporção SIM ou NÃO	Trigger - Forma de Disparo contínuo e discreto	Trigger - Tipo de Disparo alta e baixa	
Forma de Verificação	Adesão a Contrato SEM ADESAO	Cross-Rate na Avaliação Sim	
Rebate	Rebate Unitário	Liquidação do Rebate	
Opção de COMPRA			
Prêmio Unitário 1.000,00000000	Preço de Exercício 100.000,00000000	Limite	
Data de Liquidação do Prêmio 21/11/2014	Preço de Exercício em Reais Sim	Opção Quanto Não	Cotação para Opção Quanto
Dados Adicionais			
Fonte de Informação SIBACEN/FEEDER	Cotação para o Vencimento D-1	Boletim PTAX800 FECHAMENTO	Fonte de Captura
Fonte de Consulta BLOOMBERG	Outra Fonte de Consulta	Tela ou Função de Consulta 111111	
Praça de Negociação 555555	Horário de Consulta 11:50	Ação / Ação Internacional / Índice Internacional	
Ajuste de Proventos pelas Partes	Proteção contra Provento em Dinheiro		
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD VENDA	Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda) COMPRA	Data de Avaliação 24/11/2014	
Cotação - Taxa de Câmbio R\$/USD 2,52820000	Paridade (Base) 1,00000000	Paridade (Cotada) 1,00000000	Valor do Exercício -31.096.549,03

Confirmar

Desistir

Em caso de confirmação da operação, é enviada mensagem com o número da operação de cancelamento e do *exercício cancelado*.

Tela Exemplo – Participante efetuando a operação de exercício quando modalidade americana

Confirmação de Exercício Negativo de Opção OFCC RIO M141456			
Quantidade a Exercer 123,00000000	Valor Financeiro a Exercer - R\$ -31.096.549,03	Meu Número 111111	
Liquidante TESTE - BANCO BRACCE S/A	Modalidade SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	Prêmio Unitário do Exercício - R\$ -252.817,47180000	
Dados do Contrato			
Titular 05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	Lançador 05000.10-8 BCO RIO S/A	Tipo de Exercício AMERICANA	
CPF / CNPJ do Titular	CPF / CNPJ do Lançador 987.654.321-00	Mercadoria	
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)	
Data de Início 21/11/2014	Data de Vencimento 25/11/2014	Prazo em Dias Úteis 2	
Moeda Base / Ações / Índice / Produto DOLAR DOS EUA	Moeda Cotada / Moeda para Negociação EURO/COM.EUROPEIA	Média para Opção Asiática	
Valor Base / Quantidade 123,00000000	Valor Remanescente 123,00000000	Valor da Aplicação 123.000,00	
Barreira	Trigger In	Trigger Out	
Trigger - Proporção SIM ou NÃO	Trigger - Forma de Disparo contínuo e discreto	Trigger - Tipo de Disparo alta e baixa	
Forma de Verificação	Adesão a Contrato SEM ADESAO	Cross-Rate na Avaliação Sim	
Rebate	Rebate Unitário	Liquidação do Rebate	
Opção de COMPRA			
Prêmio Unitário 1.000,00000000	Preço de Exercício 100.000,00000000	Limite	
Data de Liquidação do Prêmio 21/11/2014	Preço de Exercício em Reais Sim	Opção Quanto Não	Cotação para Opção Quanto
Dados Adicionais			
Fonte de Informação SISBACEN/FEEDER	Cotação para o Vencimento D-1	Boletim PTAX800 FECHAMENTO	Fonte de Captura
Fonte de Consulta BLOOMBERG	Outra Fonte de Consulta	Tela ou Função de Consulta 111111	
Praça de Negociação 555555	Horário de Consulta 11:50	Ação / Ação Internacional / Índice Internacional	
Ajuste de Proventos pelas Partes	Proteção contra Provento em Dinheiro		
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD VENDA	Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda) COMPRA	Data de Avaliação 24/11/2014	
Cotação - Taxa de Câmbio R\$/USD 2,52820000	Paridade (Base) 1,00000000	Paridade (Cotada) 1,00000000	Valor do Exercício -31.096.549,03

Em caso de confirmação da operação, é enviada mensagem *com o número da operação*.

3.12 Cancelamento de Operações

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Cancelamento de Operações

Visão Geral

É permitido o cancelamento das seguintes operações:

- Registro de Contrato de Opção
- Antecipação de Contrato de Opção
- Cessão de Opção
- Informação de Valor de Rebate

Quando operação efetuada por duplo comando, o cancelamento é permitido desde que esteja pendente de liquidação financeira.

Quando operação efetuada com conta cliente do tipo 1 ou 2 do participante, o cancelamento é permitido, desde que seja no mesmo dia do lançamento.

Tela de Cancelamento de Operações

Cancelamento de Operações				
Meu Nº	Dados da Operação Original			
	Participante	Nº CETIP	Instrumento Financeiro	Contraparte
			Código	
1111116	05000 . 00 - 5	2014112117185102	RIO M145599	05000 . 10 - 8
Avançar		Limpar Campos		

Após clicar no botão **Avançar**, é apresentada tela para confirmação da operação.

Descrição dos campos da Tela de Cancelamento de Operações

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento do cancelamento. Não é necessário que o <i>Titular</i> e o <i>Lançador</i> informem o mesmo número. Com até 10 dígitos.
Participante	Código Cetip do participante que está efetuando o lançamento.
Número Cetip	Número da operação original que deve ser cancelada. Este número pode ser obtido no item Operações – consulta Operações no campo Num Ctrl Operação .
Instrumento Financeiro Código	Código do ativo da operação.

Campo	Descrição
Contraparte	Código Cetip do outro membro envolvido na operação.

Tela exemplo - Confirmação de Cancelamento de Cessão de Opção

Confirmação de Cancelamento de Registro de Opção - OFCC RIO M145599			
Meu Número	1111116		
Titular	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	05000.10-8 BCO RIO S/A	Tipo de Exercício EUROPEIA
CPF / CNPJ do Titular	987.654.321-00	CPF / CNPJ do Lançador 987.654.321-00	Cesta Garantia - Lançador NÃO
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)		
Data de Início	21/11/2014	Data de Vencimento	22/12/2014
Moeda Base / Ações / Índice / Produto	INDICES INTERNACIONAIS		Moeda Cotada / Moeda para Negociação EURO/COM.EUROPEIA
Valor Base / Quantidade	10,00000000	Valor Remanescente	10,00000000
Barreira	Trigger In (Cotação / Índice)		Trigger Out (Cotação / Índice)
Trigger - Proporção	Não	Forma de Disparo	Tipo de Disparo
Forma de Verificação	Adesão a Contrato SEM ADESAO		Cross-Rate na Avaliação Não
Rebate	Rebate Unitário		
Opção de COMPRA			
Prêmio Unitário	1.000,00000000	Preço de Exercício	100.000,00000000
Data de Liquidação do Prêmio	21/11/2014	Preço de Exercício em Reais	Sim
		Limite	
		Opção Quanto	Não
		Cotação para Opção Quanto	
Dados Adicionais			
Fonte de Informação	INDICES INTERNACIONAIS [SISBACEN]	Cotação para o Vencimento	D-1
Fonte de Consulta	REUTERS	Boletim	PTAX800 FECHAMENTO
Praça de Negociação		Tela ou Função de Consulta	
Ajuste de Proventos pelas Partes		Horário de Consulta	Ação / Ação Internacional / Índice Internacional INI001
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD		Proteção contra Provento em Dinheiro	
		Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Data de Avaliação

Em caso de confirmação, é enviada mensagem com o número da operação de cancelamento.

3.13 Cessão de Contrato de Opção

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Cessão de Contrato de Opção

Visão Geral

Um dos participantes envolvidos no contrato pode ceder a um terceiro o contrato registrado anteriormente, desde que exista anuência da contraparte.

A cessão pode ocorrer em D+1 da data de registro e até D-1 da data de vencimento do contrato, sempre pelo valor total.

Ocorre com o lançamento das partes envolvidas, o cedente e o adquirente com a necessidade de confirmação do Anuente, através da função **Confirmação de Cessão de Contrato**. O Cliente 1 do participante não pode ser Anuente na operação.

Caso o Anuente não confirme a cessão, até o encerramento do horário estabelecido para a grade sem modalidade, ela não é processada, permanecendo o contrato com suas condições originais.

O código para o novo contrato deve ser informado na **Tela de Cessão de Contrato**, campo **Novo Código IF**. O mnemônico do novo contrato deve ser alterado para o mnemônico do Adquirente, quando o participante **Lançador** estiver cedendo o contrato, exceto nas operações entre clientes 10.

Cessão de Contrato de Opção				
Participante		Instrumento Financeiro	Contraparte	
Conta	CPF/CNPJ	Código	Conta	CPF/CNPJ
10020 .00 - 1		RIO M142211	01409 .00 - 2	

Após clicar no botão **Avançar**, é exibida tela de inclusão dos detalhes para Cessão de Contrato de Opção.

Cessão e Pagamento de Prêmio

Somente o Cedente ou o Adquirente pode ser titular da operação de pagamento de prêmio. O Adquirente recebe o prêmio da cessão, quando o Cedente for o Lançador do contrato e paga o prêmio, quando o Cedente for o Titular.

A operação de prêmio somente é gerada após lançamento da operação de confirmação da cessão pelo Anuente. O pagamento de prêmio é efetuado simultaneamente à respectiva liquidação financeira.

Os direitos ou obrigações do cedente nos pagamentos de prêmios agendados nos registros do contrato anterior à cessão são transferidos para o adquirente.

Tela de Cessão de Contrato

Cessão de Contrato de Opção - OFCC RIO M142211			
Cedente:	10020.00-1 BCO LEME S/A		
CPF/CNPJ do Cedente:			
Adquirente:	01409.00-2 FLORIDA		
CPF/CNPJ do Adquirente:			
Anuente:	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A		
CPF/CNPJ do Anuente:			
Novo Código IF:	RIO M142233		
Liquidante:	76000	.00	- 3
Modalidade:	BRUTA		
Valor do Prêmio em R\$:	1000	,	
Meu Número:	22111		
Dados do Contrato Original			
Titular	Lançador	Tipo de Exercício	
10020.00-1 BCO LEME S/A	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	EUROPEIA	
CPF/CNPJ Titular	CPF/CNPJ Lançador		
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)	
Data de Início	Data de Vencimento	Prazo em Dias Úteis	
21/11/2014	22/12/2014	21	
Moeda Base / Ações / Índice / Produto	Moeda Cotada / Moeda para Negociação	Mercadoria	
DOLAR DOS EUA	EURO/COM.EUROPEIA		
Valor Base / Quantidade	Valor Remanescente	Valor da Aplicação	
100,00000000	100,00000000	1.000.000,00	
Barreira	Trigger In	Trigger Out	
Trigger - Proporção	Trigger - Forma de Disparo	Trigger - Tipo de Disparo	
Não			
Forma de Verificação	Adesão a Contrato	Cross-Rate na Avaliação	
	SEM ADESAO	Sim	
Rebate	Rebate Unitário	Liquidação do Rebate	
Opção de Compra			
Prêmio Unitário	Preço de Exercício	Limite	
10.000,00000000	1.000.000,00000000		
Data de Liquidação do Prêmio	Preço de Exercício em Reais	Opção Quanto	Cotação para Opção Quanto
21/11/2014	Sim	Não	
Dados Adicionais			
Fonte de Informação	Cotação para o Vencimento	Boletim	Fonte de Captura
SISBACEN/FEEDER	D-1	PTAX800 FECHAMENTO	
Fonte de Consulta	Outra Fonte de Consulta	Tela ou Função de Consulta	
REUTERS		11111	
Praça de Negociação	Horário de Consulta	Ação / Ação Internacional / Índice Internacional	
22222	15:00		
Ajuste de Proventos pelas Partes	Proteção contra Provento em Dinheiro		
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Data de Avaliação	Média para Opção Asiática
VENDA	COMPRA	19/12/2014	

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação da cessão.

Após a confirmação da operação pelo Cedente e Adquirente nesta função é enviada a seguinte mensagem: Cessão realizada. Operação de Cessão nº xxxxx. Matching confirmado. Aguardando confirmação do Anuente.

Descrição dos campos da Tela de Cessão de Contrato

Campo	Descrição
CPF/CNPJ do Adquirente	Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se o Adquirente for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC.
Novo Código IF	Campo de preenchimento obrigatório. Indicação do novo código do instrumento Financeiro, que é gerado depois de finalizada a operação de cessão, onde: Os cinco primeiros dígitos = Mnemônico do participante <i>Lançador do novo contrato</i> ; Os dois seguintes = Dois últimos dígitos do ano de registro do contrato original; E os quatro últimos = Série dada pelas partes (o primeiro dígito deve ser numérico e os outros três alfanuméricos)
Liquidante	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Código Cetip do Banco Liquidante que deve efetuar a liquidação do prêmio da cessão. Caso o campo não seja preenchido, o Módulo assume automaticamente o Banco Liquidante principal do Participante.
Modalidade	Campo de preenchimento obrigatório. Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de Seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.
Valor do Prêmio em R\$	Campo de preenchimento obrigatório. Valor do prêmio unitário, em Reais, pago ou recebido pelo Adquirente, na data de registro. Até duas casas decimais.
Meu número	Campo de preenchimento obrigatório. Número interno de identificação do lançamento com até 8 dígitos.

3.14 Confirmação de Cessão de Contrato de Opção

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Confirmação de Cessão de Contrato de Opção

Visão Geral

Através desta função, o Anuente confirma a operação de Cessão, gerando um novo contrato entre o Adquirente e o Anuente.

Esta confirmação deve ser efetuada no mesmo dia da operação de Cessão, até o encerramento do horário estabelecido para a grade.

Caso o Anuente não confirme a cessão, a mesma não é processada, permanecendo o contrato com suas condições originais.

Após confirmação do Anuente é criado um novo contrato com as mesmas características que o anterior cedido. O contrato anterior, cedido, pode ser apenas consultado permanecendo com a situação **CEDIDO** e será excluído na sua data de vencimento.

Após clicar no botão **Avançar** é apresentada tela com os dados do contrato para confirmação.

Confirmação de Cessão de Contrato de Opções			
Meu N°	Dados da Operação Original		
	Participante	Instrumento Financeiro	Contraparte
		Código	
111	05000 . 00 - 5	RIO M142211	10020 . 00 - 1
Avançar		Limpar Campos	

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Meu N°	Número de identificação do lançamento.
Participante	Código do participante Anuente da operação.
Instrumento Financeiro Código	Código do IF que está sendo cedido.
Contraparte	Código do participante Cedente da operação.

Tela de Confirmação de Cessão

Confirmação de Cessão de Contrato de Opção - OFCC RIO M142211			
Anuente:	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A		
CPF / CNPJ (Anuente):			
Valor do Prêmio em R\$:	1.000,00000000		
Titular do Prêmio:	10020.00-1 BANCO LEME S/A		
Liquidante:	76000.00-3 BCO LUSO BRASILEIRO S/A		
Modalidade:	BRUTA		
Meu Número:	111		
Dados da Cessão do Contrato			
Adquirente	Cedente	Data de Cessão	
01409.00-2 TESTE - FLORIDA	10020.00-1 BANCO LEME S/A	21/11/2014	
CPF/CNPJ Adquirente	CPF/CNPJ Cedente	Novo Código IF	
		RIO M142233	
Dados do Contrato Original			
Titular	Lançador	Tipo de Exercício	
10020.00-1 BCO LEME S/A	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	EUROPEIA	
CPF/CNPJ Titular	CPF/CNPJ Lançador		
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)	
Data de Início	Data de Vencimento	Prazo em Dias Úteis	
21/11/2014	22/12/2014	21	
Moeda Base / Ações / Índice / Produto	Moeda Cotada / Moeda para Negociação	Mercadoria	
DOLAR DOS EUA	EURO/COM.EUROPEIA		
Valor Base / Quantidade	Valor Remanescente	Valor da Aplicação	
100,00	100,00	1.000.000,00	
Barreira	Trigger In	Trigger Out	
Trigger - Proporção	Trigger - Forma de Disparo	Trigger - Tipo de Disparo	
Não			
Forma de Verificação	Adesão a Contrato	Cross-Rate na Avaliação	
	SEM ADESAO	Sim	
Rebate	Rebate Unitário	Liquidação do Rebate	
Opção de Compra			
Prêmio Unitário	Preço de Exercício	Limite	
10.000,00000000	1.000.000,00000000		
Data de Liquidação do Prêmio	Preço de Exercício em Reais	Opção Quanto	Cotação para Opção Quanto
21/11/2014	Sim	Não	
Dados Adicionais			
Fonte de Informação	Cotação para o Vencimento	Boletim	Fonte de Captura
SISBACEN/FEEDER	D-1	PTAX800 18:00 - FECHAMENTO	
Fonte de Consulta	Outra Fonte de Consulta	Tela ou Função de Consulta	
REUTERS		11111	
Praça de Negociação	Horário de Consulta	Ação / Ação Internacional / Índice Internacional	
22222	15:00		
Ajuste de Proventos pelas Partes	Proteção contra Provento em Dinheiro		
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Data de Avaliação	Média para Opção Asiática
VENDA	COMPRA	19/12/2014	

(fim)

Após clicar no botão **Confirmar** é enviada mensagem confirmando a operação de Cessão e exibindo o número da operação de pagamento de prêmio. O pagamento de prêmio é efetuado simultaneamente à respectiva liquidação financeira.

3.15 Informação de Valor de Rebate

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Informação de Valor de Rebate

Visão Geral

Informa o Valor Unitário do Rebate em Reais que deve ser devolvido ao titular do contrato com prerrogativa de barreiras *Knock In* e/ou *Knock Out*, quando este não foi definido no registro de contrato de opção.

Pode ser definido até a data da ocasião da liquidação do contrato. Para contratos com barreira *Trigger In* e/ou *Trigger Out*, a liquidação do Rebate é no vencimento do contrato e para contratos com *Trigger Out* ou *Trigger In-out* a liquidação do Rebate é na data de disparo do *Trigger Out*.

Tela de Filtro

Informação de Valor de Rebate		
Participante	Instrumento Financeiro	Contraparte
	Código	
05000 .00 - 5	RIO M142211	10020 .00 - 1
<input type="button" value="Avançar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/>		

Os campos da Tela de Filtro são de preenchimento obrigatório. Depois clique em **Avançar**.

Tela de Resultado

Informação de Valor de Rebate - OFCC RIO M142211	
Rebate Unitário:	1000 ,
Meu Número:	11111
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/>	

Os campos da Tela de Resultado são de preenchimento obrigatório. Depois clique em **Enviar**.

Após informar o Valor do Rebate Unitário em Reais e o número para identificação desta operação, com até 10 (dez) inteiros e 8(oito) decimais, o participante deve clicar no botão **Enviar** para apresentar a Tela de Confirmação. Se confirmada a operação, o módulo exibe mensagem com o número da operação realizada.

Confirmação de Informação de Valor de Rebate - OFCC RIO M142211	
Rebate Unitário 1.000,00000000	Meu Número 11111
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Desistir"/> <input type="button" value="Corrigir"/>	

4 CONSULTAS

4.1 Características de Contratos

Menu Estratégias e Opções > Consultas > Características de Contratos

Visão Geral

Esta função permite a consulta das características de um Contrato de Opção.

É necessário que ao menos um dos campos *Lançador (Nome Simplificado)*, *Tipo Instrumento Financeiro* ou *Código Instrumento Financeiro* seja preenchido.

Tela de Filtro

Características de Contratos

Tipo de Instr. Financeiro:

Tipo de Opção:

Código Instr. Financeiro:

Lançador (Nome Simplificado):

Titular (Nome Simplificado):

Data de Emissão: / / a / /

Data de Vencimento: / / a / /

Situação do Contrato:

Cesta de Garantias:

Fonte de Informação:

Fonte de Consulta:

Tipo de Exercício:

Limitadores:

Cross Rate:

Barreiras:

Média Asiática:

Sistema Origem:

Código IF Sistema Origem:

A ordenação das informações é de forma crescente, pela coluna Tipo do Instrumento Financeiro e, dentro de cada tipo, pelo Código do Instrumento Financeiro.

Na Tela de Resultado é exibido link que, uma vez acionado, leva ao detalhamento das características do contrato de opção da respectiva linha. A tela de Detalhes do Contrato mostra a situação do contrato no momento da consulta.

Tela de Detalhes do Contrato

Características de Contrato de Opção - OFCC 01397171A01 - CONFIRMADO					
Titular 01702.00-8 TESTE FUNDO ALBERTO		Lançador 01397.00-4 MEIERFDO		Tipo de Exercício EUROPEIA	
CPF / CNPJ do Titular		CPF / CNPJ do Lançador		Cesta Garantia - Lançador NÃO	
Intermediador 12952.69-6 SPINELLI S/A CVMC		Comissão paga pelo Titular (R\$) 1,00		Comissão paga pelo Lançador (R\$) 1,00	
Data de Registro 09/08/2017	Data de Início 09/08/2017	Data de Vencimento 09/10/2017	Prazo em Dias Úteis 42	Data da Última Correção	Data do Último Aditamento
Moeda Base / Ações / Índice / Produto INDICE DI		Moeda Cotada / Moeda para Negociação REAL		Mercadoria	
Valor Base / Quantidade 100.000,00000000		Valor Remanescente 100.000,00000000		Valor da Aplicação 200.000,00	
Barreira		Trigger In		Trigger Out	
Trigger - Proporção Não		Trigger - Forma de Disparo		Trigger - Tipo de Disparo	
Forma de Verificação		Adesão a Contrato SEM ADESAO		Cross-Rate na Avaliação Não	
Rebate		Rebate Unitário	Valor Original Rebate	Liquidação do Rebate	
Opção de COMPRA					
Prêmio Unitário 2,00000000		Preço de Exercício 20.000,00000000		Limite	
Data de Liquidação do Prêmio 09/08/2017		Preço de Exercício em Reais Sim		Opção Quanto	Cotação para Opção Quanto
Dados Adicionais					
Fonte de Informação INDICE		Cotação para o Vencimento D-1		Cotação para Moeda da Mercadoria Boletim DIÁRIO	
Fonte de Captura		Fonte de Consulta CETIP		Outra Fonte de Consulta	Tela ou Função de Consulta
Praça de Negociação		Horário de Consulta		Ação / Ação Internacional / Índice Internacional	
Ajuste de Proventos pelas Partes		Proteção contra Provento em Dinheiro			
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD		Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)		Data de Avaliação	Média para Opção Asiática
		Paridade a vista/Preço Ação ou Índice 16,58000000	Cotação (R\$/Moeda Cotada) 1,00000000	Valor do Exercício	Data da Cotação 04/09/2017
Observação					
Sistema Origem		Código IF Sistema Origem			

Observação: Os contratos de opções flexíveis de ações, que tiveram seus valores de referência ajustados, e que estejam em período **EX Proventos** são apresentados na consulta com marcação em **vermelho**.

Quadro de situações possíveis

Situação do contrato	Descrição
REGISTRADO	Quando o lançamento do registro do contrato é confirmado, mas o prêmio agendado para D0 está pendente de liquidação financeira.
CONFIRMADO	Após a liquidação financeira do prêmio agendado para D0 do registro. Para contratos com prêmio diferido, o contrato é automaticamente confirmado, não dependendo da liquidação financeira do prêmio.
CANCELADO	Status do contrato após operação de cancelamento estar finalizada. Para contratos com prêmio agendado para D0 em que a liquidação financeira não foi realizada, o contrato é automaticamente cancelado.
VENCIDO	Situação do contrato na abertura do Módulo na data de vencimento da opção. Quando o valor financeiro calculado automaticamente pelo Módulo não representa exercício da opção pelo titular e não há liquidação financeira no vencimento. Quando se tratar de contratos entre as instituições financeiras e seus clientes do tipo 1 ou 2.

Situação do contrato	Descrição
REGATADO	Situação do contrato na abertura do Módulo na data de vencimento da opção. Quando o exercício da opção foi efetuado pelo Módulo, automaticamente, no vencimento do contrato e houve liquidação financeira no âmbito da Cetip.
VENCIDO E NÃO PAGO	Situação final do contrato na data de vencimento da opção. Quando há previsão de liquidação financeira no âmbito da Cetip do exercício da opção e o pagamento não foi efetuado.
NÃO EXERCIDO	Situação final do contrato na data de vencimento da opção. Quando o Valor Financeiro do Exercício for negativo ou 0 (zero) é assumido o status Não-Exercício da Opção.
EXERCIDO E NÃO RESGATADO	Situação final do contrato na data de vencimento da opção. Quando o Titular efetuou o exercício e o mesmo ficou pendente de avaliação, não tendo sido liquidado financeiramente.
AVALIADO	Quando o contrato já foi avaliado e a data atual é menor que a data de vencimento.
PENDENTE DE AVALIAÇÃO	Quando a data atual é igual ou posterior à data de avaliação e o contrato ainda não foi avaliado.
ANTECIPADO TOTAL	Quando houve a antecipação total do contrato.
AGUARDANDO TRIGGER IN	Quando o contrato com barreira aguarda o disparo do trigger para ser efetivado.
PENDENTE DE VERIFICAÇÃO	Quando foi registrado um contrato com opção asiática e as datas de referência para avaliação e posterior apuração do valor financeiro da opção não foram informadas.
CEDIDO	Quando contrato original foi cedido.
ACELERADO	Quando houve a aceleração do contrato
RESCINDIDO POR TRIGGER	Quando houve disparo do trigger out e o contrato de opção foi rescindido. Quando não houve disparo de trigger in e contrato não foi efetivado.

A posição em custódia pode ser consultada no item **Custódia** disponível na barra de produtos do **NoMe**, subitem **Swaps, Estratégias e Opções**. As operações podem ser consultadas no item **Operações**.

Pode ser efetuada preenchendo o(s) campo(s) de filtro(s) desejado(s) ou apenas clicando no botão **Pesquisar**. De acordo com o(s) filtro(s) informado(s), são apresentados os lançamentos pendentes e/ou divergentes de todos os participantes pertencentes a sua família de digitação.

Na Tela de Resultados é exibido *link* que, uma vez acionado, leva ao detalhamento das características do contrato de opção da respectiva linha.

Tela de Filtro

Lançamentos

Titular (Nome Simplificado):

Titular (Razão Social):

Tipo de Conta Titular:

Titular (conta): . -

Lançador (Nome Simplificado):

Lançador (Razão Social):

Tipo de Conta Lançador:

Lançador (conta): . -

Tipo de Instr. Financeiro:

Situação:

Tipo Operação:

Nº Operação CETIP:

Meu Nº:

Código Instr. Financeiro:

Tela de Resultados

Lançamentos

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)
Data e Hora da Consulta: 24/11/2014 - 18:09:41

 **Critério de pesquisa**

Nº Operação CETIP	Titular (Razão Social)	Titular (Nome Simplificado)	Titular (Conta)	Lançador (Razão Social)	Lançador (Nome Simplificado)
2014112417222576	BANCO LEME S/A	LEMEBM	10020.00-1	TESTE - BCO RIO S/A	RIOBM

« « 1 » »

(Continua)

Lançador (Conta)	Tipo de Operação	Tipo IF	Código IF	Situação
05000.00-5	REGISTRO CONTRATO OPCAO	OFCC	RIO M143331	PENDENTE DE LANÇAMENTO: TITULAR

(Fim)

5 INFORMAÇÕES ADICIONAIS

5.1 Cruzamento de funcionalidades

Operações e Funcionalidades	Knock In	Knock out	Knock In Out	Opção Índice/Ação	Opção Paridade	Média Asiática	Limitadores	Opção Quanto/Opção em Reais
Knock In	N.A	P	N.A	P	P	I	P	P
Knock Out	P	N.A	N.A	P	P	I	P	P
Knock In Out	N.A	N.A	N.A	P	P	I	P	P
Opção Índice/Ação	P	P	P	N.A	N.A	P	P	I
Opção Paridade	P	P	P	N.A	N.A	P	P	I
Opção Mercadoria	P	P	P	N.A	N.A	P	P	P
Média Asiática	I	I	I	P	P	N.A	P	P
Limitadores	P	P	P	P	P	P	N.A	P
Opção Quanto/Opção em Reais	P	P	P	I	I	P	P	N.A
Exercício Americana	P	P	P	P	P	I	P	P
Exercício Europeia	P	P	P	P	P	P	P	P

Legenda:

- I - Impossível
- N. A - Não se aplica
- P - Possível

5.2 Regras para Registro de Contrato de Paridade conforme Fonte de Informação

SISBACEN e moeda USD Base ou Cotada combinada com outra moeda diferente de USD

Cotação para o vencimento	Boletim
D-1	PTAX800 de 18h00min-Fechamento
D-2	PTAX800 de 18h00min-Fechamento
Não é possível informar <i>Cross Rate</i>	

SISBACEN e outra moeda (diferente de USD) Base ou Cotada

Cotação para o vencimento	Boletim
D-1	PTAX800 de Fechamento
D-2	PTAX800 de Fechamento
Não é possível informar <i>Cross Rate</i>	

SISBACEN/FEEDER e outra moeda (diferente de USD) Base ou Cotada

Cotação para o vencimento	Boletim	Fonte de Consulta	Tipo Taxa de Câmbio	Tipo Paridade
D1	PTAX800 de 18h00min Fechamento	Bloomberg, Reuters, Broadcast ou Outros.	Venda	Compra, Venda ou Média.
D2	PTAX800 de 18h00min Fechamento	Bloomberg, Reuters, Broadcast ou Outros.	Venda	Compra, Venda ou Média.
Não é possível o tipo de moeda USD (Dólar dos EUA). É obrigatório informar <i>Cross Rate</i>				

SPOT e moeda USD Base

Fonte de consulta	Tipo Taxa Câmbio	Tipo Paridade
Somente Spot	Venda Compra Média	Nenhum
Não é possível com outro tipo de moeda		
Não é possível informar <i>Cross Rate</i>		
É obrigatório Moeda Cotada Real		

FEEDER e moeda USD Base ou Cotada combinada com outra moeda diferente de USD

Fonte de consulta	Tipo Taxa Câmbio	Tipo Paridade
Bloomberg, Reuters, Broadcast ou Outros.	Venda Compra Média	Nenhum
Não é possível informar Tipo-Paridade e <i>Cross Rate</i> Não é permitida Fonte de Consulta Spot		

FEEDER e outra moeda (diferente de USD) Base ou Cotada

Fonte de consulta	Tipo Taxa Câmbio	Tipo Paridade
Bloomberg, Reuters, Broadcast ou Outros.	Venda Compra Média	Venda ou Compra ou Média
É obrigatório informar Tipo-Paridade e <i>Cross Rate</i> Não é permitida Fonte de Consulta Spot		

5.3 Regras para Registro de Contrato de Ações/ Índice/Mercadoria**Ações**

Principais campos:

Moeda Base/Ações/Mercadoria	Moeda Cotada	Cross Rate	Ajuste de Proventos pelas Partes	Proteção contra Proventos em dinheiro
Ações	Real	Não se aplica	Não	Não Sim

As cotações relativas às ações são capturadas automaticamente da Reuters.

Índice

Principais campos:

Moeda Base/Ações/Índices	Moeda Cotada	Cross Rate	Boletim
DI	Real	Não se aplica	Não se aplica

Moeda Base/Ações/Índices	Moeda Cotada	Cross Rate	Boletim
Selic	Real	Não se aplica	Não se aplica
Ibovespa	Real	Não se aplica	Fechamento Liquidação

As cotações relativas ao Ibovespa são capturadas automaticamente da Reuters.

As cotações relativas ao índice DI tem como fonte de consulta a Cetip.

As cotações relativas ao índice internacional são capturadas automaticamente.

Mercadorias

Principais campos:

Moeda Base/Ações/Mercadorias	Moeda Cotada
Mercadorias	Real

As cotações relativas às Mercadorias são capturadas automaticamente

5.4 Metodologia de cálculo de valores financeiros para liquidação

Consulte o **Caderno de Fórmulas**, do item Documentação Técnica, no *site* da B3 (http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/negociacao/caderno-de-formulas/).

5.5 Informações Adicionais

Cessão de Contratos

A cessão de Opções Flexíveis é efetuada mediante Duplo Comando dos Participantes cedente e cessionário e anuência do Participante que permanece como parte do contrato.

Na hipótese de uma ou mais das partes envolvidas na cessão de Opção Flexível ser Cliente, o comando e/ou a anuência referido(s) é (são) efetuado(s) pelo(s) Participante(s) titular (titulares) da Conta de Cliente.

A cessão é rejeitada, caso a anuência mencionada anteriormente não seja lançada até o término da grade de registro **Sem Modalidade**.

Havendo previsão de pagamento de prêmio, por ocasião do registro da cessão de Opções Flexíveis, e o mesmo não for liquidado até o término da grade **Bruta**, a cessão é estornada.

A conta de cliente 1 **não** pode ser **anuenta** e pode ser adquirente somente quando a conta própria for anuenta da operação.

Comissão de intermediação

O pagamento da comissão pela intermediação de Contrato de Opção através da Cetip, quando devido, somente é permitido se efetuado na mesma data em que o contrato de opção for registrado no Módulo.

A comissão de intermediação pode ser debitada de uma ou de ambas as partes da operação.

A inadimplência no pagamento de comissão não acarreta o **estorno da Opção**.

O estorno da Opção não implica no estorno da operação de intermediação.

Opção de Mercadoria – Datas de *Fixing*

Os contratos de opções de mercadoria apresentam dois campos para *fixing* conforme tabela abaixo:

Campo	Descrição	Deslocamento (D-1,..., D-5)
Cotação para Vencimento	contém a informação do deslocamento para a captura da cotação/preço da mercadoria	“Pula” sábado e domingo
Cotação para Moeda	contém a informação do deslocamento para a captura da cotação da moeda (paridade entre a moeda de cotação da mercadoria contra o Real)	“Pula” sábado, domingo e feriados nacionais*

* feriados nacionais em que não há funcionamento dada plataforma de registro do Segmento UTVM.

Tratamento de mercadorias internacionais em feriados

Se na data de *fixing* da mercadoria não houver divulgação do preço na bolsa em que a mercadoria é cotada, será utilizada a última cotação disponível.

Se a data de *fixing* da mercadoria for feriado nacional, mas houver divulgação do preço na bolsa em que a mercadoria é cotada, será utilizada a cotação divulgada pela bolsa de referência.

Exemplos práticos de deslocamento do fixing da mercadoria:

- a) Feriado sexta-feira no Brasil e tem vencimento de contrato na própria sexta-feira, com:
 - Fixing D-1: O contrato será liquidado na segunda-feira com cotação da quinta-feira.
 - Fixing D-2: O contrato será liquidado na segunda-feira com cotação da quarta-feira.
- b) Feriado internacional na quinta-feira e feriado local na sexta-feira, com vencimento de contrato na segunda-feira, com:
 - Fixing D-1: O contrato será liquidado na segunda-feira, com cotação de sexta-feira.
 - Fixing D-2: O contrato será liquidado na segunda-feira, com cotação de quarta-feira.

5.6 Tratamento de Proventos

Para dividendo ou outro provento em dinheiro, o preço de exercício (preço de referência) é ajustado, deduzindo-se o valor do dividendo do preço de exercício.

Para subscrição ou qualquer outro direito de preferência, o preço de exercício (preço de referência) é ajustado, deduzindo-se o valor teórico do direito.

Para bonificação ou qualquer provento que altere a quantidade de ações, ajusta-se a quantidade e o preço de exercício (preço de referência) proporcionalmente ao percentual do provento.

Exemplo 1:

As Opções Flexíveis de Ações sem proteção contra proventos em dinheiro - opção “NÃO” no campo “Proteção Contra Proventos em Dinheiro” -, e somente na ocorrência de provento do tipo “Bonificação” ou qualquer provento que altere a quantidade de ações, terão seus valores de referência alterados automaticamente pelo Módulo, conforme exemplo a seguir:

Ação – XPTO1

Data de Registro do Contrato – 10/8/2010

Data do Provento – 18/8/2010

Tipo de Provento – EX B

Fator do Provento – 1,50000000

Quantidade Original – 10,000

Valor do Prêmio Unitário Original – 0,10000000

Valor do Exercício Original – 12,00

Quantidade Ajustada – 15.000

Valor do Prêmio Unitário Ajustado – 0,06666667

Valor do Exercício Ajustado – 8,00

Exemplo 2:

As Opções Flexíveis de Ações com proteção contra proventos em dinheiro - opção “SIM” no campo “Proteção Contra Proventos em Dinheiro” -, e na ocorrência de todos os tipos de provento, terão seus valores de referência alterados automaticamente pelo Módulo, conforme exemplos a seguir:

Ação – XPTO2

Data de Registro do Contrato – 10/8/2010

Data do Provento – 20/8/2010

Tipo de Provento – EX B D S

1º Provento em 10/08/2010 Fator Bonificação – 1,20000000

2º Provento em 10/08/2010 Valor Dividendo – 0,15

3º Provento em 10/08/2010 Valor Subscrição – 0,25

Quantidade Original – 20,000

Valor do Prêmio Unitário Original – 0,85000000

Valor do Exercício Original – 15,00

Quantidade Ajustada – 24.000

Valor do Prêmio Unitário Ajustado – 0,30833334

Valor do Exercício Ajustado – 12,10

Observações:

1. Todos os contratos registrados na primeira data “EX Provento” deverão ter seus valores de referência baseados nos preços “EX Provento” negociados e divulgados na data;
2. Os registros retroativos de contratos, que envolvam clientes do tipo 1, na primeira data “EX Provento” deverão ter seus valores de referência baseados nos preços “EX Provento” negociados e divulgados na data;

3. Os contratos em vigência, com prerrogativa de proteção contra proventos em dinheiro, terão seus valores de referência ajustados por todos os proventos divulgados para ação objeto da opção; e.
4. Os Preços Ajustados são arredondados com 2 casas decimais e as Quantidades ajustadas são truncadas na 8ª (oitava) casa decimal.
5. Os valores de proventos serão aplicados pela Cetip pelo valor líquido.
6. Quando “Trigger – Proporção” estiver preenchido com "Sim", o ajuste de proventos irá incidir sobre o Preço de Exercício. Como neste modelo de registro o trigger é uma proporção percentual aplicada sobre o Preço de Exercício, o sistema não realizará o ajuste neste campo.

5.7 Ativos Subjacentes Disponíveis

A consulta dos ativos subjacentes disponíveis para registro pode ser consultada através dos seguintes arquivos públicos:

Caso o Tipo Indicador seja PARIDADE, AÇÕES NACIONAIS, ÍNDICES, ÍNDICES INTERNACIONAIS:

*Sistema NoME > Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos > **AAAAMMDD_Indexadores_OPCAO***

Caso o Tipo Indicador seja MERCADORIA:

*Sistema NoME > Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos > **AAAAMMDD_Mercadorias***

Cadastro de novos ativos subjacentes

Solicitações para inclusão de novos ativos subjacentes podem ser feitas através do e-mail: op.derivativosbalcao@b3.com.br

5.8 Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros

Para Opção Flexível de Compra de Câmbio - OFCC e Opção Flexível de Venda de Câmbio - OFVC

Exemplo: LEMEM1164R5

Onde:

LEMEM = Mnemônico do participante Lançador

11 = Dois últimos dígitos do ano (nesse caso, ano de 2011)

64R5 = Série dada pelas partes, o primeiro dígito deve ser numérico e os outros três alfanuméricos.