

# DERIVATIVOS COM CCP

**CONTEÚDO**

<b>1 ATUALIZAÇÕES DA VERSÃO</b> .....	<b>3</b>
<b>2 INTRODUÇÃO</b> .....	<b>4</b>
2.1 Definições .....	4
2.2 Sistema de Registro de Derivativos de Balcão - NoMe .....	4
2.3 Ações dos botões das telas .....	5
<b>3 LANÇAMENTOS</b> .....	<b>6</b>
3.1 Cadastro de Clientes .....	6
3.1.1 Cadastro Investidos CCP .....	6
3.2 Registro de Contrato de SWAP .....	7
3.3 Registro de Contrato de Termo de Moedas .....	12
3.4 Registro de Contrato de Opções.....	15
3.5 Introdução.....	21
3.6 Antecipação .....	21
3.7 Anulação de Registro.....	29
3.8 Cancelamento de Antecipação .....	30
3.9 Exclusão de Contrato.....	31
3.10 Transferência de Conta e Posição.....	31
3.11 Cessão de Direito .....	32
3.12 Brokeragem .....	32
3.13 Registro e operações por arquivo.....	35
<b>4 CONSULTA</b> .....	<b>37</b>
4.1 Características de Contratos de Swap.....	37
4.2 Características de Contratos de Opção .....	40
4.3 Características de Contratos de Termo com CCP .....	44
4.4 Manutenção de Operações Pendentes.....	45
4.5 Consulta lançamentos de Opção Flexível com CCP .....	46
4.6 Consultas e relatórios .....	48
4.7 Consulta de Operações .....	52
4.8 Consulta de Arquivos e Relatórios.....	54
4.9 Consulta – Histórico de Ajuste de Proventos de Ações CCP .....	55
<b>5 VARIÁVEIS ACEITA POR TIPO DE CONTRATO</b> .....	<b>57</b>
5.1 Tabela Auxiliares – Swap, Termo e Opções.....	57
<b>6 TARIFAÇÃO</b> .....	<b>58</b>

## 1 ATUALIZAÇÕES DA VERSÃO

Versão	Atualização em	Atualização
1.0	06/11/2019	Alteração na descrição do campo “Monitoramento de Barreiras” do tópico ‘ <b>Registro de Contrato de Opções</b> ’
1.0	01/11/2019	Alteração na descrição do campo “Monitoramento de Barreiras” do tópico ‘ <b>Registro de Contrato de Opções</b> ’
1.0	25/09/2019	Alteração nos campos “Preço do Exercício” e “Limitador” do tópico ‘ <b>Registro de Contrato de Opções</b> ’
1.0	26/04/2019	Adequação do Manual para o sistema NoMe.
2.0	30/03/2019	Inclusão das funcionalidades de anulação de registro via arquivo, atualização de campos e filtros na tela de característica de contrato de opções e a disponibilização da função de cadastro do investidor CCP.
2.1	12/06/2020	Inclusão de informações sobre Antecipação de SWAP.
2.2	28/09/2020	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Em Consultas: inclusão da funcionalidade de consulta de Histórico de Ajustes por Proventos com os campos de quantidades de antecipação antes e pós pagamento de proventos, conforme divulgado no comunicado 019/2020-VPC.</li> <li>- Inclusão sobre o processo de solicitação de exclusão de contratos</li> <li>- Referência ao arquivo NegBalcao que contém o estoque de contratos em aberto ajustados por provento data geração do arquivo.</li> <li>- Em Registro de Operações por Arquivo: incluída referência ao arquivo “Indexadores CCP” e link para acesso aos dados da Tarifação de Mercado de Balcão.</li> </ul>
2.3	26/10/2020	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Em Registro: início do intervalo de verificação das barreiras Knock In e Knock Out a partir de D+1 da data de registro do contrato.</li> </ul>
2.4	07/12/2020	<ul style="list-style-type: none"> <li>- Em Registro,</li> <li>- Habilitação do registro de Opções Flexíveis de Índices e ETFs com monitoramento Discreto.</li> <li>- Em Exclusão do Contrato e na Consulta – Histórico de Ajuste de Proventos de Ações CCP: inclusão da documentação de funcionalidade já disponível ao mercado.</li> </ul>

### NOTA

A B3 divulgará as atualizações no site com eventuais revisões nos capítulos, sempre que necessário.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Gerência de Registro de Operações de Balcão no telefone: (11) 2565-5044 ou e-mail: [op.derivativosbalcao@b3.com.br](mailto:op.derivativosbalcao@b3.com.br)

Site: [http://www.bmfbovespa.com.br/pt\\_br/produtos/mercado-de-balcao/derivativos/](http://www.bmfbovespa.com.br/pt_br/produtos/mercado-de-balcao/derivativos/)

## 2 INTRODUÇÃO

### 2.1 Definições

As definições dos termos com iniciais em maiúscula, em suas formas no singular e no plural, utilizadas neste Manual de Operações, aplicam-se as definições e os significados constantes do Glossário das Normas do Segmento Cetip UTVM.

Parágrafo único – Os termos usuais dos mercados financeiro e de capitais, os de natureza jurídica, econômica e contábil e os termos técnicos de qualquer outra natureza empregados neste Manual de Produtos e não constantes do Glossário das Normas do Segmento Cetip UTVM têm os significados geralmente aceitos no Brasil.

### 2.2 Sistema de Registro de Derivativos de Balcão - NoMe

O NoMe é a plataforma de Registro e gerenciamento de operações de balcão que visa modernizar, aperfeiçoar e expandir o serviço de Registro de operações de balcão, oferecendo qualidade e agilidade aos Clientes, bem como ferramentas completas de análise para atividades de back office. Suas ferramentas e funcionalidades permitem aos usuários:

- Registrar operações de Derivativos de Balcão com CCP;
  - SWAP
  - TERMO
  - OPÇÕES
  
- Realizar consultas unificadas das operações realizadas no dia e consulta de posições em aberto, auxiliando no gerenciamento e no controle da posição de seus clientes;
- Comandar operações de Registro; Antecipação parcial e/ou total; Anulação de Registro; Anulação de Antecipação; diretamente pelo sistema ou;
- Os eventos de Transferência de Conta, Cessão de Direito e Transferência de Posição só serão realizados mediante solicitação junto a B3, que é responsável pelas devidas análises e execução deste tipo de operação.

Complementam esse Manual de Operações, contendo maior detalhamento dos parâmetros passíveis de registro e com as respectivas metodologias de cálculo os seguintes documentos:

- Manual de Normas de Derivativos de Balcão; e
- Caderno de Fórmulas – Derivativos de balcão com CCP.

#### **Requisito Técnico:**

Para um melhor funcionamento da plataforma sugerimos o uso do Microsoft Internet Explorer.

### 2.3 Ações dos botões das telas

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

Botão	Funcionalidade
Enviar	Processa as informações, levando para a tela de confirmação.
Limpar Campos	Limpa os campos já preenchidos.
Desistir	Não processa as informações, saindo da tela e voltando à página do NoMe.
Prosseguir	Prossegue com a ação indicada na tela.
Pesquisar	Realiza pesquisa de acordo com dados inseridos na tela filtro.
Voltar	Volta à tela anterior com os últimos dados digitados.
Confirmar	Confirma os dados apresentados em tela.
Corrigir	Retorna a tela anterior com os dados editados para possível correção.
Atualizar	Reexecuta a consulta a partir dos filtros informados na tela de filtro.

### 3 LANÇAMENTOS

#### 3.1 Cadastro de Clientes

O registro de uma operação com garantia no Sistema NoMe somente poderá ser efetuado por um Participante de Registro conforme regras discriminadas no Manual de Acesso da B3.

Para atuar como Participante de Registro, a instituição deverá solicitar seu Direito de Acesso aos Subsistemas de Registro exclusivamente para registro de Derivativos com CCP, ao departamento de Cadastro da B3 apresentando a documentação necessária, disponível no site [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br).

O Participante de Registro deverá cadastrar as contas de seus clientes no NoMe e na plataforma SINCAD. O cadastro em ambas plataformas é necessário para que o sistema crie uma correlação entre os clientes.

Para o NoMe devem ser considerados dois processos distintos de cadastro:

- 1) Comitentes – Devem ser cadastrados no Sistema de Identificação de Comitentes (SIC), conforme Manual de Operações “SIC - Identificação de Comitentes”.

São comitentes: Pessoa Física, Investidor não Residente (INR) e Pessoa Jurídica não financeira.

Esse cadastro poderá ser realizado via tela, individualmente, ou por arquivo, em lote.

#### 3.1.1 Cadastro Investidos CCP

- 2) Investidor CCP – Menu CCP > Administração > Manutenção > Cadastro de investidor CCP.

#### Visão Geral

Através desta função, é possível realizar o cadastro do Investidor CCP.

#### Tela Cadastro de Investidor CCP.

#### Descrição dos Campos da Tela de Cadastro de Investidor CCP.

Campo	Descrição
Investidor CCP(CNPJ)	CNPJ do investidor a ser cadastrado na família CCP.
Familia CCP (Nome)	Nome da família CCP que o novo investidor fara parte.
Familia CCP(CNPJ Titular)	CNPJ Titular da Família CCP.

São Investidores CCP: os clientes que possuem naturezas econômicas que por definição não podem atuar como comitente, portanto devem possuir conta própria: Fundos de Investimento, Clubes de Investimento, Sociedades Seguradoras e resseguradores locais, Entidades abertas e fechadas e de previdência complementar, Sociedades de capitalização, Instituições financeiras e demais instituições autorizadas a funcionar pelo Banco Central, observado que tais instituições tenham domicílio no Brasil e estejam sujeitas às regras previstas na legislação brasileira.

Com os cadastros concluídos nas plataformas NoMe e Sincad, é possível consultar se a correlação entre as contas do cliente, em ambas plataformas, foi realizada corretamente. Sem a correlação entre os cadastros não será possível efetuar o registro do Derivativo com CCP.

Esta função também está disponível por arquivo, o leiaute do arquivo está disponível no manual Enviar arquivo, dentro do Capítulo > Derivativos com CCP do documento.

[http://www.b3.com.br/pt\\_br/regulacao/estrutura-normativa/estrutura-normativa/manuais-de-operacoes-8ae490ca69088bf00169104ff0ad7417/transferencia-de-arquivos/](http://www.b3.com.br/pt_br/regulacao/estrutura-normativa/estrutura-normativa/manuais-de-operacoes-8ae490ca69088bf00169104ff0ad7417/transferencia-de-arquivos/)

Para fazer essa verificação, é preciso acessar o sistema NoMe no menu lateral, CCP, Administração, Consultas e Consulta de Contas/Comitentes Cetip x Contas Sincad, preencher os dados do PR e cliente e clicar em Pesquisar.

**Consulta de Contas/Comitentes Cetip x Contas SINCAD**

Código do Participante

Membro de Compensação - MC

Conta SINCAD

Natureza Econômica SINCAD

Conta Própria Cetip --

CPF/CNPJ

Situação

O sistema exibirá a situação desta conta; caso esteja ativa, os registros das operações de derivativos com CCP já poderão ser realizados.

Dúvidas no procedimento do cadastro de contas poderão ser esclarecidas com a área de Cadastro no telefone: (011) 2565-5071 ou pelo e-mail [cadastro@b3.com.br](mailto:cadastro@b3.com.br)

### 3.2 Registro de Contrato de SWAP

Menu CCP > Contrato de Swap > Lançamentos > Registro de Contrato

#### Visão Geral

Através desta função, é possível registrar um contrato de Swap com CCP.

## Tela Registro de Contrato – Swap

## Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato - SWAP

Campo	Descrição
Conta Registradora - Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Conta Cetip do Participante da Parte do contrato.
Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Conta Cetip do cliente da parte do contrato.
Campo	Descrição
Código do PR - Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código do Participante de Registro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, registrando o contrato
Conta SINCAD - Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta SINCAD do cliente de quem está registrando o contrato
Conta Repasse - Parte	Campo de preenchimento opcional (preenchimento só será obrigatório quando a conta tiver vínculo de repasse). Conta Cetip da conta de repasse do cliente final (cessionário da operação) da parte que está registrando o contrato, se houver
Taxa Operacional	Campo Opcional Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação, se aplicável. Valor meramente informativo. Opções: Percentual (será aplicado sobre o valor base remanescente); ou Valor.
Valor / Percentual	Campo de preenchimento opcional. Preencher com as opções "Valor" ou "Percentual" caso tenha sido cobrada uma taxa operacional no registro do contrato Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais.
Membro de Compensação	Campo não editável Aparece preenchido com o membro de compensação da parte na tela de confirmação do Registro
Garantia	Campo de preenchimento obrigatório. Opções "COM" e "SEM", que indicam a existência ou não de garantia Para derivativos com garantia ao menos uma das pontas deve ser preenchida com a opção "COM".
Conta Registradora - Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Conta Cetip do Participante da Contraparte do contrato
Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório apenas quando o participante de registro for o mesmo da parte.

	Conta Cetip do cliente da contraparte do contrato.
Código do PR - Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código do Participante de Registro da contraparte do contrato
Conta SINCAD - Parte	Campo de preenchimento obrigatório apenas quando o participante de registro for o mesmo da parte. Código da conta SINCAD do cliente da contraparte do contrato
Conta Repasse - Parte	Campo de preenchimento opcional (preenchimento só será obrigatório quando a conta tiver vínculo de repasse). Conta Cetip da conta de repasse do cliente final (cessionário da operação) da contraparte que na outra ponta do contrato, se houver.
Taxa Operacional	Campo Opcional Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação, se aplicável. Valor meramente informativo. Opções: Percentual (será aplicado sobre o valor base remanescente); ou Valor.
Valor Percentual	Campo de preenchimento opcional. Preencher com as opções “Valor” ou “Percentual” caso tenha sido cobrada uma taxa operacional no Registro do contrato Informado com 13 inteiros e 4 decimais
Membro de Compensação	Campo não editável Aparece preenchido com o Membro de Compensação da contraparte na tela de confirmação do registro
Garantia	Campo de preenchimento obrigatório. Opções “COM” e “SEM”, que indicam a existência ou não de garantia Para derivativos com garantia ao menos uma das pontas deve ser preenchida com a opção “COM”.

#### **CARACTERÍSTICAS – Características básicas do contrato**

Data Início	Campo de preenchimento obrigatório. Data a partir da qual as curvas do contrato passam a ser atualizadas.
Data Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Data na qual o contrato de Swap vence. Deve ser maior que Data Início.
Valor Base	Campo de preenchimento obrigatório. Valor Base inicial da operação a partir do qual os parâmetros definidos para o contrato ou para a correção das operações a termo irão incidir. Com 14 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído à operação de registro de Swap. Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.
Nº de Controle do PR	Campo de preenchimento Opcional  Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato.

#### **Curvas para atualização – Parte**

Percentual	Campo de preenchimento obrigatório. Valor percentual do parâmetro com que o participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva. Informado com até 3 (três) inteiros e 2 (dois) decimais.
Categoria	Campo de preenchimento obrigatório

	Campo tipo “domínio” com as opções: INDICES, INDICES DE PREÇOS, JUROS e TAXAS DE CAMBIO.
Curva	Campo de preenchimento obrigatório Campo deve ser preenchido com a escolha da curva do contrato, conforme parâmetros estabelecidos na Tabela Auxiliar – Swap com CCP.
+/-	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
Juros (%aa)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher em conjunto com <b>Sinal</b> . Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.

#### **Curvas para atualização – Contraparte**

Percentual	Campo de preenchimento obrigatório. Valor percentual do parâmetro com que o participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva. Informado com até 3 (três) inteiros e 2 (dois) decimais.
Categoria	Campo de preenchimento obrigatório Campo tipo “domínio” com as opções: INDICES, INDICES DE PREÇOS, JUROS e TAXAS DE CAMBIO.
Curva	Campo de preenchimento obrigatório Campo deve ser preenchido com a escolha da curva do contrato conforme parâmetros estabelecidos na Tabela Auxiliar – Swap com CCP.
+/-	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
Juros (%aa)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher em conjunto com Sinal. Informado com até 3 (três) inteiros e 4 (quatro) decimais.

#### **Cotação Inicial / Data da Cotação - Parte**

Cotação Inicial	Campo de preenchimento opcional. Permitido apenas para “TAXAS DE CAMBIO”. Informado com até 6 (seis) inteiros e 7 (sete) decimais.
Data da Cotação	Campo de preenchimento obrigatório para “TAXAS DE CAMBIO”. Campo tipo “domínio” com a opção: “D-1”.

#### **Cotação Inicial / Data da Cotação - Contraparte**

Cotação Inicial	Campo de preenchimento opcional. Permitido apenas para “TAXAS DE CAMBIO”. Informado com até 6 (seis) inteiros e 7 (sete) decimais.
Data da Cotação	Campo de preenchimento obrigatório para “TAXAS DE CAMBIO”. Campo tipo “domínio” com a opção: “D-1”.

## Tela de Confirmação

> CCP > Contrato de Swap > Lançamentos > Registro de Contrato

Registro de Contrato SWAP CCP - Pagamento Final							
Parte				Contraparte			
Conta Registradora	Parte	Código do PR	Conta SINCAD	Conta Registradora	Contraparte	Código do PR	Conta SINCAD
03454.00-0	03454.00-0	90301	1	05000.00-5		500	
Conta Repasse	Taxa Operacional	Valor / Percentual	Membro de Compensação	Conta Repasse	Taxa Operacional	Valor / Percentual	Membro de Compensação
			90301				500
Garantia COM				Garantia SEM			
Características							
Data Início	Data Vencimento	Valor Base	Meu Número	Nº de Controle do PR			
14/09/2018	21/09/2018	1.000.000,00	7874				
Curvas para Atualização							
Parte				Contraparte			
Percentual	Categoria	Curva		Percentual	Categoria	Curva	
100,00	INDICES	IBOVESPA FECHAMENTO		100,00	JUROS	DI	
+/-	Juros(% aa)			+/-	Juros(% aa)		
Cotação Inicial / Data de Cotação							
Parte				Contraparte			
Cotação Inicial		Data de Cotação		Cotação Inicial		Data de Cotação	

Em operações de Comando Simples, ao selecionar o botão Enviar, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante de Registro pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o contrato foi registrado com sucesso.

Em operações de Duplo Comando, ao clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o sistema está aguardando lançamento da contraparte.

A confirmação da contraparte pode ser feita de duas maneiras: pela própria tela de registro ou pela funcionalidade: “Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes”

Somente após o confronto automático das informações o sistema gera o número de identificação da Operação. Caso a operação não seja confirmada até o horário de encerramento, o sistema descartará essa ação ao final do dia.

### 3.3 Registro de Contrato de Termo de Moedas

Menu CCP > Contrato de Termo > Lançamentos > Registro de Contrato

#### Visão Geral

Esta função permite ao Participante registrar um contrato de Termo de Moedas.

#### Tela Registro de Contrato – Termo de Moedas

CCP > Contrato de Termo > Lançamentos > Registro de Contrato HOMOLOG

Contrato a Termo de Moedas			
<b>Parte</b>		<b>Contraparte</b>	
Conta Registradora	Conta	Código PR	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Conta SINCAD	Taxa Operacional	Valor Taxa Operacional	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Conta Repasse		Posição do Participante	
<input type="text"/>		<input type="text"/>	
Características			
Meu Número	Data de Início	Data de Vencimento	Valor Base(Referência)
<input type="text"/>	14/09/2018	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Moeda Base(Referência)	Moeda Cotada	Taxa a Termo	Nº de Controle do PR
USD ( 220 ) - DOLAR DOS EUA	BRL ( 790 ) - REAL	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Referências Moeda Base / Moeda Cotada			
Fonte de Informação - Moeda Base	Boletim - Moeda Base	Fonte de Informação - Moeda Cotada	Boletim - Moeda Cotada
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Fixing e Vencimento			
Tipo de Apuração	Data Fixing	Data de Liquidação	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

#### Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato – Termo de Moedas

Campo	Descrição
Conta Registradora - Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, registrando o contrato.
Conta - Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Conta Cetip do cliente da parte do contrato.

<b>Campo</b>	<b>Descrição</b>
Código do PR Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código do Participante de Registro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, registrando o contrato
Conta SINCAD Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta SINCAD do cliente de quem está registrando o contrato
Conta Repasse Parte	Campo de preenchimento opcional. (preenchimento só será obrigatório quando a conta tiver vínculo de repasse) Conta Cetip da conta de repasse do cliente (cessionário da operação) da parte que está registrando o contrato, se houver
Taxa Operacional	Campo Opcional Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação, se aplicável. Valor meramente informativo. <b>Opções:</b> Percentual (será aplicado sobre o valor base remanescente); ou Valor.
Valor / Percentual	Campo de preenchimento opcional. Preencher com as opções “valor” ou “percentual” caso tenha sido cobrada uma taxa operacional no Registro do contrato Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais.
Membro de Compensação	Campo não editável Aparece preenchido com o membro de compensação da parte na tela de confirmação do Registro
Garantia	Campo de preenchimento obrigatório. Opções “COM” e “SEM”, que indicam a existência ou não de garantia Para derivativos com garantia ao menos uma das pontas deve ser preenchida com a opção “COM”.
Conta Registradora - Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Conta Cetip do Participante de Registro da contraparte do contrato
Conta Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório apenas quando o Participante de Registro for o mesmo da parte. Conta Cetip do cliente da contraparte do contrato.
Código do PR Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código do Participante de Registro da contraparte do contrato
Conta SINCAD Parte	Campo de preenchimento obrigatório apenas quando o Participante de Registro for o mesmo da parte. Código da conta SINCAD do cliente da contraparte do contrato
Conta Repasse – Contraparte	Campo de preenchimento opcional (preenchimento só será obrigatório quando a conta tiver vínculo de repasse). Conta Cetip da conta de repasse do cliente final (cessionário da operação) da contraparte que na outra ponta do contrato, se houver
Taxa Operacional	Campo Opcional Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação, se aplicável. Valor meramente informativo. Opções: Percentual (será aplicado sobre o valor base remanescente); ou Valor.
Valor Percentual	Campo de preenchimento opcional. Preencher com as opções “valor” ou “percentual” caso tenha sido cobrada uma taxa operacional no Registro do contrato Informado com 13 inteiros e 4 decimais.

Membro de Compensação	de	Campo não editável Aparece preenchido com o membro de compensação da contraparte na tela de confirmação do registro
Posição Participante	do	Campo de preenchimento obrigatório. Opções “COMPRADOR” e “VENDEDOR”

### **CARACTERÍSTICAS – Características básicas do contrato**

Meu Número		Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído à operação de registro do contrato de Termo com CCP. Número interno de cada Participante de Registro, identificando o lançamento.
Data Início		Campo não editável. Vem preenchido com a data do dia do Registro, conforme parâmetros definidos na Tabela Auxiliar – Termo com CCP.
Data Vencimento		Campo de preenchimento obrigatório. Data na qual o contrato de Termo com CCP vence. Deve ser maior que data início e em dia útil (considerando calendário da clearing da B3).
Valor Base (Referência)		Campo de preenchimento obrigatório. Valor base de referência a partir do qual os parâmetros definidos para o contrato ou para a correção das operações a termo irão incidir. Com 14 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais.
Moeda Base (Referência)		Campo de preenchimento obrigatório. Campo tipo domínio com as opções: DOLAR, EURO e IENE
Moeda Cotada		Campo de preenchimento obrigatório. Campo tipo domínio com a opção: REAL
Taxa a Termo		Campo de preenchimento obrigatório. Taxa acordada entre as partes que será utilizada para o cálculo do valor de liquidação no vencimento. Com 14 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais.
Nº de Controle do PR		Campo de preenchimento Opcional Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato.

### **Referências Moeda Base / Moeda Cotada**

Fonte de Informação – Moeda Base		Campo de preenchimento obrigatório. Indica a fonte a ser utilizada para cotação da moeda.
Boletim – Moeda Base		Campo de preenchimento obrigatório Boletim que será usado para cotação da moeda base. Campo tipo “domínio” com a opção: BACEN.

### **Fixing e Vencimento**

Tipo de Apuração		Campo de preenchimento obrigatório. Campo tipo “domínio” com a opção: Único.
Data Fixing		Campo de preenchimento obrigatório Campo tipo “domínio” com a opção: D-1
Data de Liquidação		Campo de preenchimento obrigatório Essa data deve ser em D0, dia do vencimento.

## Tela de Confirmação

CCP > Contrato de Termo > Lançamentos > Registro de Contrato

Contrato a Termo de Moedas					
Parte			Contraparte		
Conta Registradora	Conta	Código PR	Conta Registradora	Conta	Código PR
03454.00-0	03454.00-0	90301	05000.00-5		500
Conta SINCAD	Taxa Operacional	Valor Taxa Operacional	Conta SINCAD	Taxa Operacional	Valor Taxa Operacional
1					
Membro Compensação	Conta Repasse	Posição do Participante	Membro Compensação	Conta Repasse	
90300		COMPRADOR			
Características					
Meu Número	Data de Operação	Data de Vencimento	Valor Base(Referência)		
7875	03/01/2019	04/12/2019	1.000.000,00		
Moeda Base(Referência)	Moeda Cotada	Taxa a Termo	Nº de Controle do PR		
USD ( 220 ) - DOLAR DOS EUA	BRL ( 790 ) - REAL	10,00000000			
Referências Moeda Base / Moeda Cotada					
Fonte de Informação - Moeda Base	Boletim - Moeda Base	Fonte de Informação - Moeda Cotada	Boletim - Moeda Cotada		
BACEN	PTAX800 de Fechamento				
Fixing e Vencimento					
Tipo de Apuração	Data Fixing	Data de Liquidação			
ÚNICO	D-1	D0			

Confirmar Corrigir Desistir

Em operações de Comando Simples, ao selecionar o botão Enviar, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante de Registro pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o contrato foi registrado com sucesso.

Em operações de Duplo Comando, ao clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o sistema está aguardando lançamento da contraparte.

A confirmação da contraparte pode ser feita de duas maneiras: pela própria tela de registro ou pela funcionalidade: “Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes”

Somente após o confronto automático das informações o sistema gera o número de identificação da operação. Caso a operação não seja confirmada até o horário de fechamento, o sistema descartará essa ação no final do dia.

### 3.4 Registro de Contrato de Opções

Menu CCP > Contrato de Opção > Lançamentos > Registro de Contrato

#### Visão Geral

Esta função permite ao Participante de Registro registrar um contrato de Opções.

## Tela Registro de Contrato – Opções

## Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato – Termo de Moedas

Campo	Descrição
Tipo de Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Indica se a opção é de COMPRA ou de VENDA.
Tipo Indicador	Campo de preenchimento obrigatório. PARIDADE; ETF; AÇÕES e ÍNDICES.
Ação	Campo de preenchimento obrigatório. Única opção: INCLUIR

## Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato – Opções

<b>Campo</b>	<b>Descrição</b>
<b>Parte</b>	
Registrador	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica a instituição que está acessando o sistema e, conseqüentemente, registrando o contrato.
Conta	Campo de preenchimento obrigatório. Conta Cetip do cliente da parte do contrato.
Código do PR	Campo de preenchimento obrigatório. Código do Participante de Registro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, registrando o contrato
Conta SINCAD	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta SINCAD do cliente de quem está registrando o contrato
Taxa Operacional	Campo Opcional Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação, se aplicável. Valor meramente informativo. <b>Opções:</b> Percentual (será aplicado sobre o valor base remanescente); ou Valor.
Valor / Percentual	Campo de preenchimento opcional. Preencher com as opções “valor” ou “percentual” caso tenha sido cobrada uma taxa operacional no Registro do contrato Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais.
Posição	Campo de preenchimento obrigatório. Preencher com as opções “TITULAR” ou “LANÇADOR”
Conta Repasse Parte	Campo de preenchimento opcional (preenchimento só será obrigatório quando a conta tiver vínculo de repasse). Conta Cetip da conta de repasse do cliente final (cessionário da operação) da parte que está registrando o contrato, se houver
<b>Contraparte</b>	
Conta Registradora	Campo de preenchimento obrigatório. Conta Cetip do Participante de Registro da Contraparte do contrato
Conta	Campo de preenchimento obrigatório apenas quando o Participante de Registro for o mesmo da parte. Conta Cetip do cliente da contraparte do contrato.
Código do PR	Campo de preenchimento obrigatório. Código do Participante de Registro da contraparte do contrato
Conta SINCAD	Campo de preenchimento obrigatório apenas quando o Participante de Registro for o mesmo da parte. Código da conta SINCAD do cliente da contraparte do contrato

Taxa Operacional	Campo Opcional Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação, se aplicável. Valor meramente informativo. Opções: Percentual (será aplicado sobre o valor base remanescente); ou Valor.
Valor / Percentual	Campo de preenchimento opcional. Preencher com as opções “valor” ou “percentual” caso tenha sido cobrada uma taxa operacional no Registro do contrato Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais.
Conta Repasse – Contraparte	Campo de preenchimento opcional (preenchimento só será obrigatório quando a conta tiver vínculo de repasse). Conta Cetip da conta de repasse do cliente final (cessionário da operação) da contraparte que na outra ponta do contrato, se houver

### CARACTERÍSTICAS

Data Início	Campo não editável. Vem preenchido com a data do dia do Registro.
Data Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Data na qual o contrato de Opção com CCP vence. Deve ser maior que data início e em dia útil (seguindo o calendário da clearing).
Data de Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Essa data deve ser 1 dia útil (considerando o calendário da clearing) após a data do vencimento.
Quantidade	Campo de preenchimento obrigatório. Preencher com a quantidade de opções negociadas Com 15 (quinze) inteiros e 2 (duas) casas decimais.
Nº de Controle do PR	Campo de preenchimento opcional Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído à operação de registro do contrato de Opção com CCP. Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.
Variável	Indica os tipos de Variáveis relacionadas ao “Tipo Indicador” selecionado na primeira tela de registro. Combobox As variáveis permitidas para Registro estão mencionadas na Tabela Auxiliar – Opção com CCP no site da B3.

### Exercício

Preço de Exercício	Campo de preenchimento obrigatório. Valor do strike do ativo subjacente. Informado com até 15 (quinze) inteiros e 7 (sete) decimais.
Data de Liquidação do Exercício	Campo de preenchimento obrigatório Essa data deve ser 1 dia útil (considerando o calendário da clearing) após a data do vencimento.
Tipo Preço	Campo de preenchimento obrigatório Indica o tipo de preço da Opção Flexível com CCP, conforme especificação da Tabela Auxiliar- Opção Flexível com CCP disponível no site da B3. Opções: Último / Médio
Nº Dias de Apuração	Caso o tipo preço seja “médio”, este campo indica o número de verificações de preço para apuração no vencimento ou Antecipação, a contar da Data de Fixing.

Tipo Opção	Campo de preenchimento obrigatório Indica o tipo de Opção Flexível com CCP, conforme especificação da Tabela Auxiliar – Opção Flexível com CCP. Opção: Européia para derivativos com CCP.
Data Fixing	Data de observação do preço da Variável, conforme especificação da Tabela Auxiliar – Opção Flexível com CCP.
Boletim	Campo de preenchimento obrigatório Boletim/horário do veículo oficial no qual serão publicados os valores da Variável selecionada.
Proteção contra Proventos	Indica proteção contra proventos Campo aplicável apenas para Opção Flexível de ação com CCP. <i>Default</i> “SIM”
Limitador	Campo de preenchimento opcional Valor do limitador inferior ou superior para o monitoramento das barreiras. Informado com até 15 (quinze) inteiros e 7 (sete) decimais.
Prêmio Unitário	Prêmio unitário acordado entre as partes. Informado com 15 (quinze) inteiros e 7 (sete) decimais.
Data de Pagamento do Prêmio	Indica a data de Liquidação financeira do Prêmio, nos contratos com garantia a data do pagamento sempre será D+1 dia úteis (seguindo calendário da clearing) do Registro.

#### Barreira e Rebate

ID - Knock In and Down	Campo de preenchimento obrigatório caso o contrato tenha o tipo de barreira indicado
IU - Knock In and UP	Campo de preenchimento obrigatório caso o contrato tenha o tipo de barreira indicado
OD - Knock Out and Down	Campo de preenchimento obrigatório caso o contrato tenha o tipo de barreira indicado
OU - Knock Out and UP	Campo de preenchimento obrigatório caso o contrato tenha o tipo de barreira indicado
Tipo de Rebate	Campo de preenchimento opcional. Preencher com as opções “VALOR” ou “PERCENTUAL” caso o contrato possua rebate.
Rebate Unitário	Campo de preenchimento obrigatório caso o “Tipo de Rebate” tenha sido preenchido Com 10 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais
Data de Liquidação do Rebate	Preenchimento obrigatório Essa data deve ser 1 dia útil (considerando o calendário da clearing) após a data do vencimento.
Monitoramento de Barreiras	Preenchimento obrigatório caso algum campo das barreiras de Knock In ou Knock Out tenha sido preenchido Campo tipo domínio com a opção: DISCRETA ou CONTÍNUA (apenas para as opções flexíveis sob o Tipo Indicador “Ações” - FCA e FPA - os demais seguem a tabela auxiliar).  A verificação de Barreiras de Knock In (KI) e Knock Out (KO) para os contratos de Opções Flexíveis Com CCP ocorre a partir de D+1 da Data de Registro (inclusive) até a Data de Fixing (inclusive).

## Tela de Confirmação

> CCP > Contrato de Opções > Lançamentos > Registro de Contrato

Confirmação de Registro de Opção- OCCP							
Parte				Contraparte			
Registrador	Conta	Código do PR	Conta SINCAD	Registrador	Conta	Código do PR	Conta SINCAD
03454.00-0	03454.00-0	90301	1	05000.00-5		500	
Taxa Operacional	Valor/Percentual	Membro de Compensação	Posição	Taxa Operacional	Valor/Percentual	Membro de Compensação	
		90300	TITULAR				
Conta Repasse Parte				Conta Repasse Contra Parte			
Características							
Data Início	Data Vencimento		Data de Liquidação		Quantidade		
03/01/2019	04/12/2019		05/12/2019		1.000.000,00		
Nº de Controle PR	Meu Número		Variável				
	7876		DOLAR DOS EUA				
Exercício							
Preço de Exercício	3,7800000		Tipo Opção	EUROPÉIA	Limitador		
Data de Liquidação do Exercício	D+1		Data Fixing	D-1	Prêmio Unitário	1,0000000	
Tipo Preço	ULTIMO		Boletim	PTAX Venda	Data de Pagamento do Prêmio	04/01/2019	
Nº Dias de Apuração	1				Valor do Prêmio	1.000.000,00	
Barreira e Rebate							
ID - Knock In and Down				Tipo de Rebate			
IU - Knock In and UP				Rebate Unitário			
OD - Knock Out and Down				Data de Liquidação do Rebate			
OU - Knock Out and UP				Monitoramento de Barreiras			

Em operações de Comando Simples, ao selecionar o botão Enviar, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante de Registro pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o contrato foi registrado com sucesso.

Em operações de Duplo Comando, ao clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o sistema está aguardando lançamento da contraparte.

A confirmação da contraparte deve ser feita pela própria tela de registro.

Somente após o confronto automático das informações o sistema gera o número de identificação da operação. Caso a operação não seja confirmada até o horário de encerramento do sistema, o sistema descartará essa ação no final do dia.

Registro também pode ser realizado via arquivo txt. vide item “Registro e Operações por Arquivo” neste manual de Operações.

### 3.5 Introdução

Toda e qualquer operação em um contrato derivativo com CCP registrado na B3, deverá ser refletida no Sistema de Registro pelo Participante de Registro com a finalidade de cumprir o disposto no Regulamento.

O Participante de Registro tem a possibilidade de realizar as seguintes operações, de acordo com o permitido por produto e respeitando os limites de prazos para cada evento:

- Antecipação;
- Anulação de Registro;
- Cancelamento de Antecipação;
- Transferência de Conta e Posição;
- Cessão Direito; e
- Brokeragem.

### 3.6 Antecipação

A funcionalidade de solicitação de Antecipação tem como objetivo permitir que o Participante de Registro execute a Antecipação total ou parcial do contrato. A Antecipação total permite o encerramento do contrato antes da data de vencimento enquanto a Antecipação parcial reduz o seu valor base.

Para Opção Flexível com CCP, conceitualmente a Antecipação consiste em uma reversão da operação original, ou seja, nesta funcionalidade ocorrerá a revenda pelo Titular ao Lançador e recompra pelo Lançador do Titular.

As regras de prazos de Antecipação, conforme o tipo de contrato, estão definidas no Manual de Produtos de Derivativos de Balcão.

No caso de Antecipação de um registro de Duplo Comando, a mesma deverá ser informada no sistema por ambas as partes, e o confronto automático das informações (*matching*) deverá ocorrer no mesmo dia.

Caso haja divergência entre as informações fornecidas por cada Participante de Registro, a solicitação de Antecipação ficará com status pendente na tela de “Manutenção de Operações Pendentes” até que seja realizado o lançamento com as informações corretas, ou confirmação, pela parte responsável. Caso o *matching* do lançamento não ocorra no dia da Antecipação, o mesmo será rejeitado ao encerramento do sistema.

Os contratos de derivativos com CCP no geral permitem liquidação antecipada a partir de D+2 do registro até D-1 da data fixing (apuração). Essa informação também se encontra no Manual de Normas do Balcão.

Eventualmente, em casos de erro de preenchimento dos dados de Antecipação, entrar em contato imediatamente com a B3 dentro do horário limite de encerramento do sistema, através da Diretoria de Depositária e Operações de Balcão para análise.

O registro de Antecipação não deve ser realizado com o objetivo de cancelamento da operação, em função de identificação de Registro incorreto, nem deve ser combinado com o Registro de uma nova operação para refletir qualquer alteração das condições originalmente pactuadas.

### Antecipação de Swap

CCP > Contratos de Swap > Lançamentos > Antecipação de Contrato

Tela de filtro dessa funcionalidade que relaciona o contrato que será antecipado.



O Participante de Registro deve inserir o código do contrato e clicar no botão pesquisar para acessar o contrato que se deseja antecipar.

Na operação de Antecipação são informados os fatores para atualização do valor base remanescentes e valor a antecipar, cuja diferença é o último resultado financeiro do contrato. É calculado conforme as fórmulas abaixo:

- **Valor Antecipação total** = (valor base remanescente \* fator participante) - (valor base remanescente \* fator contraparte), onde valor base remanescente = valor base original decrescido das amortizações já efetuadas.

A Antecipação total é realizada quando as partes quitam a dívida original e para que isto seja refletido no Swap com CCP, é necessário que o valor vaze seja antecipado totalmente, terminando o contrato.

- **Valor Antecipação parcial** = (valor a antecipar \* fator para antecipação - participante) - (valor a antecipar \* fator para Antecipação - contraparte), onde valor a antecipar = valor informado pelo participante / contraparte que deve ser menor ou igual ao valor base remanescente do contrato e fator para Antecipação = fator de atualização do valor base a antecipar.

Antecipação de Contrato SWAP CCP			
Código do Contrato	180300212	Papel	PONTA 1
Conta Registradora (P1)	05000.00-5	Meu número	<input type="text"/>
Conta Parte	05000.00-5	Fator para Antecipação (Ponta 1)	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Código do PR Parte	500	Fator para Antecipação (Ponta 2)	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Conta SINCAD Parte	502	Valor a Antecipar	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Conta Registradora (P2)	05000.00-5	Percentual a Antecipar	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Conta Contraparte	05000.10-8	Taxa Operacional	<input type="text"/> ▼
Código do PR Contraparte	500	Valor	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Conta SINCAD Contraparte	501		
Valor Base Remanescente	100.000,00		
Data de Antecipação	11/05/2018		
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

### Descrição dos Campos da Tela de Antecipação de Contrato – Swap

Campo	Descrição
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído pelo Participante de Registro, que estiver realizando a operação de Antecipação.
Fator para Antecipação (Ponta1)	Campo de preenchimento obrigatório. Se Antecipação Total: fator para atualização do valor base remanescente, compondo o financeiro da ponta do Participante de Registro. Se Antecipação parcial: fator para atualização do valor a ser antecipado (informado no campo “Valor para Antecipação”), compondo o financeiro da ponta do Participante de Registro.  Informado com 10 (dez) inteiros e 8 (oito) casas decimais.
Fator para Antecipação (Ponta2)	Campo de preenchimento obrigatório. Se Antecipação total: fator para atualização do valor base remanescente, compondo o financeiro da ponta da Contraparte. Se Antecipação parcial: fator para atualização do valor a ser antecipado (informado no campo “Valor para Antecipação”), compondo o financeiro da ponta da Contraparte.  Informado com 10 (dez) inteiros e 8 (oito) casas decimais.
Valor a Antecipar	Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo “Percentual a antecipar”.  Valor total ou parcial a antecipar do contrato.  Informado com 17 (dezesete) inteiros e 2 (dois) decimais.
Percentual a antecipar	Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo “Valor a Antecipar”.  O Participante de Registro deve informar o percentual da operação que deseja antecipar. Este valor deve ser maior que 0%.  Informado com 10 (dez) inteiros e 6 (seis) decimais.
Taxa Operacional	Campo Opcional Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação, se aplicável. Valor meramente informativo. Opções: Percentual (será aplicado sobre o valor base remanescente); ou Valor

Valor / Percentual	<p>Campo de preenchimento obrigatório se preenchido o campo “Taxa Operacional”</p> <p>Indica o valor/percentual cobrado da operação.</p> <p>Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais.</p>
--------------------	--

Em operações de Comando Simples, ao selecionar o botão “Enviar”, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante de Registro pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão “Confirmar”, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que a operação foi realizada com sucesso.

Em operações de Duplo Comando, ao clicar no botão “Confirmar”, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o sistema está aguardando lançamento da contraparte.

## Tela de Antecipação de Contrato – SWAP

**Antecipação de Contrato SWAP CCP**

Código do Contrato 200500231  
 Conta Registradora (P1) 28824.00-0  
 Conta Parte 28824.00-0  
 Conta SMCAD Parte 802403  
 Conta Registradora (P2) 29137.00-2  
 Conta Contraparte 30048.00-1  
 Conta SMCAD Contraparte 270363  
 Valor Base Remanescente 3.000.000,00  
 Data de Antecipação 04/06/2020

Papel PONTA 1  
 Meu número 11  
 Fator para Antecipação (Ponta 1) 1.89000000  
 Fator para Antecipação (Ponta 2) 2.89000000  
 Valor a Antecipar  
 Percentual a Antecipar 100,000000  
 Valor Financeiro a Antecipar (BRL) -3.000.000,00  
 Taxa Operacional  
 Valor  
 Taxa Operacional Calculada

Resultado da Antecipação		
Ponta 1	Ponta 2	Financeiro
Valor Financeiro 5.670.000,00	Valor Financeiro 8.670.000,00	VME -3.000.000,00

Confirmar Corrigir Voltar Desistir

**Observação:** Na Tela de resultado de Antecipação de Lançamento de contrato de Swap, os campos “Valor médio a Antecipar (BRL)” e “VME (Valor Monetário Esperado)” determinam se o valor será debitado ou Creditado, quando o número vier acompanhado do sinal “-” indica que o valor será debitado, caso contrário, o valor será creditado na conta do participante.

A confirmação da contraparte pode ser feita de duas maneiras: pela própria funcionalidade de antecipação ou pela funcionalidade: “Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes”

Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes

**Manutenção de Operações Pendentes**

Parte (Conta)

Contraparte (Conta)

Tipo de Instrumento Financeiro

Código IF

Tipo de Operação

Modalidade

Situação

Meu número

Número CETIP

Pesquisar Limpar Campos Desistir

A operação aceita mediante a validação bem-sucedida pelo sistema das informações preenchidas pelo Participante de Registro (aplicável as instruções dos demais derivativos que podem ser antecipados).

### Antecipação Termo

CCP > Contratos de Termo > Lançamentos > Antecipação de Contrato

Tela de filtro dessa funcionalidade que relaciona o contrato que será antecipado.

O Participante de Registro deve inserir o código do contrato e clicar no botão “Pesquisar” para acessar o contrato que se deseja antecipar.

### Descrição dos Campos da Tela de Antecipação de Contrato – Termo

Campo	Descrição
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído pelo Participante de Registro, que estiver realizando a operação de antecipação.
Valor para Antecipação	Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo “Percentual a Antecipar”. Valor total ou parcial a antecipar do contrato. Informado com 17 (dezessete) inteiros e 2 (dois) decimais.
Percentual para Antecipação	Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo “Valor a Antecipar”. O Participante de Registro deve informar o percentual da operação que deseja antecipar. Este valor deve ser maior que 0%.

	Informado com 10 (dez) inteiros e 6 (seis) decimais.
Valor Financeiro a Antecipar (BRL)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>O Participante de Registro deve informar o resultado financeiro da Antecipação que está liquidando (em reais).</p> <p>Informado com 17 (dezesete) inteiros e 2 (dois) decimais.</p>
Visão Comprador	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Este campo deve indicar se a parte é credora ou devedora.</p> <p><b>Caixa de seleção:</b></p> <p>Débito: indicar se a parte da operação for devedora.</p> <p>Crédito: indicar se a parte da operação for credora.</p>
Taxa Operacional	<p>Campo Opcional</p> <p>Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação.</p> <p>Valor meramente informativo.</p> <p>Opções:</p> <p>Percentual (aplicado sobre o valor base remanescente); ou</p> <p>Valor</p>
Valor / Percentual	<p>Campo de preenchimento obrigatório se preenchido o campo “Taxa Operacional”</p> <p>Indica o valor/percentual cobrado da operação.</p> <p>Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais.</p>

Em operações de Comando Simples, ao selecionar o botão “Enviar”, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante de Registro pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão “Confirmar”, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que a operação foi realizada com sucesso.

Em operações de Duplo Comando, ao clicar no botão “Confirmar”, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o sistema está aguardando lançamento da contraparte.

A confirmação da contraparte pode ser feita de duas maneiras: pela própria funcionalidade de Antecipação ou pela funcionalidade: “Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes”

Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes

Somente após o confronto automático das informações a operação é realizada.

### Antecipação Opção

CCP > Contratos de Opção > Lançamentos > Antecipação de Contrato

A Antecipação da Opção Flexível com CCP consiste em uma Antecipação do vencimento original da operação, caso o resultado seja positivo para o Titular da Opção Flexível com CCP levando em conta os preços oficiais verificados na data do evento frente ao preço de Exercício da operação, conforme abaixo:

**Opção de Compra (Call)** – a cotação da Variável da Opção Flexível está acima do preço de Exercício.

**Opção de Venda (Put)** – a cotação da Variável da Opção Flexível com CCP está abaixo do preço de Exercício.

A ocorrência deste evento obriga o Lançador a honrar suas obrigações como vendedor da Opção Flexível com CCP mediante o pagamento ao Titular do contrato do valor calculado pelo sistema. O valor financeiro de Antecipação será debitado do Lançador original do contrato e creditado ao Titular original do contrato.

Para operações de Comando Simples, o Participante de Registro poderá solicitar a Antecipação, pois este representa ambas as partes da operação (Titular e Lançador).

Tela de filtro dessa funcionalidade que relaciona o contrato que será antecipado.



Antecipação de Contrato

Código do Contrato

O Participante de Registro deve inserir o código do contrato e clicar no botão “Pesquisar” para acessar o contrato que se deseja antecipar.

### Descrição dos Campos da Tela de Antecipação de Contrato – Opção Flexível com CCP

Campo	Descrição
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído pelo Participante de Registro, que estiver realizando a operação de Antecipação.
Valor para Antecipação	Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo "Percentual a Antecipar". Valor total ou parcial a antecipar do contrato. Preenchido com 10 inteiros e 2 casas decimais.
Percentual para Antecipação	Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo "Valor a Antecipar". O Participante de Registro deve informar o percentual da operação que deseja antecipar. Este valor deve ser maior que 0%. Informado com 10 (dez) inteiros e 6 (seis) decimais.
Prêmio Unitário	Campo de preenchimento obrigatório. Valor do Prêmio unitário de reversão negociado entre as partes. Informado com 15 (quinze) inteiros e 7 (sete) decimais.
Valor Prêmio da Antecipação	Valor financeiro do Prêmio calculado pelo sistema.
Taxa Operacional	Campo Opcional Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação. Valor meramente informativo. Opções: Percentual (aplicado sobre o valor base remanescente); ou Valor
Valor / Percentual	Campo de preenchimento obrigatório se preenchido o campo "Taxa Operacional" Indica o valor/percentual cobrado da operação. Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais.

Em operações de Comando Simples, ao selecionar o botão “Enviar”, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante de Registro pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão “Confirmar”, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que a operação foi realizada com sucesso.

Em operações de Duplo Comando, ao clicar no botão “Confirmar”, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o sistema está aguardando lançamento da contraparte.

A confirmação da contraparte deve ser feita pela própria funcionalidade de Antecipação.

Somente após o confronto automático das informações a operação é realizada.

A operação de Antecipação também pode ser realizada via arquivo txt. vide item “Registro e Operações por Arquivo” neste manual.

Mencionar a possibilidade de antecipação por arquivo nos demais derivativos também, pois está disponível.

### **3.7 Anulação de Registro**

A anulação de Registro tem como objetivo o cancelamento do contrato por motivo de erro de operacional, situações de Registro em duplicidade, ocorrências justificadas por erro operacional do Participante de Registro e em último caso, não aceitação do registro por decisão da B3. A anulação do Registro só pode ser efetuada no mesmo dia do registro (T+0) pelo Participante de Registro.

A operação de anulação de Registro não deve ser realizada com o objetivo de Antecipação total, vencimento antecipado do contrato ou em função de cláusulas combinadas em documento assinado entre os envolvidos, nem ser combinado com o Registro de um novo contrato para refletir qualquer alteração das condições originalmente pactuadas.

Caso a operação seja de Duplo Comando, a solicitação de anulação deve ser realizada por AMBAS as partes da operação.

Menu Operações > Lançamentos > Cancelamento de Operação

Esta função também está disponível por arquivo, o leiaute do arquivo está disponível no manual Enviar arquivo, dentro do Capítulo > Derivativos com CCP, o leiaute do arquivo para cancelamento de Swap e Termo é o mesmo, já para Opções temos um modelo único.

[http://www.b3.com.br/pt\\_br/produtos-e-servicos/registro/derivativos-de-balcao/opcoes-flexiveis.htm](http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/registro/derivativos-de-balcao/opcoes-flexiveis.htm)

#### **Visão Geral**

Esta função permite ao Participante de Registro anular um contrato de derivativo com CCP.

### Descrição dos Campos da Tela Cancelamento de Operações – Derivativos com CCP

Campo	Descrição
Participante	Campo de preenchimento obrigatório. Código da Conta Cetip que identifica o membro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, anulando o contrato.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído pelo Participante de Registro, que estiver realizando a operação de anulação.
Num. Cetip Op. Original	Campo de preenchimento obrigatório. Número da operação gerado pelo sistema.
Instrumento Financeiro	Campo de preenchimento obrigatório. Número do instrumento financeiro, gerado no momento do registro.
Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Código da Conta Cetip da contraparte envolvido na operação.

### 3.8 Cancelamento de Antecipação

O cancelamento de operações como Antecipação podem ser efetuados no mesmo dia do evento realizado (T+0). Se a operação for de Duplo Comando, AMBAS as partes precisam realizar o cancelamento do evento realizado.

Menu Operações > Lançamentos > Cancelamento de Operação

#### Visão Geral

Esta função permite ao Participante de Registro cancelar uma Antecipação de um contrato de derivativo com CCP.

**Descrição dos Campos da Tela Cancelamento de Antecipação – Derivativos com CCP**

<b>Campo</b>	<b>Descrição</b>
Participante	Campo de preenchimento obrigatório. Código da Conta Cetip que identifica o membro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, cancelando a Antecipação.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído pelo Participante de Registro, que estiver realizando a operação de cancelamento de Antecipação.
Num. Cetip Op. Original	Campo de preenchimento obrigatório. Número da operação de registro gerado pelo sistema.
Instrumento Financeiro	Campo de preenchimento obrigatório. Número do instrumento financeiro gerado no momento do registro.
Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta Cetip da contraparte envolvido na operação.

Após o cancelamento da Antecipação o Participante de Registro não pode solicitar o estorno. Operações canceladas não podem ser reativadas.

**3.9 Exclusão de Contrato**

Funcionalidade disponível apenas para usuários internos com a finalidade de excluir contratos a partir de D+1 do registro até D-1 da data de apuração (fixing), mediante envio de carta pelo participante devidamente assinada.

A exclusão do contrato não gera estorno de valores financeiro da operação já liquidados até a data da exclusão.

**3.10 Transferência de Conta e Posição**

A operação de transferência promove a transferência de uma operação de uma conta de cliente para outra de cliente sob o mesmo Participante de Registro ou a transferência da operação de um Participante de Registro para outro Participante de Registro, mediante prévia análise da B3 sobre justificativas apresentadas.

O Participante de Registro deverá encaminhar à Diretoria de Depositária e Operações de Balcão da B3 o pedido de transferência de posição por escrito, assinado pelo(s) representante(s) indicado(s) no ato da habilitação de acesso e enviar através do e-mail: [op.derivativosbalcao@b3.com.br](mailto:op.derivativosbalcao@b3.com.br), identificando os dados da operação e sua justificativa.

A transferência de posição contratual referente ao Derivativos com CCP está sujeita à análise e critérios das áreas de risco e garantias da B3 conforme Manual de Administração de Risco da Câmara de Compensação e Liquidação.

Qualquer pedido de transferência só será realizado se estiver com as assinaturas (no mínimo 2), de acordo com o cartão de assinaturas da base de cadastro – segmento BM&FBOBESPA e tiver

seu envio **até 12hr** (pedidos recebidos após esse horário estão sujeitos à análise e realização somente no dia útil posterior).

A transferência pode ser feita a partir de D+1 da Data de Negociação até D-1 da Data da Apuração do contrato. Esse evento é realizado somente pela B3.

### 3.11 Cessão de Direito

A cessão de direito representa a transferência de determinada operação de um Participante de Registro para outro Participante de Registro mediante pagamento de valor acordado entre as partes válida somente para o contrato de Swap com CCP em que envolva troca de financeira entre as partes, mediante análise da B3 das justificativas apresentadas.

O Participante de Registro deverá encaminhar à Diretoria de Depositária e Operações de Balcão da B3 o pedido de transferência de posição por escrito, assinado pelo(s) representante(s) indicado(s) no ato da habilitação de acesso e enviar através do e-mail: [op.derivativosbalcao@b3.com.br](mailto:op.derivativosbalcao@b3.com.br), identificando os dados da operação e sua justificativa.

A cessão de direitos de um contrato de Swap com CCP está sujeita à análise e critérios das áreas de risco e garantias da B3 conforme Manual de Administração de Risco da Câmara de Compensação e Liquidação.

Qualquer pedido de cessão só será realizado se estiver com as assinaturas (no mínimo 2), de acordo com o cartão de assinaturas da base de cadastro – segmento BM&FBOBESPA e tiver sido enviado **até 12hr** (pedidos recebidos após esse horário estão sujeitos à análise e realização somente no dia útil posterior).

A cessão de Direito pode ser feita a partir de D+1 da data de negociação até D-1 do vencimento.

### 3.12 Brokeragem

A *brokeragem* é uma função na qual o Participante de Registro intermedia operações de contrato de Swap com CCP. Consiste em selecionar operações de contrato de Swap com CCP no qual a conta própria do Participante de Registro esteja em uma operação comprado em uma Variável e na outra operação esteja vendido na mesma Variável, assim o Participante de Registro pode “marcar” as duas operações para que seja formada a operação “Broker”. As operações “Broker” dão desconto ao Participante de Registro nos emolumentos cobrados no registro, permanência e Antecipação das operações, conforme política de tarifação divulgada pela B3.

Para caracterizar uma operação “Broker” as operações devem atender as características abaixo:

- As operações/contratos devem ter garantia da B3 na parte e contraparte;
- As operações/contratos devem ter sido registradas no mesmo dia;
- As operações têm que ser do mesmo PR/Conta;

- Conta própria do Participante de Registro deve figurar como uma das partes na operação/contrato;
- As operações devem ter as mesmas Variáveis;
- A conta própria do Participante de Registro deve assumir posições inversas nas variáveis das operações;
- Devem ter as mesmas características para os campos:
  - Data do Registro;
  - Data de vencimento;
  - Data de início;
  - Variáveis/Tipo de Contrato;
  - Valor Base.

No caso de um Duplo Comando, uma operação de contrato de Swap com CCP poderá estar associada a dois brokers, um de cada curva. Esse cenário ocorre quando cada uma das curvas estiver relacionada a uma conta própria de brokers diferentes.

O acesso à função de *brokeragem* será através do arquivo txt (leiaute disponível no site da B3):

### Inclusão de Brokeragem

Transferência de Arquivo > Arquivo > Enviar Arquivo

Esta função permite ao Participante incluir um broker nos contratos de derivativos com CCP.

A inclusão é feita apenas por arquivo “.txt”.

Após fazer o upload do arquivo é possível consultar se essa solicitação foi processada e se não houve nenhum erro, nos menus “Solicitação de Transferência” e “Erros em Arquivos”, respectivamente, e cujas rotas de acesso estão descritas a seguir neste documento.

Após o processamento da solicitação sem erros, as operações serão enviadas para análise do sistema, porém o “Broker” será criado definitivamente através de batch noturno, enquanto isso ele permanece com a situação ‘Solicitado’. Isso acontece, pois, as operações associadas a ele possuirão status provisório até que sejam avaliadas e conduzidas para um status definitivo (‘Contrato em Aberto’ e/ou ‘Rejeitada’, conforme o caso) no processamento do batch noturno.

### Anulação de Brokeragem

A anulação do broker consiste em cancelar/desistir da operação realizada, poderá ser realizado apenas via tela e após a efetivação da *brokeragem* (somente na mesma data do Registro/indicação de *brokeragem*). A tela será apresentada e o Participante de Registro deverá preencher os dados solicitados.



CCP > Contrato de Swap > Lançamentos > Anulação de Broker

**Anulação de Brokeragem**

Número Broker

Após o preenchimento da informação o sistema irá realizar a operação solicitada. Antes de realizar a anulação de um Registro que foi brokerado, é necessário a anulação da brokeragem.

### Consulta de Brokeragem

Com a consulta de operações *brokeradas* será possível pesquisar todas as solicitações de broker que o Participante de Registro solicitou. Para isso, ocorrer, o Participante de Registro deverá acessar por meio do menu CCP > Contrato de Swap > Consultas > Broker e preencher os dados solicitados abaixo:



CCP > Contrato de Swap > Consultas > Broker

**Filtro Consulta Broker**

Conta PR Parte

Conta SINCAD Parte

Variável1  ▾

Variável2  ▾

Data de Vencimento  /  /

Número Broker

Conta Registradora  -  -

Ao clicar em “Pesquisar” o sistema trará uma tela de relação com todas as operações “Broker” que atendam aos campos do filtro acima:

CCP > Contrato de Swap > Consultas > Broker HOMOLOGAÇÃO

**Consulta Broker**

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)  
Data e Hora da Consulta: 08/01/2019 - 17:17:35

**Critério de pesquisa**

Número Broker	Variável 1	Variável 2	Data de Vencimento	Conta PR Parte	Conta SINCAD Parte
901.100002	DÓLAR FECHAMENTO VENDA	PREFIXADO 252D	23/01/2019	90300	1

Ao clicar no número do *Broker* o sistema irá mostrar um detalhamento da operação selecionada:

**Consulta Detalhada Broker**

Número Broker 901.100002  
Variável 1 PREFIXADO 252D  
Variável 2 DÓLAR FECHAMENTO VENDA  
Conta PR 90300  
Conta SINCAD Parte 1  
Conta 03448.00-9  
Data de Vencimento 23/01/2019

Variável 1		Variável 2	
Código IF	Valor Base	Código IF	Valor Base
901636568	1.500.000,00	901636576	1.500.000,00
Subtotal 1.500.000,00		Subtotal 1.500.000,00	

### 3.13 Registro e operações por arquivo

#### Enviar arquivo

O Registro, a Antecipação e a inclusão de *brokeragem* também podem ser realizados por arquivo no formato “.txt”. Para acessar a tela de upload deve-se selecionar o menu:

Transferência de Arquivo > Arquivo > Enviar Arquivo

O sistema abrirá a tela abaixo e o arquivo poderá ser carregado clicando em “Escolher arquivo”.

Transf.de Arquivo > Arquivo > Enviar Arquivos

**Enviar Arquivos**

Arquivo:  Nenhum arquivo selecionado

Data e Hora	Arquivo	Status da Transferência
0	arquivo(s) transferido(s) nesta sessão	

\*\*\* Cada arquivo possui uma limitação de 70 megabytes.

Uma vez selecionado o arquivo, o Participante de Registro deverá clicar em “Transferir” para realizar o carregamento dos arquivos no sistema.

O sistema apresentará uma mensagem indicando se o upload do arquivo ocorreu com sucesso ou se apresenta erro, se o resultado for “com sucesso” o sistema fornecerá o ID da respectiva solicitação.

#### Solicitação de transferência de arquivo

Após fazer o upload do arquivo é possível consultar se essa solicitação foi processada pelo menu Transferência de Arquivo > Arquivo > Solicitações de Transferência.

## Tela de Filtro

Solicitações de Transferência

Participante (Nome Simplificado)

Nome da Família

Tipo de Família

Usuário

Sistema

Data da Solicitação  /  /  -  /  /

Data de Processamento do Arquivo  /  /  -  /  /

ID da Solicitação

## Erros em Arquivo

Caso tenha ocorrido algum problema com o processamento, é possível consultar o erro no menu Transferência de Arquivo > Arquivo > Erros em Arquivos.

## Tela de Filtro

Erros em Arquivos

Nome do Arquivo:

ID da Solicitação:

Data da Solicitação:  /  /

Essa funcionalidade não permite alteração ou exclusão do lançamento. O Participante de Registro deverá retransmitir novo arquivo com as operações que não foram aceitas, após as devidas correções nas informações.

Para o devido preenchimento da variável e indexador na geração do arquivo de registro dos contratos de Opções, Swap e Termo, utilizar o de/ apresentado no arquivo “IndexadoresCCP”, que é gerado diariamente e pode ser obtido pela funcionalidade “Transf. de Arquivo > Arquivo > Arquivos Públicos”.

## 4 CONSULTA

### 4.1 Características de Contratos de Swap

Menu CCP > Contrato de Swap > Consultas > Características de Contrato de Swap

#### Visão Geral

O Participante de Registro pode consultar as características de um contrato de Swap com CCP em que apareça em uma das pontas.

Caso o Participante de Registro não preencha o filtro “Parte” ou “Conta”, são apresentados, conforme as informações fornecidas na tela de filtro, todos os contratos por ele registrados (incluindo os vencidos em até D-5),

Observação: Caso o resultado da consulta ultrapasse o limite de linhas possíveis de apresentação como resultado desta pesquisa, o arquivo será disponibilizado, observado e decorrido o tempo necessário para sua geração, em consulta ao participante no módulo de “Transferência de Arquivos”, opção “Receber Arquivos”.

**Consulta de Contratos SWAP CCP**

Conta Parte  -  -

Código do PR Parte

Conta SINCAD Parte

Conta Registradora  -  -

Conta Contraparte  -  -

Código do PR Contraparte

Conta SINCAD Contraparte

Conta Registradora  -  -

Código do Contrato

Situação do Contrato

Variável1

Variável2

Contrato - Data de Registro  -

Contrato - Data de Vencimento  -

O Participante de Registro deve preencher pelo menos um campo da tela e clicar no botão “Pesquisar”.

#### Tela de Relação

Consulta de Contratos SWAP CCP												PARTE			
Código do Contrato	Situação Contrato	Tipo do Contrato	Número Broker	Data Registro	Data Alteração	Valor Base	Data Início	Data Vencimento	Valor Base Atual	Valor a Antecipar	Valor Base Remanescente	Conta Registradora	Parte	Código do PR Parte	Conta SINCAD Parte
181200610	CONTRATO EM ABERTO	PAGAMENTO FINAL		26/12/2018		100.000,00	26/12/2018	02/01/2019	100.000,00	0,00	100.000,00	03448.00-9	03448.00-9	90300	2

(continua)

CPF/CNPJ Cliente Parte	Nome Simplificado (Parte)	Garantia Parte	Taxa Operacional	Valor Operacional	Nº de Controle do PR	Ponta	Percentual do indexador	Indexador	Data Atualizacao	PU Inicial	PU Atual	Fator de Juros	Fator de Correção	Valor Juros	Diferença Juros
	BALCAOBM	COM			TESTEFERIADO	P1	100,00	PREFIXADO 252D	28/12/2018			1,000756716	1,000000000	75,67	26,43

(continua)

CONTRAPARTE															
Valor Amortização	Diferença Amortização	Valor da Curva Atualizado	Diferença da Curva	Conta Registradora	Contraparte	Código do PR Contraparte	Conta SINCAD Contraparte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Nome Simplificado (Contraparte)	Garantia Contraparte	Taxa Operacional	Valor Operacional	Nº de Controle do PR	Ponta	Percentual do Indexador
0,00	0,00	100.075,67	26,43	03448.00-9	03448.10-2	90300		4.44.753.867/0001-93	BALCAOBM	COM			TESTEFERIADO P2		100,00

(continua)

Indexador	Data Atualização	PU Inicial	PU Atual	Fator de Juros	Fator de Correção	Valor Juros	Diferença Juros	Valor Amortização	Diferença Amortização	Valor da Curva Atualizado	Diferença da Curva
DI	28/12/2018			1,000492460	1,000000000	49,24	-26,43	0,00	0,00	100.049,24	-26,43

(fim)

Após clicar no link do código de instrumento financeiro, é exibida, apenas para consulta de informações, a própria tela de Registro de Contrato.

### Descrição dos Campos da Tela de Relação

Campo	Descrição
Código do Contrato	Código do contrato pesquisado.
Situação Contrato	Indica a situação em que se encontra o contrato a ser pesquisado. Opções: aprovado, em aberto, anulado, cancelado, antecipado total e vencido.
Tipo do Contrato	Tipo de contrato utilizado na operação de Swap.
Número Broker	Indica o número do Broker caso o contrato tenha.
Data de Registro	Data de registro do contrato pesquisado.
Dt. Alteração	Data de alteração do contrato pesquisado.
Valor Base	Valor Base inicial da operação a partir do qual os parâmetros definidos para o contrato ou para a correção das operações a termo irão incidir.
Dt. Início	Data de início da vigência do contrato.
Dt. Vencimento	Data de vencimento do contrato.
Valor Base Atual	Valor base atualizado.
Valor a Antecipar	Valor que já foi amortizado do contrato.
Valor Base Remanescente	Valor base restante do contrato.
<b>PARTE</b>	
Conta Registradora	Conta Cetip do Participante da Parte do contrato.
Parte	Número da conta do Participante.
Código do PR Parte	Código do Participante de Registro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, consultando o contrato.
Conta SINCAD Parte	Código da conta SINCAD do cliente de quem está consultando o contrato.
CPF/CNPJ Cliente Parte	Documento do cliente de quem está consultando o contrato.
Nome Simplificado (Parte)	Nome simplificado do Participante de Registro.
Garantia Parte	Opções "COM" e "SEM", que indicam a existência ou não de garantia.
Taxa Operacional	Taxa operacional informada no Registro, se houver.

Valor Operacional	Opções “Valor” ou “Percentual” caso tenha sido cobrada uma taxa operacional no Registro do contrato.
N de Controle do PR	Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato.
Ponta	Indica as pontas envolvidas no contrato. A conta de menor número na operação é denominada Ponta 1 (P1) e a conta de maior número, Ponta 2 (P2).
Percentual do Indexador (Parte)	Percentual do indexador escolhido.
Indexador (Parte)	Parâmetro através do qual a curva do Participante de Registro é atualizada.
Dt Atualização (Parte)	Data para a qual a curva se encontra atualizada.
PU Inicial (Parte)	Preço unitário inicial informado pelo Participante de Registro no Registro do contrato.
PU Atual (Parte)	Preço unitário atual informado pelo Participante de Registro no período de vigência do contrato.
Fator de Juros (Parte)	Fator de juros calculado a partir das características informadas no Registro do contrato.
Fator de Correção (Parte)	Fator de correção cambial calculado a partir das características informadas no Registro do contrato.
Valor Juros (Parte)	Valor de juros calculado a partir do fator de juros. (Valor informativo, sem financeiro)
Diferença Juros (Parte)	Diferença entre o valor de juros da parte e o valor de juros da contraparte.
Valor Amortização (Parte)	Valor meramente contábil e informativo, não gera financeiro. Este é gerado pela informação do campo Diferença de amortização.
Diferença Amortização (Parte)	Diferença entre o valor de amortização da parte e o valor de amortização da contraparte.
Valor da Curva Atualizado (Parte)	Valor da curva atualizado calculado através da multiplicação do valor base inicial ou remanescente, fator de juros e fator de correção. (valor informativo, sem financeiro).
Diferença da Curva (Parte)	Diferença entre o valor da curva atualizado da parte e o valor da curva atualizado da contraparte. (valor informativo, sem financeiro).
<b>CONTRAPARTE</b>	
Conta Registradora	Conta Cetip do Participante de Registro da Contraparte do contrato.
Contraparte	Número da conta do Participante de Registro.
Código do PR Contraparte	Código do Participante de Registro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, consultando o contrato.
Conta SINCAD Contraparte	Código da Conta SINCAD do cliente de quem está consultando o contrato.
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Documento do cliente de quem está consultando o contrato.
Nome Simplificado (Contraparte)	Nome simplificado do Participante de Registro.
Garantia Contraparte	Opções “COM” e “SEM”, que indicam a existência ou não de garantia.
Taxa Operacional	Taxa operacional informada no Registro, se houver.

Valor Operacional	Opções “Valor” ou “Percentual” caso tenha sido cobrada uma taxa operacional no Registro do contrato.
N de Controle do PR	Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato.
Ponta	Indica as pontas envolvidas no contrato. A conta de menor número na operação é denominada Ponta 1 (P1) e a conta de maior número, Ponta 2 (P2).
Percentual do Indexador (Contraparte)	Percentual do indexador escolhido.
Indexador (Contraparte)	Parâmetro através do qual a curva do Participante é atualizada.
Dt Atualização (Contraparte)	Data para a qual a curva se encontra atualizada.
PU Inicial (Contraparte)	Preço unitário inicial informado pelo Participante de Registro no Registro do contrato.
PU Atual (Contraparte)	Preço unitário atual informado pelo Participante de Registro no período de vigência do contrato.
Fator de Juros (Contraparte)	Fator de juros calculado a partir das características informadas no Registro do contrato.
Fator de Correção (Contraparte)	Fator de correção calculado a partir das características informadas no Registro do contrato.
Valor Juros (Contraparte)	Valor de juros calculado a partir do fator de juros. (valor informativo, sem financeiro)
Diferença Juros (Contraparte)	Diferença entre o valor de juros da parte e o valor de juros da contraparte.
Valor Amortização (Contraparte)	Valor meramente contábil e informativo, não gera financeiro. Este é gerado pela informação do campo “Diferença de amortização”.
Diferença Amortização (Contraparte)	Diferença entre o valor de amortização da parte e o valor de amortização da contraparte.
Valor da Curva Atualizado (Contraparte)	Valor da curva Atualizado calculado através da multiplicação do valor base inicial ou remanescente, fator de juros e fator de correção. (Valor informativo, sem financeiro).
Diferença da Curva (Contraparte)	Diferença entre o valor da curva atualizado da parte e o valor da curva atualizado da contraparte. (Valor informativo, sem financeiro).

## 4.2 Características de Contratos de Opção

Menu CCP > Contrato de Opção > Consultas > Características de Contrato de Opção

### Visão Geral

Esta função permite a consulta das características de um Contrato de Opção Flexível com CCP. É necessário que ao menos um dos campos seja preenchido. Caso o Participante de Registro não preencha o filtro Lançador ou Titular, são apresentados, conforme as informações fornecidas na tela de filtro, todos os contratos por ele registrados (incluindo os vencidos e/ou antecipados até D-5), sendo o próprio necessariamente uma das pontas.

**Características de Contratos**

Conta Registrador:  -  -

Conta:  -  -

Conta SINCAD:

Código do PR:

Código do Contrato:

Tipo de Contrato:

Situação do Contrato:

Variável:

Contrato - Data de Registro:  /  /  a  /  /

Contrato - Data de Vencimento:  /  /  a  /  /

Data Fixing:  /  /

Situação da Barreira KI:

Situação da Barreira KO:

Na tela de resultado é exibido link que, uma vez acionado, leva ao detalhamento das características do contrato de Opção Flexível com CCP da respectiva linha. A tela de detalhes do contrato mostra a situação do contrato no momento da consulta.

### Tela de Relação

**Características de Contratos**  
Página 1 de 25 (Linhas 1 a 25 de 633)  
Data e Hora da Consulta: 09/03/2020 - 10:43:02

**Critério de pesquisa**

Instrumento Financeiro	Tipo do Contrato	Tipo da Opção	Lançador (Nome Simplificado)	Lançador (Parte Registradora)	Lançador (Código do PR)	Lançador (Conta SINCAD Parte)	Lançador (CPF/CNPJ Lançador)	Lançador (Nº de Controle do PR)	Titular (Nome Simplificado)	Titular (Contraparte Registradora)	Titular (Código do PR)
192000202	COMPRA	FCI	BALCADBM	03448 00-9	90300	19123	199.732.187-00	---	XPIVESTCOR	28224 00-0	90300
192700223	COMPRA	FCI	BALCADBM	03448 00-9	90300	99999	---	---	BALCADBM	03448 00-9	90300

(continua)

Titular (Conta SINCAD Contraparte)	Titular (CPF/CNPJ Titular)	Titular (Nº de Controle do PR)	Data de Registro	Data de Vencimento	Tipo de Preço	Data Fixing	Valor Base/Quantidade	Valor Base/Quantidade Atual	Bolém Opção	Prêmio Unitário	Data de Pagamento do Prêmio	Preço Exercício	Tipo Opção	Rebate Unitário	N Data
803137	---	---	04/06/2019	04/01/2021	ULTIMO	04/01/2021	50.000,00	50.000,00	Fechamento	1,53	05/06/2019	101.071.504	EUROPEIA	---	---
88547	04.277.496/0001-60	---	05/07/2019	05/07/2021	ULTIMO	05/07/2021	1.000,00	1.000,00	Fechamento	1,00	08/07/2019	190.000,00	EUROPEIA	---	---

(continua)

Rebate Unitário	N Dias Apuração	Barreira KI	Valor Barreira KI	Situação Barreira KI	Barreira KO	Valor Barreira KO	Situação Barreira KO	Limitador	Monitoramento de Barreiras	Tipo Indicador	Variável	Situação
---	1,00	---	---	---	---	---	---	109.002.50928	---	INDICE	IBOVESPA	CONTRATO EM ABERTO
---	1,00	---	---	---	---	---	---	---	---	PARIDADE	BOVA11	ANTECIPADO TOTAL

(fim)

Após clicar no link do código de instrumento financeiro, é exibida, apenas para consulta de informações, a própria tela de Registro de Contrato.

### Descrição dos Campos da Tela de Relação

Campo	Descrição
Instrumento Financeiro	Código do contrato pesquisado.
Tipo do Contrato	Tipo de contrato utilizado na operação de Swap com CCP.
Tipo de Opção	<b>Americana:</b> opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício. <b>Europeia:</b> opções que só podem ser exercidas na data de exercício. Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática

Lançador (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante de Registro.
Lançador (Parte Registradora)	Conta Cetip do Participante de Registro da Parte do contrato.
Lançador (Código do PR)	Código do Participante de Registro que está acessando o sistema e, consequentemente, consultando o contrato.
Lançador (Conta SINCAD Parte)	Código da Conta SINCAD do cliente de quem está consultando o contrato.
Lançador (CPF/CNPJ Lançador)	CPF/CNPJ do Lançador do contrato.
Lançador (N de Controle do PR)	Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato.
Titular (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante de Registro.
Titular (Contraparte Registradora)	Conta Cetip do Participante de Registro da Contraparte do contrato.
Titular (Código do PR)	Código do Participante de Registro que está acessando o sistema e, consequentemente, consultando o contrato.
Titular (Conta SINCAD Contraparte)	Código da conta SINCAD do cliente de quem está consultando o contrato.
Titular (CPF/CNPJ Titular)	CPF/CNPJ do Titular do contrato.
Titular (Nº de Controle do PR)	Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato.
Dt. de Registro	Data de Registro do contrato pesquisado.
Dt. Vencimento	Data de vencimento do contrato.
Tipo de Preço	Indica o tipo de preço da Opção Flexível, conforme especificação da Tabela Auxiliar. Opções: Último Médio
Data Fixing	Data de observação do preço da variável, conforme especificação da Tabela Auxiliar. Opções: T-0 T-1 T-2
Valor Base/Quantidade	Quantidade da opção a ser negociada.
Valo Base/Quantidade Atual	Quantidade da opção negociada ainda vigente em contrato.
Boletim Opção	Boletim utilizado para cotação da Opção
Prêmio Unitário	Prêmio unitário acordado entre as partes
Date de Pagamento do Prêmio	Indica a data de liquidação financeira do prêmio, nos contratos com garantia a data do pagamento sempre será D+1 do registro
Preço Exercício	Valor da taxa de câmbio ou preço da Ação/Índice contratado entre Titular e Lançador para o exercício da opção.
Tipo de Opção	Indica o tipo de Opção Flexível com CCP.
Rebate Unitário	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate.  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.
N Dias Apuração	Caso o tipo preço seja “médio”, este campo indica o número de verificações de preço para apuração no vencimento ou Antecipação, a contar da Data de Fixing.
Barreira KI	a condição previamente estabelecida pelas partes da opção para que a operação produza efeitos; in-and-up (IU): quando a taxa, o preço, o valor ou a cotação vigente na data de negociação, está abaixo do valor da barreira;  in-and-down (ID): quando a taxa, o preço, o valor ou a cotação, vigente na data de negociação, está acima do valor da barreira;
Valor Barreira KI	Indica o valor da barreira Knock In
Situação Barreira KI	Status da Barreira (KO Atingido ou Não Atingido).

Barreira KO	a condição previamente estabelecida entre as partes da opção, mediante pagamento de prêmio, para que a operação seja rescindida, disponibilizada para Registro, nos seguintes tipos: i. out-and-up (OU): quando a taxa, o preço, o valor ou a cotação, vigente na data de negociação, está abaixo do valor da barreira; ii. out-and-down (OD): quando a taxa, o preço, o valor ou a cotação, vigente na data de negociação, está acima do valor da barreira.
Valor Barreira KO	Indica o valor da barreira Knock Out
Situação Barreira KO	Status da Barreira (KO Atingido ou Não Atingido).
Limitador	limitador de alta – a taxa, o preço ou a cotação, previamente estabelecido(a) pelas partes de opção de compra, a ser utilizado(a) no cálculo do valor de exercício quando a taxa, o preço ou a cotação de referência (“fixing”) vigente na ocasião do exercício da opção for superior a ele(a); e b) limitador de baixa - a taxa, o preço ou a cotação, previamente pactuado(a) pelas partes de opção de venda, a ser utilizado(a) no cálculo do valor de exercício quando a taxa, o preço ou a cotação de referência (“fixing”) vigente na ocasião do exercício da opção for inferior a ele(a);
Monitoramento de Barreiras	Indica o modo como será o monitoramento das barreiras. Para as Ações, Índices e ETFs: Discreta ou Contínua
Tipo de Indicador	Informar o tipo de indicador: PARIDADE, AÇÕES NACIONAIS, ÍNDICES, ÍNDICES INTERNACIONAIS OU MERCADORIA.
Variável	Indica os tipos de Variável relacionados ao “Tipo Indicador” selecionado na primeira tela de registro. Combo box
Situação Contrato	Indica a situação em que se encontra o contrato a ser pesquisado. Opções: anulado, aprovado, cancelado, contrato em aberto, contrato exercido, contrato não exercido, knock out sem rebate, liquidado por exercício antecipado, liquidado por rebate e opção vencida.

### 4.3 Características de Contratos de Termo com CCP

Menu CCP > Contrato de Termo > Consultas > Características de Contrato de Termo

#### Visão Geral

Exibe os contratos efetuados pelo Participante de Registro, com as respectivas datas de vencimento e de Registro.

**Consulta Contratos**

Comprador (Conta Registradora)

Comprador (Conta)

Comprador (Código PR)

Comprador (Conta SINCAD)

Vendedor (Conta Registradora)

Vendedor (Conta)

Vendedor (Código PR)

Vendedor (Conta SINCAD)

Data de Início

Data de Vencimento

Situação

Código do Contrato

Ao clicar no botão “**PESQUISAR**”, é apresentada tela de relação.

#### Tela de Relação

Código do Contrato	Tipo Inst. Financeiro	Comprador (Nome Simplificado)	Comprador (Conta Registradora)	Comprador (Conta)	Comprador (Código PR)	Comprador (Conta SINCAD)	CPI/CNPJ Comprador	Comprador (IP de Controle do PR)	Vendedor (Nome Simplificado)	Vendedor (Conta Registradora)	Vendedor (Conta)	Vendedor (Código PR)	Vendedor (Conta SINCAD)	CPI/CNPJ Vendedor	Vendedor (IP de Controle do PR)	Data de Registro	Data de Vencimento	Saldo (R\$)	Situação
180509013	TERMO DE MOEDA CCP	JONATHANBM	03219-00-1	03219-00-1	510	530	EEE	JONATHANBM	03219-00-1	03219-10-4	510	511	907.854.321-00	EEE	02/05/2018	07/05/2018	0,00	APROVADO	

(continua)

Data Fixing	Valor Base	Valor Base Remanescente	Moeda Base(Referência)	Moeda Cotada	Taxa a Termo	Boletim - Moeda Base	Tipo Contrato	Valor Cotação
14/12/2020	12.000,00	12.000,00	USD ( 220 ) - DOLAR DOS EUA	BRL ( 790 ) - REAL	4,00000000	PTAX800 de Fechamento	TMC	5,2889000000

(fim)

Na tela de relação, a primeira coluna (contrato) identifica o número do contrato. Ao ser selecionado, exibe as características do contrato.

#### Descrição dos Campos da Tela Relação

Campo	Descrição
Código do Contrato	Código do contrato pesquisado.
Tipo Inst. Financeiro	Indica o tipo de Termo.
Comprador (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante de Registro.
Comprador (Parte Registradora)	Conta Cetip do Participante de Registro da Parte do contrato.

Comprador (Código do PR)	Código do Participante de Registro que representa o Comprador do contrato.
Comprador (Conta SINCAD Parte)	Código da conta SINCAD do Comprador do contrato.
Comprador (CPF/CNPJ Comprador)	CPF/CNPJ do Comprador do contrato.
Comprador (N de Controle do PR)	Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato.
Vendedor (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Vendedor do contrato.
Vendedor (Contraparte Registradora)	Conta Cetip do Participante de Registro da Contraparte do contrato.
Vendedor (Código do PR)	Código do Participante de Registro que representa o Vendedor do contrato.
Vendedor (Conta SINCAD Contraparte)	Código da conta SINCAD do Vendedor do contrato.
Vendedor (CPF/CNPJ Vendedor)	CPF/CNPJ do Vendedor do contrato.
Vendedor (N de Controle do PR)	Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato.
Data de Registro	Data de Registro do contrato pesquisado.
Dt. Vencimento	Data de vencimento do contrato.
Situação Contrato	Indica a situação em que se encontra o contrato a ser pesquisado. Opções: contrato em aberto, anulado, cancelado, vencido e aprovado.

#### 4.4 Manutenção de Operações Pendentes

Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes

##### Visão Geral

Os lançamentos realizados no módulo de Swap e Termo com CCP podem ser consultados através da funcionalidade descrita abaixo. Para o Registro de Swap e Termo com CCP com Duplo Comando, a confirmação da operação pode ser realizada por meio da confirmação do lançamento, por meio dessa funcionalidade.

Serão apresentados os contratos que atendam a pesquisa de acordo com o preenchimento de filtros da tela de pesquisa:

A imagem mostra a interface de pesquisa 'Manutenção de Operações Pendentes'. O formulário contém os seguintes campos:

- Parte (Conta): campo de texto com máscara de entrada.
- Contraparte (Conta): campo de texto com máscara de entrada.
- Tipo de Instrumento Financeiro: menu suspenso.
- Código IF: campo de texto.
- Tipo de Operação: menu suspenso.
- Modalidade: menu suspenso.
- Situação: menu suspenso.
- Meu número: campo de texto.
- Número CETIP: campo de texto.

Na base do formulário, há três botões: 'Pesquisar', 'Limpar Campos' e 'Desistir'.

Após realizada a pesquisa, o sistema exibirá uma tela de relação, conforme abaixo.

## Tela de Relação

Manutenção de Operações Pendentes													
Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 1 de 1 )													
Data e Hora da Consulta: 04/01/2019 - 11:18:16													
<b>i</b> Critério de pesquisa													
Ação	Parte (Conta)	Contraparte (Conta)	Tipo de Instrumento Financeiro	Código IF	Número CETIP	Meu número	Tipo de Operação	Ponta na Operação	Situação	Modalidade	Rentabilidade/Indexador/Taxa Flutuante	% da Taxa Flutuante	Taxa de Juros/Spread
	03454.00-0	05000.00-5	TCCP	190100002	2019010417873784	7875	REGISTRO	COMPRADOR	PENDE	SEM MODALIDADE CCP			

Para o Participante de Registro que lançou a operação ao clicar em campo “Ação”, é possível cancelar a operação (CANCELAR) e verificar as informações inseridas no momento do registro (DETALHAR) conforme imagem abaixo:

Manutenção de Operação Pendente													
Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 1 de 1 )													
Data e Hora da Consulta: 04/01/2019 - 11:20:50													
<b>i</b> Critério de pesquisa													
Ação	Parte (Conta)	Contraparte (Conta)	Tipo de Instrumento Financeiro	Código IF	Número CETIP	Meu número	Tipo de Operação	Ponta na Operação	Situação	Modalidade	Rentabilidade/Indexador/Taxa Flutuante	% da Taxa Flutuante	Taxa de Juros/Spread
	03454.00-0	05000.00-5	TCCP	190100002	2019010417873784	7875	REGISTRO	COMPRADOR	PENDE				
<div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">           CANCELAR DETALHAR         </div>										<div style="border: 1px solid gray; padding: 2px; display: inline-block;">Atualizar</div> <div style="border: 1px solid gray; padding: 2px; display: inline-block; margin-left: 10px;">Voltar</div>			

Para o Participante de Registro que ainda não lançou a operação ao clicar em campo “Ação”, é possível confirmar a operação (CONFIRMAR) e verificar as informações inseridas no momento do Registro (DETALHAR) conforme imagem abaixo:

Manutenção de Operação Pendente													
Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 1 de 1 )													
Data e Hora da Consulta: 04/01/2019 - 12:08:36													
<b>i</b> Critério de pesquisa													
Ação	Parte (Conta)	Contraparte (Conta)	Tipo de Instrumento Financeiro	Código IF	Número CETIP	Meu número	Tipo de Operação	Ponta na Operação	Situação	Modalidade	Rentabilidade/Indexador/Taxa Flutuante	% da Taxa Flutuante	Taxa de Juros/Spread
	05000.00-5	03454.00-0	TCCP	190100002	2019010417873784		REGISTRO	VENDEDOR	PENDE				
<div style="border: 1px solid black; padding: 2px;">           CONFIRMAR DETALHAR         </div>										<div style="border: 1px solid gray; padding: 2px; display: inline-block;">Atualizar</div> <div style="border: 1px solid gray; padding: 2px; display: inline-block; margin-left: 10px;">Voltar</div>			
<div style="border: 1px solid gray; padding: 2px; display: inline-block;">Exibir página 1 &gt;&gt;&gt;</div>													

## 4.5 Consulta lançamentos de Opção Flexível com CCP

CCP > Contrato de Opções > Consultas > Lançamentos

## Visão Geral

Os lançamentos realizados no módulo de Opção Flexível com CCP podem ser consultados através da funcionalidade descrita abaixo.

Serão trazidos os contratos que atendam a pesquisa de acordo com o preenchimento de campo da tela abaixo:

Após realizada a pesquisa, o sistema exibirá uma tela de relação com os seguintes campos:

### Tela de Relação

N° Operação CETIP	Conta Registradora-Titular	Conta-Titular	Conta SINCAD-Titular	Código do PR-Titular	CPF/CNPJ-Titular	Membro de Compensação-Titular	Taxa Operacional-Titular	Valor-Titular	N° Controle do PR-Titular	Conta Repasse-Titular	Co
2020041612597364	03489.00-6	03489.10-9	---	530 1033	---	COMPENSADOR DO TITULAR	---	---	---	---	034
2020041612597364	03489.00-6	---	---	1033	---	COMPENSADOR DO TITULAR	---	---	---	---	034

(continua)

Contraparte Registradora-Lançador	Conta-Lançador	Conta SINCAD-Lançador	Código do PR-Lançador	CPF/CNPJ-Lançador	Membro de Compensação-Lançador	Taxa Operacional-Lançador	Valor-Lançador	N° Controle do PR-Lançador
03485.00-0	---	---	1028	---	COMPENSADOR DO LANÇADOR	---	---	---
03485.00-0	03485.10-3	---	372 1028	31334728625	COMPENSADOR DO LANÇADOR	---	---	---

(continua)

Conta Repasse-Lançador	Tipo Operação	Tipo de Contrato	Código de Contrato	Situação	Modalidade de Liquidação	Meu Número	Tipo de Índice	Data Início	Data Vencimento	Data de Liquidação	Variável	Quantidade
---	REGISTRO CONTRATO OPCAO	COMPRA	200411527	FINALIZADA	SEM MODALIDADE CCP	12345675	PARIDADE	16/04/2020	31/08/2020	01/09/2020	DOLAR DOS EUA	1.000,00
---	REGISTRO CONTRATO OPCAO	COMPRA	200411527	FINALIZADA	SEM MODALIDADE CCP	12345677	PARIDADE	16/04/2020	31/08/2020	01/09/2020	DOLAR DOS EUA	1.000,00

(continua)

Preço de Exercício-Venda	Preço de Exercício-Compra	Data Liquidação do Exercício	Tipo Preço	N° Dias de Apuração	Tipo Opção	Data Fixing	Limitador-Venda	Limitador-Compra	Prêmio Unitário-Venda	Prêmio Unitário-Compra
---	1,85	D+1	U	---	1 EUROPEIA	D-1	---	100.000,00	---	150.000,00
---	1,85	D+1	U	---	1 EUROPEIA	D-1	---	100.000,00	---	150.000,00

(continua)

Data de Pagamento do Prêmio	Valor do Prêmio	ID - Knock In and Down	IU - Knock In and UP	OD - Knock Out and Down	OU - Knock Out and UP	Tipo de Rebate	Rebate Unitário	Data de Liquidação do Rebate	Monitoramento de Barreiras
17/04/2020	150.000.000,00	---	---	---	---	---	---	---	---
17/04/2020	150.000.000,00	---	---	---	---	---	---	---	---

(fim)

### Descrição dos campos da Tela de Relação

Campo	Descrição
N° Operação CETIP	Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato

<b>TITULAR</b>	
Conta Registradora-Titular	Conta do Participante do Titular do contrato.
Conta-Titular	Conta de Registro da Titular do contrato.
Conta SINCAD-Titular	Código da conta SINCAD do cliente Titular do contrato
Código do PR-Titular	Código do Participante de Registro (Código do PR Sincad) do Titular do contrato
CPF/CNPJ-Titular	CPF/CNPJ do Titular do contrato.
Membro de Compensação-Titular	Nome simplificado do MC do PR Sincad do Titular do contrato
Taxa Operacional-Titular	Tipo do valor da taxa operacional da operação do Titular, se aplicável.
Valor-Titular	Valor da taxa operacional da operação do Titular, se aplicável.
Nº Controle do PR-Titular	Número atribuído pelo Participante de Registro do Titular do contrato.
Conta Repasse-Titular	Conta de repasse do cliente final (cessionário da operação) do Titular, se houver
<b>LANÇADOR</b>	
Contraparte Registradora-Lançador	Conta do Participante do Lançador do contrato.
Conta Lançador	Conta de Registro da Lançador do contrato.
Conta SINCAD-Lançador	Código da conta SINCAD do cliente Lançador do contrato
Código do PR-Lançador	Código do Participante de Registro (Código do PR Sincad) do Lançador do contrato
CPF/CNPJ Lançador	CPF/CNPJ do Lançador do contrato.
Membro de Compensação-Lançador	Nome simplificado do MC do PR Sincad do Lançador do contrato
Taxa Operacional-Lançador	Tipo do valor da taxa operacional da operação do Lançador, se aplicável.
Valor-Lançador	Valor da taxa operacional da operação do Lançador, se aplicável.
Nº Controle do PR-Lançador	Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato.
Conta Repasse-Lançador	Número atribuído pelo Participante de Registro do Lançador do contrato.
<b>CARACTERÍSTICAS – Dados básicos do Contrato</b>	
Conforme Lista de Relação de campos da consulta de características do contrato de Opções	

## 4.6 Consultas e relatórios

### Consulta OTC

CCP > Consultas e relatórios > Consulta OTC

#### Visão Geral

Seguindo a dinâmica de realização de pesquisas, pode-se utilizar a “consulta OTC” através do preenchimento de múltiplos campos de filtro conforme tela abaixo, sendo necessário preencher pelo menos um dos campos do filtro para a realização da consulta:

**Consulta OTC**

Conta Registradora

PR

Conta

Conta Sincad

Tipo Operação

Tipo IF

Código IF

Situação

Data de Liquidação

Data Operação

Data de Vencimento

Núm. Controle Lançamento

Número Controle da Operação

Operação Broker

Após a consulta, o sistema trará até 500 resultados das operações encontradas de acordo com os filtros selecionados e oferece a possibilidade de extração de arquivo .csv.

O arquivo será enviado via malote do Participante de Registro e disponibilizado em: Transf. de Arquivo > Arquivo > Receber Arquivos.

Esse arquivo apresentará operações de: Registro, Antecipação, Anulação, Exercício de opção, Vencimento, Ativos Vencidos e Acionamento de barreira Knock out de até D-5 (dias úteis anteriores).

Após realizada a pesquisa, o sistema deverá exibir uma tela de relação com os seguintes campos:

**Consulta OTC**  
Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 4 de 4 )  
Data e Hora da Consulta: 10/03/2020 - 16:28:50

**Critério de pesquisa**

Código do Contrato	Nº de Controle do PR	Num Broker	Meu número	Produto	Código Contrato	Situação Contrato	Nome PR Parte	Participante(Nome Simplificado)	Participante(Conta)	Conta Registradora (Parte)	Código PR Parte	Nome Membro Compensacao Parte	Código Membro Compensacao Parte	Nome Cliente Parte
200306746		823100316	0CCP	22905551	CONTRATO EM ABERTO	SENIOR SOLUTION S.A.	SENIORB	04312.00-0	04312.00-0	2245	SENIOR SOLUTION S.A.	2245	SENIOR SOLUTION S.	
200306746		707350311	0CCP	22905551	CONTRATO EM ABERTO	SENIOR SOLUTION S.A.	SENIORB	04312.00-0	04312.00-0	2245	SENIOR SOLUTION S.A.	2245	SENIOR SOLUTION S.	
200306746		61840313	0CCP	22905551	CONTRATO EM ABERTO	SENIOR SOLUTION S.A.	SENIORB	04312.00-0	04312.00-0	2245	SENIOR SOLUTION S.A.	2245	SENIOR SOLUTION S.	
200306746		182733246	0CCP	22905551	CONTRATO EM ABERTO	SENIOR SOLUTION S.A.	SENIORB	04312.00-0	04312.00-0	2245	SENIOR SOLUTION S.A.	2245	SENIOR SOLUTION S.	

« 1 Exibir página »

Obter no formato:

## Descrição dos campos da Tela de Relação

Campo	Descrição
Código do Contrato	Código do contrato pesquisado.
Nº Controle do PR	Campo de uso livre do Participante para informar um número de controle interno da operação na instituição.
Num Broker	Número gerado ao realizar a brokeragem da operação.
Meu número	Número interno de identificação do lançamento. Com até 10 dígitos

Produto	apresenta o nome do produto pendente de lançamento;
Código Contrato	Código referente ao contrato
Situação Contrato	Indica a situação em que se encontra o contrato a ser pesquisado. (Pendente de lançamento - Lançador ou Titular).
Nome PR Parte	Nome do Participante
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante de Registro.
Participante (Conta)	Conta Cetip do Participante de Registro parte do contrato.
Conta Registradora(Parte)	Indica o número da conta própria ou do cliente que é Parte na operação.
Código PR Parte	Indica o código no sistema de cadastro B3 do Participante de Registro "Parte" da Operação
Nome Membro Compensação Parte	Nome do Membro de Compensação da Parte
Código Membro Compensação Parte	Indica o código do Membro de Compensação do Participante de Registro "Parte" da operação, informado no sistema SINCAD. Preenchido default.
Nome Cliente Parte	Nome do cliente a ser informado pela Parte

### Mov-Balcão

CCP > Consultas e relatórios > Mov-Balcão

### Visão Geral

O arquivo MovBalcão tem por objetivo disponibilizar as movimentações realizadas pelo Participante de Registro, conforme data solicitada.

Por meio dessa tela é possível solicitar o arquivo MovBalcão a qualquer momento, durante o horário de funcionamento do sistema.

Arquivo no formato "txt." que contempla as seguintes operações efetuadas:

- Anulação de Antecipação;
- Anulação de Registro;
- Exclusão;
- Antecipação; e
- Transferência.

**Contratos Movimentados (Mov-Balcão)**

PR

Data de Movimentação

Movimentações

Cancelamento de Liquidação

Cancelamento de Registro

Exclusão

Liquidação Antecipada

Transferência

O arquivo será disponibilizado no módulo de Transf. de Arquivo > Arquivo > Receber Arquivo. Será gerado um arquivo após o fechamento do sistema (no batch noturno) que estará disponível também, no módulo de Transf. de Arquivo com as operações mencionadas acima, realizada no dia para consulta no dia seguinte.

Esse arquivo pode ser gerado com data de até D-5.

### NegBalcão

CCP > Consultas e relatórios > Neg-Balcão

### Visão Geral

O arquivo NegBalcão tem por objetivo disponibilizar a posição atualizada dos contratos do Participante de Registro, conforme data solicitada e tipos de “situação” filtrados na pesquisa. Por meio dessa tela é possível solicitar o arquivo NegBalcão a qualquer momento, durante o horário de funcionamento do sistema NoMe.

Arquivo no formato “txt.” que possibilita a conciliação dos contratos conforme filtro solicitado.

**Contratos Negociados (Neg-Balcão)**

PR

Data Negociação

Situação

Contas SINCAD

É possível realizar o filtro por conta do cliente e com as seguintes situações:

- Aprovado – operações registradas no D0
- Contrato em Aberto – posição em aberto
- Todos - Todas as operações e situações

O arquivo será disponibilizado no módulo de Transf. de Arquivo > Arquivos > Receber Arquivos.

Será gerado um arquivo logo após o fechamento do sistema (no batch noturno) que estará disponível também, no módulo de Transf. de Arquivo com os contratos registrados no dia para consulta no dia seguinte.

Arquivo gerado: NEGBALCAO-APROVADOS-AUTOMATICO.

Também, diariamente, após fechamento do sistema e processamento do batch noturno e após ajustar os contratos em decorrência de proventos, o sistema gera automaticamente um arquivo que contém todo o estoque de Contratos em Aberto do Participante, com os valores já ajustados pelo respectivo provento que se aplicar para a data em que o arquivo foi gerado. Mesmo que não tenha provento agendado para o dia o arquivo é gerado diariamente, para toda pregão, contendo toda a posição em aberto.

Arquivo gerado: NEGBALCAO-CONTRATOS-EM-ABERTO-PROVENTOS.

#### 4.7 Consulta de Operações

Operações > Consultas > Consulta Operação CCP

##### Visão Geral

Esta função permite a consulta das operações realizadas em até D-5 dos derivativos com CCP (Termo, Swap e Opção Flexível com CCP).

É necessário que ao menos um dos campos seja preenchido. Caso o Participante de Registro não preencha o filtro “Participante”, são apresentados, conforme as informações fornecidas na tela de filtro, todos os contratos por ele registrados que passaram por movimentações (operações) em até D-5, sendo o próprio, necessariamente uma das pontas.

Filtro Consulta Operacao CCP

Participante (Nome Simplificado)

Participante (Conta)

Contraparte (Nome Simplificado)

Contraparte (Conta)

Tipo Operação

Tipo IF

Cod. Instrumento Financeiro

Modalidade Liquidação

Situação

Data de Liquidação

Data Operação 9 / 3 / 2020

Num. Controle Lançamento

Número Controle da Operação

Após realizada a pesquisa, o sistema deverá exibir uma tela de relação com os seguintes campos:

Participante (Nome Simplificado)	Participante (Conta)	Participante (PR)	Participante (Sincad)	Número Operação Original	Data Operação Original	PU Op Original	Qtd Op Original	NuOp	Número Controle da Operação	Cód.Proc.	Fator Antecipação Parte	Fator Antecipação Contraparte	Situação do Contrato	Data Inclusão	Data Última Atualização	
BALCADOM	03448.009	00300	1.09	PAGAMENTO DE PREMIO	LANÇADOR	20030741	OCCP	06/03/2020	18/05/2021	0.858.0000000	9.999.999.999.1234567000	88.579.999.992.235.57	OCCP	SEM MODALIDADE CCP FINALIZADA	18/03/2020	06/03/2020

(continua)

90300	1116								2020030611854811	N			CONTRATO EM ABERTO	06/03/2020 18:26:32	06/03/2020 18:26:36
-------	------	--	--	--	--	--	--	--	------------------	---	--	--	--------------------	---------------------	---------------------

(fim)

## Descrição dos campos da Tela de Relação

Campo	Descrição
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante de Registro.
Participante (Conta)	Conta Cetip do Participante de Registro parte do contrato.
Participante (PR)	Código Cetip do participante que está efetuando o lançamento
Participante (Sincad)	Indica o código no sistema de cadastro SINCAD do Participante de Registro "Parte" da Operação.
Tipo Operação	Tipo de operação pendente (Registro ou Antecipação).
Tipo de Operação	Descrição da operação realizada.
C/V	Indicação da posição das pontas do contrato (P1 - Comprador/ P2 - Vendedor).
Cod. Instrumento Financeiro	Número gerado no momento do Registro pelo sistema.
Tipo IF	TCCP (para Termo), SCCP (para Swap) e OCCP (para Opção).
Data Emissão	Data na qual o contrato foi emitido.
Data Vencimento	Data na qual o contrato vence.
Quantidade	Quantidade negociada no contrato.
PU	Preço Unitário Inicial do contrato.
Valor	Valor base do contrato.
Modulo	CETIP21
Modalidade	Indicação da modalidade CCP.
Situação	Indica a situação em que se encontra a operação pesquisada.
Num. Controle Lançamento	Número gerado no momento do Registro pelo sistema.
Data de Liquidação	Data da Antecipação da operação.
Data Operação	Data em que a operação/movimentação foi realizada.
Contraparte (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante de Registro.
Contraparte (Conta)	Conta Cetip do Participante de Registro contraparte do contrato.
Contraparte (PR)	Código Cetip que identifica o membro com quem é efetuado o contrato
Contraparte (Sincad)	Indica o código no sistema de cadastro SINCAD do Participante de Registro "Contraparte" da Operação.
Número Operação Original	Número Operação Original.
Data Operação Original	Data Operação Original.
PU Op Original	PU Op Original.
Qtd Op Original	Qtd Op Original.
NuOp	Número da Operação.
Número Controle da Operação	Número gerado pelo sistema após a realização da operação.
Cód.Proc.	Preenchimento com "N".

Campo	Descrição
Fator Antecipação Parte	Fator para atualização do valor base remanescente, compondo o financeiro da ponta do Participante de Registro.
Fator Antecipação Contraparte	Fator para atualização do valor base remanescente, compondo o financeiro da ponta do Participante de Registro.
Situação do Contrato	Status do contrato
Data Inclusão	Data de inclusão da operação/movimentação.
Data Última Atualização	Data de atualização da operação, caso houver.

#### 4.8 Consulta de Arquivos e Relatórios

Para baixar os arquivos e relatórios, o Participante deve seguir o caminho abaixo:

Transf. De Arquivos > Arquivo > Receber Arquivos



Ao preencher o número do malote e clicar em pesquisar, o Participante de Registro poderá encontrar os seguintes relatórios e arquivos:

- PS\_RT\_G015\_199

Arquivo no formato "txt." de conciliação com todas as operações em aberto e eventos realizados pelo participante.

- Neg-Balcão

Arquivo no formato "txt." que contempla a conciliação dos contratos registrados no dia ou da posição em aberto (conforme filtro de pesquisa solicitado na respectiva tela de solicitação) do Participante de Registro.

- Mov-Balcão

Arquivo no formato "txt." que contempla operações (movimentações) efetuadas.

- Tar Analítico – Lançamento de tarifação, por tipo de contrato: Formato Excel

Contempla o detalhamento analítico da tarifação das operações de :Registro, Antecipação, Transferência e no primeiro dia útil do mês os valores de tarifação da permanência.

- Tar Sintético – extrato consolidado de tarifação do mês referente: Formato Pdf

Contempla todos os eventos da tarifação de Registro, Antecipação, Transferência e no primeiro dia útil do mês os valores de tarifação da permanência. Relatório disponível sempre no primeiro dia útil do mês mostrando o consolidado dos valores de tarifação.

- Relatório de Contratos em Aberto: Formato Pdf

Relatório no formato pdf que traz as operações de termo, swap e opção em aberto diariamente.

- Notas

As notas demonstram com detalhes e os parâmetros dos eventos em d+1 realizados pelos participantes. Os tipos de notas são:

- Nota de Registro;
- Nota de Antecipação;
- Nota de Transferência;
- Nota de Antecipação de Opções Flexíveis com CCP;
- Nota de Pagamento de Rebate; e
- Nota de Vencimento.

Transf.de Arquivo > Arquivo > Arquivos Públicos

- TarBalcão

Este arquivo no formato “txt.” representa todas os valores da tabela de Tarifação da B3 pagas pelo Participante de Registro referente aos Derivativos de Balcão com CCP, dividido pelos códigos dos tipos de contratos: Termo, Opção Flexível e Swap com CCP.

- IndexadoresCCP

Possui o de/ para das variáveis e indexadores utilizados para a geração do arquivo de registro dos contratos de Opções, Swap e Termo.

#### **4.9 Consulta – Histórico de Ajuste de Proventos de Ações CCP**

Índices Financeiros > Consultas > Histórico de Ajuste de Proventos de Ações CCP

##### **Visão Geral**

Esta função permite a consulta das operações ajustadas pela ocorrência de evento corporativo no ativo objeto do contrato em aberto.

É necessário que ao menos o preenchimento do campo “Tipo IF” e a conta ou o código do Participante.

**Histórico de Ajuste de Proventos de Ações CCP**

Tipo IF

Participante (Conta)

Participante (Código do PR)

Código do IF

Código da Ação

Descrição do Provento

Período do Ajuste  -

Após realizada a pesquisa, o sistema deverá exibir uma tela de relação com os seguintes campos:

Página 1 de 932 ( Linhas 1 a 25 de 23284 )  
Data e Hora da Consulta: 22/09/2020 - 12:26:31

 Critério de pesquisa

Código da Ação	Código do IF	Preço de Exercício Anterior	Preço de Exercício Atual	Prêmio Unitário Anterior	Prêmio Unitário Atual	Limite Anterior	Limite Atual	Barreira ID Anterior	Barreira ID Atual	Barreira IU Anterior	Barreira IU Atual	Barreira OD Anterior	Barreira OD Atual	Barreira OU Anterior	Barreira OU Atual	Rebate Unitário Anterior	Rebate Unitário Atual
ABEV3 FECHAMENTO	190900050	1.058.0000000000	1.057.8300000000														

Valor de Ajuste	Quantidade Anterior	Quantidade Atual	Quantidade Antecipada Anterior	Quantidade Antecipada Atual	Descrição do Provento	Fator de Ajuste por Bonificação	Data e Hora do Ajuste	Usuário
0,20					DIVIDENDO		02/10/2019 19:03:03	CETIP

Os campos identificados como “Anterior” referem-se aos valores da característica do contrato vigentes até a data em que o ajuste devido à ocorrência de evento corporativo foi aplicado ao contrato para o respectivo provento.

Os campos identificados como “Atual” referem-se aos valores da característica do contrato já ajustados em decorrência do respectivo provento.

## **5 VARIÁVEIS ACEITA POR TIPO DE CONTRATO.**

### **5.1 Tabela Auxiliares – Swap, Termo e Opções**

Estão disponíveis no Site da B3 em [http://www.b3.com.br/pt\\_br/produtos-e-servicos/registro/derivativos-de-balcao/](http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/registro/derivativos-de-balcao/), sob o submenu “Características Técnicas”.

## 6 TARIFAÇÃO

### **Mercado de Balcão - Derivativos com CCP**

As tarifas do Mercado de Balcão segregada por produtos dos Derivativos de Balcão com CCP estão disponíveis no site da B3 em

[http://www.b3.com.br/pt\\_br/produtos-e-servicos/tarifas/](http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/tarifas/)