

MANUAL DE OPERAÇÕES – OPÇÕES FLEXÍVEIS

CONTEÚDO

| | | |
|----------|---|-----------|
| 1 | ATUALIZAÇÕES | 3 |
| 2 | INTRODUÇÃO ÀS OPÇÕES FLEXÍVEIS | 10 |
| 2.1 | Conhecendo o produto | 10 |
| 2.2 | Ações dos botões das telas | 12 |
| 3 | LANÇAMENTOS | 12 |
| 3.1 | Registro de Contrato | 12 |
| 3.2 | Registro de Mercadoria | 15 |
| 3.3 | Registro Opção de Ações Nacionais | 24 |
| 3.4 | Registro Opção de Paridade | 32 |
| 3.5 | Registro Opção de Índice | 45 |
| 3.6 | Registro Opção de Índices Internacionais | 51 |
| 3.7 | Alteração | 60 |
| 3.8 | Exclusão | 64 |
| 3.9 | Antecipação de Contrato | 65 |
| 3.10 | Avaliação de Contrato de Opção | 69 |
| 3.11 | (Não) Exercício de Contrato de Opção | 73 |
| 3.12 | Cancelamento de Operações | 77 |
| 3.13 | Cessão de Contrato de Opção | 78 |
| 3.14 | Confirmação de Cessão de Contrato de Opção | 81 |
| 3.15 | Informação de Valor de Rebate | 84 |
| 4 | CONSULTAS | 85 |
| 4.1 | Características de Contratos | 85 |
| 4.2 | Erros em Arquivos | 89 |
| 4.3 | Lançamentos | 89 |
| 5 | INFORMAÇÕES ADICIONAIS | 91 |
| 5.1 | Cruzamento de funcionalidades | 91 |
| 5.2 | Regras para Registro de Contrato de Paridade conforme Fonte de Informação | 92 |
| 5.3 | Regras para Registro de Contrato de Ações/ Índice/Mercadoria | 93 |
| 5.4 | Metodologia de cálculo de valores financeiros para liquidação | 94 |
| 5.5 | Informações Adicionais | 94 |
| 5.6 | Tratamento de Proventos | 96 |
| 5.7 | Ativos Subjacentes Disponíveis | 98 |
| 5.8 | Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros | 99 |

1 ATUALIZAÇÕES

| Versão | Atualizado em | Referência | Atualização |
|------------|---------------|---|--|
| 29/06/2020 | 02/09/2021 | Informações Adicionais | Inclusão de informações adicionais sobre datas de fixing e feriados. |
| 29/06/2020 | 19/11/2020 | Tratamento de Proventos | Ajuste na descrição de Tratamento de Proventos |
| 29/06/2020 | 29/06/2020 | Avaliação de Contrato de Opção | Atualização de telas de Avaliação de contrato, conforme divulgado no comunicado 019/2020-VPC. |
| 29/06/2020 | 29/06/2020 | Alteração de Contrato | Informação que o contrato de Opção poderá ter mais de uma alteração no dia, conforme divulgado no comunicado 019/2020-VPC. |
| 29/06/2020 | 29/06/2020 | Intermediação de Contrato | Ajuste no texto referente à grade da Intermediação de um contrato de Opção. |
| 28/05/2019 | 14/10/2019 | Consultas | Alteração na descrição do quadro de situações possíveis. |
| 28/05/2019 | 08/10/2019 | Avaliação de Contrato de Opção | Inclusão das telas de lançamentos para Índices Internacionais. |
| 28/05/2018 | 26/12/2018 | Registro de Mercadoria | Melhoria da descrição dos campos “Datas de Verificação” e “Cotação para o Vencimento”. |
| 28/05/2018 | 26/12/2018 | Regras de Negócios | Alteração do nome para “Informações Adicionais” e melhoria da descrição. |
| 28/05/2018 | 26/12/2018 | Glossário | Exclusão do trecho. |
| 28/05/2018 | 30/08/2018 | Registro Opção de Ações Nacionais Registro Opção de Paridade Registro Opção de Índice Registro Opção de Índices Internacionais | Atualização da descrição do campo “Data de Liquidação do Prêmio”. |
| 28/05/2018 | 29/08/2018 | Registro de Contrato | Atualização da descrição do campo “Data de Liquidação do Prêmio”. |
| 28/05/2018 | 28/05/2018 | Lançamentos – Antecipação de Contrato | Alteração no comportamento das antecipações de derivativos com Redutor do Risco de Crédito, conforme divulgado no COMUNICADO EXTERNO 006/2018-VPC, 008/2018 – VPC e 012/2017 – DN. |
| 11/09/2017 | 29/01/2018 | Registro Opção de Índices Internacionais Registro Opção de Índice Registro Opção de Paridade | Alteração de regra para combinação de Parte e Contraparte nos contratos. |

| Versão | Atualizado em | Referência | Atualização |
|------------|---------------|---|---|
| | | Registro Opção de Ações Nacionais Registro de Mercadoria | |
| 11/09/2017 | 29/01/2018 | Registro Opção de Índices Internacionais Registro Opção de Índice Registro Opção de Paridade Registro Opção de Ações Nacionais Registro de Mercadoria | Melhoria nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos. |
| 11/09/2017 | 05/01/2018 | Cessão de Contrato de Opção | Atualização da descrição do campo “Valor do Prêmio em R\$” |
| 11/09/2017 | 11/09/2017 | Características de Contratos | Atualização das telas Filtro, Relação e Detalhe. |
| 11/09/2017 | 11/09/2017 | Registro de Contrato – Registro Opção de Índice | Inclusão do campo Fonte de Consulta. |
| 31/07/2017 | 09/08/2017 | Registro Opção de Paridade | Melhoria da descrição do campo “Preço de Exercício” |
| 31/07/2017 | 31/07/2017 | Registro Opção de Ações Nacionais | Inclusão dos domínios D-2, D-3, D-4 e D-5 no campo “Cotação para o Vencimento” de acordo com o comunicado 038/17. |
| 27/05/2016 | 31/01/2017 | Regras para Registro de Contrato de Ações/ Índice/Mercadoria Registro Opção de Índices Internacionais Registro Opção de Índice Registro Opção de Paridade Registro Opção de Ações Nacionais Registro de Mercadoria | Alteração de descrição de alguns campos. |
| 27/05/2016 | 31/01/2017 | Ações Negociadas Moedas Negociadas | Exclusão dos seguintes arquivos. |
| 27/05/2016 | 31/01/2017 | Ativos Subjacentes Disponíveis | Inclusão do arquivo “Ativos Subjacentes Disponíveis” . |
| 27/05/2016 | 26/12/2016 | Conhecendo o produto | Alteração na Observação de Opções Flexíveis com Agenda de Redutor de Risco Crédito. |

| Versão | Atualizado em | Referência | Atualização |
|------------|---------------|---|---|
| 27/05/2016 | 22/11/2016 | Cessão de Contrato de Opção | Exclusão do termo “quando houver” do Campo “Valor do Premio em R\$”. |
| 27/05/2016 | 01/07/2016 | Registro Opção de Índices Internacionais | Atualização nas descrições dos campos: “Fonte de Informação, Fonte de Consulta, Praça de Negociação e Data de avaliação”. |
| 27/05/2016 | 22/06/2016 | Informações Adicionais | Inclusão do item: Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros |
| 27/05/2016 | 27/05/2016 | Histórico de ajustes de Proventos | Exclusão do tópico. |
| 25/01/2016 | 26/04/2016 | Registro Opção de Paridade Registro Opção de Índice Registro Opção de Índices Internacionais | Alteração nas descrições dos campos “Outra Fonte de Consulta, Tela ou Função de Consulta, Praça de Negociação e Horário de Consulta”. |
| 25/01/2016 | 25/04/2016 | Registro Opção de Índices Internacionais | Alteração na descrição do campo “Cotação para o Vencimento”. |
| 25/01/2016 | 09/03/2016 | Registro de Mercadoria Registro Opção de Ações Nacionais Registro Opção de Paridade Registro Opção de Índice Registro Opção de Índices Internacionais | Alteração na descrição do campo “Forma de Disparo”. |
| 25/01/2016 | 02/03/2016 | Conhecendo o Produto (Opções Flexíveis com Agenda de Redutor de Risco Crédito) | Inclusão da observação 1). |
| 25/01/2016 | 12/02/2016 | Tratamento de Proventos | Inclusão da observação 6 sobre Trigger – Proporção. |
| 25/01/2016 | 25/01/2016 | Registro Opção de Índice | Inclusão de caixa de seleção com as opções: D0, D-1, D-2 e D-3 na descrição do campo “Cotações para Vencimento”. |

| Versão | Atualizado em | Referência | Atualização |
|------------|---------------|--|---|
| 23/11/2015 | 23/11/2015 | Registro Opção de Paridade | Alteração da tela Registro Opção de Paridade - Feeder ou Spot (tela) e inclusão dos campos "Fonte de Informação e Cotação para o vencimento", conforme comunicados 015/15, 042/15 e 087/15. |
| 18/05/2015 | 27/08/2015 | Registro de Mercadoria Registro Opção de Ações Nacionais Registro Opção de Paridade Registro Opção de Índice Registro Opção Índices Internacionais | Alteração na descrição do campo "Forma de Disparo". |
| 18/05/2015 | 21/07/2015 | Registro Opção de Ações Nacionais e Índices | Melhoria na descrição do campo Valor Base/Quantidade. |
| 18/05/2015 | 01/07/2015 | Todo o manual | Inclusão do Índice Selic. |
| 18/05/2015 | 29/06/2015 | Ações Negociadas | Atualização da tabela. |
| 18/05/2015 | 19/06/2015 | Registro de Mercadoria | Exclusão da informação "não deve possuir barreiras (Knock In, Knock Out e Knock in/Knock Out)", no campo Data de Liquidação do Prêmio. |
| 18/05/2015 | 16/06/2015 | Registro Opção de Paridade | Exclusão da informação "não deve possuir barreiras (Knock In, Knock Out e Knock in/Knock Out)", no campo Data de Liquidação do Prêmio. |
| 18/05/2015 | 18/05/2015 | Registro de Contrato | Não é permitido o registro de opção ou box com o Titular e Lançador com o mesmo CPF/CNPJ. |
| 02/06/2014 | 04/03/2015 | Cruzamento de Funcionalidades | "Opção Quanto" deve ter "Impossível" na coluna da "Opção de Paridade". |
| 02/06/2014 | 27/01/2015 | Alteração na descrição dos campos "Quantidade" | Mudança na descrição do campo "Quantidade" para Registro de Opção de |

| Versão | Atualizado em | Referência | Atualização |
|------------|---------------|---|--|
| | | | Índices Internacionais, Opção de Índice, Opção de Paridade e Ações Nacionais. |
| 02/06/2014 | 25/11/2014 | Diversas funções | Alteração de tela (layout, forma e cor). |
| 02/06/2014 | 31/10/2014 | Registro de Mercadoria; Registro de Opção de Ações Nacionais; Registro Opção de Paridade; Registro Opção de Índice; Registro Opção de Índices Internacionais. | No campo Data de Liquidação do Prêmio, alterar: DE: A data deve ser um dia útil e menor que a data do Vencimento. PARA: A data deve ser um dia útil e menor ou igual que a data do Vencimento. |
| 02/06/2014 | 31/10/2014 | Atualização da Versão | Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais nova para a mais antiga. |
| 02/06/2014 | 10/09/2014 | Todo o manual | Nas descrições dos campos, inclusão da informação se o preenchimento é obrigatório ou não. |
| 02/06/2014 | 08/08/2014 | Conhecendo o Produto | Inclusão do texto sobre Opções Flexíveis com Agenda de Redutor de Risco Crédito. |
| 02/06/2014 | 28/07/2014 | Todo o manual | Inclusão do caminho completo da função no NoMe. |
| 02/06/2014 | 15/07/2014 | Regras de Negócios | Inclusão de informações sobre a atualização de contratos de Opções de Mercadorias. |
| 02/06/2014 | 02/06/2014 | Moedas Negociadas | Inclusão da moeda CNH. |
| 02/06/2014 | 02/06/2014 | Registro de Opção de Ações Nacionais, Registro de Ação de Índice e Índices Internacionais | Mudança na descrição do campo "Data de Liquidação do Prêmio". Conforme comunicado 061/14. |
| 10/12/2012 | 24/02/2014 | Ações Negociadas | Inclusão da ação BBTG11. |

| Versão | Atualizado em | Referência | Atualização |
|------------|---------------|--|---|
| 10/12/2012 | 04/11/2013 | Registro de Mercadoria e Opção de Paridade | Mudança na descrição do campo "Data de Liquidação do Prêmio". |
| 10/12/2012 | 07/08/2013 | Informações Adicionais | Inclusão da linha índice internacional em Regras para Registro de Contrato de Ações/Índice/Mercadoria. |
| 10/12/2012 | 21/02/2013 | Campos com a descrição opcional. | Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. |
| 10/12/2012 | 14/02/2013 | Registro/Exclusão | Mudança: Exclusão mercado x mercado será permitida apenas em D0. |
| 10/12/2012 | 10/12/2012 | Registro de Mercadoria | Inclusão do campo "Cotação para Moeda". |
| 19/09/2012 | 10/05/2012 | Ações Negociadas | Inclusão das ações negociadas |
| 18/06/2012 | 25/09/2012 | Campo: Data da Liquidação do Prêmio | Melhoria no texto. |
| 18/06/2012 | 17/09/2012 | Alteração de Contrato | Impossibilidade de alteração de CPF/CNPJ. |
| 18/06/2012 | 18/06/2012 | Registro de Opções | Registro de contrato referenciado em cotação de índices Internacionais e valor de cotas de ETFs internacionais |
| 18/06/2012 | 18/06/2012 | Registro de Opções | É possível o registro de contrato de opções onde o lançador e o titular podem ser uma conta cliente. |
| 19/09/2011 | 07/05/2012 | Registro de Ações | Melhorias no texto do campo "Data de Avaliação" do Registro de Contrato. |

2 INTRODUÇÃO ÀS OPÇÕES FLEXÍVEIS

2.1 Conhecendo o produto

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Opções Flexíveis de Ações

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

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

Tratamento de Proventos de Ações

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

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

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

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

Opções Flexíveis com Agenda de Redutor de Risco Crédito

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

Paridades, Ações, Índices e Mercadorias.

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

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

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

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

Observação:

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

2.2 Ações dos botões das telas

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

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

3 LANÇAMENTOS

3.1 Registro de Contrato

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Registro de Contrato

Visão Geral

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Tela de Filtro

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

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

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

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

3.2 Registro de Mercadoria

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

(continua)

| | |
|--|---|
| Datas de Verificação: | <div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%; position: relative;"> ↑ ↓ ← → </div> <div style="text-align: center; margin-top: 5px;"> <input type="button" value="Informar Datas"/> </div> |
| Cotação para o Vencimento: | D-1 <input type="button" value="v"/> |
| Cotação para Moeda: | D-1 <input type="button" value="v"/> |
| Observação : | <div style="border: 1px solid black; height: 80px; width: 100%; position: relative;"> ↑ ↓ </div> |
| <input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> | |

(fim)

Descrição dos campos da Tela de Registro

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

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

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

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

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

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

Observação:

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

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

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

Confirmação de Registro de Mercadoria

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

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

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

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

3.3 Registro Opção de Ações Nacionais

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

(continua)

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

(fim)

Descrição dos campos da Tela de Registro para Ações Nacionais

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

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

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

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

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

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

Observação:

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

2. Codificação de Ações:

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

Código divulgado em Bolsa - PETR3

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

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

Código divulgado em Bolsa - PETR3

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

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

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

3.4 Registro Opção de Paridade

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

(continua)

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

(fim)

Descrição dos campos da Tela de Registro Opção de Paridade

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

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

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

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

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

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

Registro Opção de Paridade - Feeder ou Spot (tela)

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

(Fim)

Descrição dos campos Feeder ou Spot

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

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

Registro Opção de Paridade - Sisbacen/Feeder

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

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

Descrição dos campos Sisbacen/Feeder

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

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

Confirmação de Registro de Opção Paridade

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

Confirmar

Desistir

Corrigir

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

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

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

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

| Parte | Contraparte | Permitido? |
|---------------|-----------------------|------------|
| Conta própria | Conta própria mercado | Sim |

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

3.5 Registro Opção de Índice

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

Descrição dos campos da Tela de Registro Opção de Índice

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

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

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

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

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

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

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

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

3.6 Registro Opção de Índices Internacionais

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

(continua)

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

(fim)

Descrição dos campos da Tela de Registro Opção de Índices Internacionais

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Descrição dos campos Índices Internacionais (SISBACEN)

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

Descrição dos campos Índices Internacionais (FEEDER)

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

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

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

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

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

3.7 Alteração

(Menu Lançamentos)

Visão Geral

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

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

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

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

É permitida alteração nos contratos, nas seguintes condições:

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

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

Tela de Filtro

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

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

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

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

Tela de Alteração de Mercadoria

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

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

Campos que NÃO podem ser alterados**Campos**

Parte/Titular

CPF/CNPJ Titular

Contraparte/Lançador

CPF/CNPJ Lançador

Cesta de Garantias Lançador

Barreiras

(Se trigger disparado)

Trigger In

(Se trigger disparado)

Trigger Out

(Se trigger disparado)

Trigger- Proporção

(Se trigger disparado)

Tipo de Disparo

(Se trigger disparado)

Campos

Forma de Disparo

(Se trigger disparado)

Intermediador

Comissão paga pelo Titular

Comissão paga pelo Lançador

3.8 Exclusão

(Menu Lançamentos)

Visão Geral

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

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

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

É permitida exclusão de contratos, nas seguintes condições:

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

Tela Filtro

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

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

Tela de Exclusão de Mercadoria

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

3.9 Antecipação de Contrato

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Antecipação de Contrato

Visão Geral

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

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

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

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

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

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

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

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

Observações:

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

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

Tela de Inclusão dos Detalhes para Antecipação

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

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

Antecipação realizada. Operação de Antecipação No. 2014112117189902.

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

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

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

Descrição dos campos da tela de inclusão de detalhes

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

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

Dados Asiáticos

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

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

Observações:

Valor de Rebate - Atualizações da consulta

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

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

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

Contratos com Agenda de Redutor de Risco de Crédito

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

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

3.10 Avaliação de Contrato de Opção

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

Visão Geral

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

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

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

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

Tela de inclusão dos detalhes da Avaliação - Moedas

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

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

Avaliação registrada. Operação de Avaliação No. 2014112417222529.

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

Tela de inclusão dos detalhes da Avaliação – Índices Internacionais

Modelo sem Cross rate

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

Modelo com Cross rate

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

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

Avaliação registrada. Operação de Avaliação No. 2019100810370731.

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

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

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

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

Descrição dos campos da tela de inclusão de detalhes

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

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

TAB1-Campos exibidos conforme Fonte de Informação

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

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

*NA = Não se aplica.

3.11 (Não) Exercício de Contrato de Opção

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

Visão Geral

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

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

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

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

Observação:

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

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

Descrição dos campos do Exercício de Opções/Estratégias

| Campo | Descrição |
|-------|-----------|
|-------|-----------|

Campos de preenchimento obrigatório.

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

Tela Exemplo – Não-Exercício

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

Confirmar

Desistir

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

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

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

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

3.12 Cancelamento de Operações

Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Cancelamento de Operações

Visão Geral

É permitido o cancelamento das seguintes operações:

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

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

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

Tela de Cancelamento de Operações

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

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

Descrição dos campos da Tela de Cancelamento de Operações

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

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

Tela exemplo - Confirmação de Cancelamento de Cessão de Opção

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

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

3.13 Cessão de Contrato de Opção

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

Visão Geral

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

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

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

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

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

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

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

Cessão e Pagamento de Prêmio

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

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

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

Tela de Cessão de Contrato

| Cessão de Contrato de Opção - OFCC RIO M142211 | | |
|--|--------------------------------|---------|
| Cedente: | 10020.00-1 BCO LEME S/A | |
| CPF/CNPJ do Cedente: | | |
| Adquirente: | 01409.00-2 FLORIDA | |
| CPF/CNPJ do Adquirente: | | |
| Anuente: | 05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A | |
| CPF/CNPJ do Anuente: | | |
| Novo Código IF: | RIO M142233 | |
| Liquidante: | 76000 | .00 - 3 |
| Modalidade: | BRUTA | |
| Valor do Prêmio em R\$: | 1000 | , |
| Meu Número: | 22111 | |

| Dados do Contrato Original | | |
|---------------------------------------|--------------------------------------|-----------------------------------|
| Titular | Lançador | Tipo de Exercício |
| 10020.00-1 BCO LEME S/A | 05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A | EUROPEIA |
| CPF/CNPJ Titular | CPF/CNPJ Lançador | |
| Intermediador | Comissão paga pelo Titular (R\$) | Comissão paga pelo Lançador (R\$) |
| Data de Início | Data de Vencimento | Prazo em Dias Úteis |
| 21/11/2014 | 22/12/2014 | 21 |
| Moeda Base / Ações / Índice / Produto | Moeda Cotada / Moeda para Negociação | Mercadoria |
| DOLAR DOS EUA | EURO/COM.EUROPEIA | |
| Valor Base / Quantidade | Valor Remanescente | Valor da Aplicação |
| 100,00000000 | 100,00000000 | 1.000.000,00 |
| Barreira | Trigger In | Trigger Out |
| Trigger - Proporção | Trigger - Forma de Disparo | Trigger - Tipo de Disparo |
| Não | | |
| Forma de Verificação | Adesão a Contrato | Cross-Rate na Avaliação |
| | SEM ADESAO | Sim |
| Rebate | Rebate Unitário | Liquidação do Rebate |

| Opção de Compra | | | |
|----------------------------------|--|--|---------------------------|
| Prêmio Unitário | Preço de Exercício | Limite | |
| 10.000,00000000 | 1.000.000,00000000 | | |
| Data de Liquidação do Prêmio | Preço de Exercício em Reais | Opção Quanto | Cotação para Opção Quanto |
| 21/11/2014 | Sim | Não | |
| Dados Adicionais | | | |
| Fonte de Informação | Cotação para o Vencimento | Boletim | Fonte de Captura |
| SISBACEN/FEEDER | D-1 | PTAX800 FECHAMENTO | |
| Fonte de Consulta | Outra Fonte de Consulta | Tela ou Função de Consulta | |
| REUTERS | | 11111 | |
| Praça de Negociação | Horário de Consulta | Ação / Ação Internacional / Índice Internacional | |
| 22222 | 15:00 | | |
| Ajuste de Proventos pelas Partes | Proteção contra Provento em Dinheiro | | |
| Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD | Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda) | Data de Avaliação | Média para Opção Asiática |
| VENDA | COMPRA | 19/12/2014 | |

Enviar Limpar Campos Voltar

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

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

Descrição dos campos da Tela de Cessão de Contrato

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

3.14 Confirmação de Cessão de Contrato de Opção

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

Visão Geral

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

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

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

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

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

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

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

Tela de Confirmação de Cessão

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

Confirmar

Desistir

(fim)

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

3.15 Informação de Valor de Rebate

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

Visão Geral

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

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

Tela de Filtro

| Informação de Valor de Rebate | | |
|-------------------------------|------------------------|---------------|
| Participante | Instrumento Financeiro | Contraparte |
| | Código | |
| 05000 .00 - 5 | RIO M142211 | 10020 .00 - 1 |

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

Tela de Resultado

| Informação de Valor de Rebate - OFCC RIO M142211 | |
|--|--------|
| Rebate Unitário: | 1000 , |
| Meu Número: | 11111 |

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

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

| Confirmação de Informação de Valor de Rebate - OFCC RIO M142211 | |
|---|---------------------|
| Rebate Unitário 1.000,00000000 | Meu Número 11111 |

4 CONSULTAS

4.1 Características de Contratos

Menu Estratégias e Opções > Consultas > Características de Contratos

Visão Geral

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

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

Tela de Filtro

Características de Contratos

Tipo de Instr. Financeiro:

Tipo de Opção:

Código Instr. Financeiro:

Lançador (Nome Simplificado):

Titular (Nome Simplificado):

Data de Emissão: / / a / /

Data de Vencimento: / / a / /

Situação do Contrato:

Cesta de Garantias:

Fonte de Informação:

Fonte de Consulta:

Tipo de Exercício:

Limitadores:

Cross Rate:

Barreiras:

Média Asiática:

Sistema Origem:

Código IF Sistema Origem:

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

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

Tela de Resultado

Características de Contratos

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 12 de 12)
 Data e Hora da Consulta: 05/09/2017 - 10:36:13



| Instrumento Financeiro | Tipo de IF | Tipo de Opção | Sistema | Lançador (Nome Simplificado) | Titular (Nome Simplificado) | Moeda Base / Ações / Índice / Produto | Moeda Cotada / Moeda para Negociação |
|------------------------|------------|---------------|---------|------------------------------|-----------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 01397171A01 | OFCC | ÍNDICE | OPCAO | CONVERSAOMEIERFDO | ALBERTOFDO | ÍNDICE DI | REAL |
| 01397171A02 | OFCC | ÍNDICE | OPCAO | CONVERSAOMEIERFDO | ALBERTOFDO | ÍNDICE DI | REAL |
| ALPBM170510 | OFCC | MERCADORIAS | OPCAO | AMPAROBC | AMPAROBC | ALGODAO | DOLAR DOS EUA |
| BIGL1170DRR | OFCC | ÍNDICE | OPCAO | BIGLIABM | RIOBM | IBOVESPA | REAL |
| BIGL1171A98 | OFCC | ÍNDICE | OPCAO | BIGLIABM | RIOBM | IBOVESPA | REAL |
| RIO M176293 | OFCC | PARIDADE | OPCAO | RIOBM | LEMEBM | COROA NORUE/NORUE | BOLIVIANO |
| RIO M176549 | OFCC | PARIDADE | OPCAO | RIOBM | RIOBM | DOLAR/HONG-KONG | RIAL/CATAR |
| RIO M177EEE | OFCC | PARIDADE | OPCAO | RIOBM | RIOBM | DOLAR DOS EUA | REAL |
| RIO M179AAA | OFCC | PARIDADE | OPCAO | RIOBM | RIOBM | DOLAR DOS EUA | REAL |
| SENB171A22 | OFCC | PARIDADE | OPCAO | SENIORBM | RIOBM | DOLAR DOS EUA | REAL |
| SENB171A23 | OFCC | PARIDADE | OPCAO | SENIORBM | RIOBM | DOLAR DOS EUA | REAL |
| XHULK172BNO | OFCC | PARIDADE | OPCAO | HULKBM | RIOBM | DOLAR DOS EUA | REAL |

(continua)

| Data Emissão | Data Vencimento | Situação do Contrato | Cesta de Garantia | Fonte de Informação | Fonte de Consulta | Ação / Ação Internacional / Índice Internacional | Mercadoria | Tipo Exercício | Limitadores |
|--------------|-----------------|-----------------------|-------------------|---------------------|-------------------|--|------------|----------------|-------------|
| 09/08/2017 | 09/10/2017 | CONFIRMADO | NÃO | ÍNDICE | CETIP | ---- | ---- | EUROPEIA | NÃO |
| 09/08/2017 | 09/10/2017 | CONFIRMADO | NÃO | ÍNDICE | CETIP | ---- | ---- | EUROPEIA | NÃO |
| 25/05/2017 | 20/02/2018 | CONFIRMADO | NÃO | COMMODITIES | ice (nybot) | ---- | CTH8F | EUROPEIA | NÃO |
| 14/07/2017 | 17/07/2018 | CONFIRMADO | NÃO | ÍNDICE | REUTERS | ---- | ---- | EUROPEIA | NÃO |
| 21/07/2017 | 24/07/2018 | CONFIRMADO | NÃO | ÍNDICE | REUTERS | ---- | ---- | EUROPEIA | NÃO |
| 26/06/2017 | 26/06/2018 | CONFIRMADO | NÃO | SISBACEN | BACEN | ---- | ---- | EUROPEIA | NÃO |
| 27/06/2017 | 23/10/2017 | CONFIRMADO | NÃO | SISBACEN | BACEN | ---- | ---- | EUROPEIA | SM |
| 01/08/2017 | 01/08/2018 | CONFIRMADO | NÃO | SISBACEN | BACEN | ---- | ---- | EUROPEIA | NÃO |
| 17/07/2017 | 17/07/2018 | CONFIRMADO | NÃO | SISBACEN | BACEN | ---- | ---- | EUROPEIA | NÃO |
| 06/04/2017 | 05/04/2018 | PENDENTE DE AVALIAÇÃO | NÃO | FEEDER | OUTROS | ---- | ---- | EUROPEIA | NÃO |
| 06/04/2017 | 05/04/2018 | PENDENTE DE AVALIAÇÃO | NÃO | FEEDER | OUTROS | ---- | ---- | EUROPEIA | NÃO |
| 12/05/2017 | 11/05/2018 | CONFIRMADO | NÃO | SISBACEN | BACEN | ---- | ---- | AMERICANA | NÃO |

(continua)

| Cross Rate | Barreiras | Forma Disparo | Tipo Disparo | Média Asiática | Rebate | Liquidação Rebate | Agente de Calculo - Parte | Agente de Calculo - Contraparte | Responsável pela Aceleração - Parte |
|------------|-----------|---------------|--------------|----------------|-----------------------|-------------------|---------------------------|---------------------------------|-------------------------------------|
| NÃO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- |
| NÃO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- |
| NÃO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | 02968.00-9 - BIGLIABM | ---- | ---- |
| NÃO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- |
| NÃO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- |
| NÃO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- |
| NÃO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- |
| NÃO | KNOCK OUT | DISCRETO | ALTA | ---- | LIQUIDACAO VENCIMENTO | ---- | ---- | ---- | ---- |
| NÃO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- |
| NÃO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- |
| NÃO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | 03092.00-8 - HULKBM | ---- | ---- |

(continua)

| Responsável pela Aceleração - Contraparte | Sistema Origem | Código IF Sistema Origem |
|---|----------------|--------------------------|
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |
| ---- | ---- | ---- |

(fim)

Tela de Detalhes do Contrato

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

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

Quadro de situações possíveis

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

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

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

4.2 Erros em Arquivos

Menu Estratégias e Opções > Consultas > Erros em Arquivos

Visão Geral

Esta função permite consultar os erros de lançamentos efetuados por transferência de arquivos, enviado pelo participante através do serviço de **Transferência de Arquivos** – opção **Enviar Arquivos**.

Não permite alteração ou exclusão do lançamento. O participante deverá retransmitir novo arquivo com as operações que não foram aceitas, após as devidas correções nas informações.

Erros em Arquivos

Nome Arquivo:

Número Solicitação:

Data da Solicitação: / /

Tela de Resultados

Erros em Arquivos

Página 1 de 193 (Linhas 1 a 25 de 4825)
Data e Hora da Consulta: 24/11/2014 - 17:54:53

 **Critério de pesquisa**

| Número da Solicitação | Nome do Arquivo | Data da Solicitação | Num. Linha Erro | Descrição do Erro |
|-----------------------|------------------------------|---------------------|-----------------|--|
| 1824881 | OPCAO_REGISTRO_0812_1102.002 | 15/08/2011 | 2 | Código de Instrumento Financeiro já existente. |

« 1 »

Obter no formato:

(continua)

Texto Linha Origem

OPCAO100020FCCRBSBH1123402258.00-102258.10-4P122020110812201108220000000001890000000000000000008050000000000000030000000000000 2 0N0000002469 N11173 10 04223720000177790 N <

(fim)

4.3 Lançamentos

Menu Estratégias e Opções > Consultas > Lançamentos

Visão Geral

Permite consultar todos os lançamentos que estão pendentes no dia, por falta de lançamento da parte ou da contraparte.

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

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

Tela de Filtro

Lançamentos

Titular (Nome Simplificado):

Titular (Razão Social):

Tipo de Conta Titular:

Titular (conta): . -

Laçador (Nome Simplificado):

Laçador (Razão Social):

Tipo de Conta Laçador:

Laçador (conta): . -

Tipo de Instr. Financeiro:

Situação:

Tipo Operação:

Nº Operação CETIP:

Meu Nº:

Código Instr. Financeiro:

Tela de Resultados

Lançamentos

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

 **Critério de pesquisa**

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

« « 1 » »

(Continua)

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

(Fim)

5 INFORMAÇÕES ADICIONAIS

5.1 Cruzamento de funcionalidades

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

Legenda:

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

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

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

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

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

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

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

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

SPOT e moeda USD Base

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

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

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

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

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

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

Principais campos:

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

As cotações relativas às ações são capturadas automaticamente da Reuters.

Índice

Principais campos:

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

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

As cotações relativas ao Ibovespa são capturadas automaticamente da Reuters.

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

As cotações relativas ao índice internacional são capturadas automaticamente.

Mercadorias

Principais campos:

| Moeda Base/Ações/Mercadorias | Moeda Cotada |
|------------------------------|--------------|
| Mercadorias | Real |

As cotações relativas às Mercadorias são capturadas automaticamente

5.4 Metodologia de cálculo de valores financeiros para liquidação

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

5.5 Informações Adicionais

Cessão de Contratos

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

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

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

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

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

Comissão de intermediação

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

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

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

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

Opção de Mercadoria – Datas de *Fixing*

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

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

* Ou seja, não considera feriados nacionais ou internacionais

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

Tratamento de mercadorias internacionais em feriados

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

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

Exemplos práticos de deslocamento do fixing da mercadoria:

- a) Feriado sexta-feira no Brasil e tem vencimento de contrato na própria sexta-feira, com:
- Fixing D-1: O contrato será liquidado na segunda-feira com cotação da quinta-feira.
 - Fixing D-2: O contrato será liquidado na segunda-feira com cotação da quarta-feira.
- b) Feriado internacional na quinta-feira e feriado local na sexta-feira, com vencimento de contrato na segunda-feira, com:
- Fixing D-1: O contrato será liquidado na segunda-feira, com cotação de sexta-feira.
 - Fixing D-2: O contrato será liquidado na segunda-feira, com cotação de quarta-feira.
- c) Feriado internacional na sexta-feira, com vencimento de contrato na segunda-feira, com:
- Fixing D-1: O contrato será liquidado na segunda-feira, com cotação de quinta-feira.
 - Fixing D-2: O contrato será liquidado na segunda-feira, com cotação de quinta-feira.
 - Fixing D-3: O contrato será liquidado na segunda-feira, com cotação de quarta-feira.

5.6 Tratamento de Proventos

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

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

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

Exemplo 1:

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

Ação – XPTO1

Data de Registro do Contrato – 10/8/2010

Data do Provento – 18/8/2010

Tipo de Provento – EX B

Fator do Provento – 1,50000000

Quantidade Original – 10,000

Valor do Prêmio Unitário Original – 0,10000000

Valor do Exercício Original – 12,00

Quantidade Ajustada – 15.000

Valor do Prêmio Unitário Ajustado – 0,06666667

Valor do Exercício Ajustado – 8,00

Exemplo 2:

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

Ação – XPTO2

Data de Registro do Contrato – 10/8/2010

Data do Provento – 20/8/2010

Tipo de Provento – EX B D S

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

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

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

Quantidade Original – 20,000

Valor do Prêmio Unitário Original – 0,85000000

Valor do Exercício Original – 15,00

Quantidade Ajustada – 24.000

Valor do Prêmio Unitário Ajustado – 0,30833334

Valor do Exercício Ajustado – 12,10

Observações:

1. Todos os contratos registrados na primeira data “EX Provento” deverão ter seus valores de referência baseados nos preços “EX Provento” negociados e divulgados na data;
2. Os registros retroativos de contratos, que envolvam clientes do tipo 1, na primeira data “EX Provento” deverão ter seus valores de referência baseados nos preços “EX Provento” negociados e divulgados na data;
3. Os contratos em vigência, com prerrogativa de proteção contra proventos em dinheiro, terão seus valores de referência ajustados por todos os proventos divulgados para ação objeto da opção; e.
4. Os Preços Ajustados são arredondados com 2 casas decimais e as Quantidades ajustadas são truncadas na 8ª (oitava) casa decimal.
5. Os valores de proventos serão aplicados pela Cetip pelo valor líquido.
6. Quando “Trigger – Proporção” estiver preenchido com "Sim", o ajuste de proventos irá incidir sobre o Preço de Exercício. Como neste modelo de registro o trigger é uma proporção percentual aplicada sobre o Preço de Exercício, o sistema não realizará o ajuste neste campo.

5.7 Ativos Subjacentes Disponíveis

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

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

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

Caso o Tipo Indicador seja MERCADORIA:

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

Cadastro de novos ativos subjacentes

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

5.8 Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros

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

Exemplo: LEMEM1164R5

Onde:

LEMEM = Mnemônico do participante Lançador

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

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