

MANUAL DE OPERAÇÕES

OPÇÕES FLEXÍVEIS SEM CCP

Selecione o módulo desejado

OFCC/OFVC

OPÇÕES FLEXÍVEIS (OPC)

OPÇÕES FLEXÍVEIS - VCP

OFCC/OFVC

SUMÁRIO

1. REGISTRO	4
Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros.....	5
1.1.Paridade	6
Regras para Registro de Contrato de Paridade conforme Fonte de Informação	19
1.2.Mercadoria	21
Regras para Registro de Contrato de Mercadoria	29
Opção de Mercadoria – Datas de Fixing	29
1.3.Ação Nacional	31
Regras para Registro de Contrato de Ações	40
Tratamento de Proventos	41
1.4. Índice	43
Regras para Registro de Contrato de Índice.....	51
1.5.Índices Internacionais	52
2. ALTERAÇÃO	63
Regras gerais para Alteração e Exclusão de Contrato:	64
Campos que NÃO podem ser alterados.....	74
3. EXCLUSÃO	76
4. ANTECIPAÇÃO	77
5. AVALIAÇÃO DE CONTRATO DE OPÇÃO	81
6. (NÃO) EXERCÍCIO DE CONTRATO DE OPÇÃO	85
7. CANCELAMENTO DE OPERAÇÕES	89
8. CESSÃO	92
9. CONFIRMAÇÃO DE CESSÃO	95
10. INFORMAÇÃO DE VALOR DE REBATE	97
11. CONSULTA DE CARACTERÍSTICA DE CONTRATO	98
12 . CONSULTA – ERROS EM ARQUIVOS	102
13 . CONSULTA – LANÇAMENTO	103
14 . INFORMAÇÕES ADICIONAIS	105
14.1. Cruzamento de funcionalidades.....	105
14.2. Ativos Subjacentes Disponíveis.....	105

OPC

SUMÁRIO

1. REGISTRO	108
2. REGISTRO DE CONTRATO VCP	118
2.1. VCP DE AÇÕES NACIONAIS	124
Tratamento de Proventos	126
2.2.VCP DE AÇÕES INTERNACIONAIS	127
Tratamento de Proventos	129
2.3.VCP DE ÍNDICES NACIONAIS	130
2.4.VCP DE ÍNDICES INTERNACIONAIS	132
2.5.VCP DE COMMODITIES	134
2.6. VCP DE MOEDAS	135
2.7. OPÇÕES VCP COM CESTA	136
2.8. OPÇÕES VCP COM DUPLO KNOCK OUT/IN	137
2.9. OPÇÕES VCP - ESTRATÉGIA	138
3. ALTERAÇÃO	139
4. ANTECIPAÇÃO	148
5. ATUALIZAÇÃO DE OPÇÃO - VCP	153
6. CANCELAMENTO DE OPERAÇÕES	159
7. CONSULTA DE CARACTERÍSTICAS DE CONTRATO	162
Quadro de situações possíveis	165
8. CONSULTA DE ERROS	166
9. LANÇAMENTOS PENDENTES	167
10. CONSULTA DE LANÇAMENTOS	168
11. INFORMAÇÕES ADICIONAIS	170
11.1. Como funcionam as curvas VCP:	170
11.2. VCP Informações adicionais obrigatórias	171
11.3. Curvas calculadas disponíveis e cadastro de novas curvas	171
11.4. Curvas VCP disponíveis e cadastro de novas curvas	171
11.5. Metodologia de cálculo de valores financeiros para liquidação	172
ATUALIZAÇÃO DA VERSÃO	173

1. REGISTRO

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

FORMAS DE LANÇAMENTO	FUNCIONALIDADES
Tela: Menu > Estratégias e Opções > Lançamentos > Registro de Contrato	• Opção com Verificação Europeia ou Americana • Barreiras (Knock In, Knock Out Knock In/Out) • Limitadores • Média Asiática • Proventos
Arquivo: 5.2.1 Estratégia e Opção – OFCC e OFVC - Registro	
Mensageria:	

Tela de Filtro

> Estratégias e Opções > Lançamentos > Registro de Contrato

Registro/Emissão			
Instrumento Financeiro			
Tipo	Código	Tipo Indicador	Ação
SELECIONE ▼		SELECIONE ▼	INCLUSÃO ▼
Avançar Limpar Campos			

Descrição dos Campos da Tela Filtro de Contrato – OFCC/OFVC/Box

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Tipo	Tipo de Instrumento Financeiro	Obrigatório	Caixa de Seleção: BOX2, OFCC e OFVC. OFCC = Call OFVC = Put
Código IF	Código do instrumento financeiro	Obrigatório	Geração do código IF é realizada pelo PARTICIPANTE Mnemônico do participante lançador + Dois últimos dígitos do ano + Série dada pelas partes, o primeiro dígito deve ser numérico e os outros três alfanuméricos. Ex.: GEPEN234ABC
Tipo Indicador	Informar a classe do ativo subjacente	Obrigatório	Caixa de Seleção: Paridade, Ações Nacionais, Índices, Índices Internacionais ou Mercadoria.
Ação	Ação a ser realizada no contrato	Obrigatório	Caixa de Seleção: INCLUSÃO, EXCLUSÃO ou ALTERAÇÃO.

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.

1.1.Paridade

Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato – PARIDADE

Registro de Opção - OFCC RIO M239ABK			
Parte:		.	- SELECIONE: ▼
CPF / CNPJ (Parte):			
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO ▼		
Contraparte:		.	-
CPF / CNPJ (Contraparte):			

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros) e Caixa de Seleção: TITULAR e LANÇADOR
CPF/CNPJ Cliente Parte		Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
Cesta de Garantias - Lançador	Funcionalidade descontinuada pelo Módulo de Gestão de Colateral.		Caixa de Seleção com as opções: Não (default) ou Sim. <u>Deve ser selecionada a opção Não</u>
Contraparte	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	-	Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)

Moeda Base / Ações / Índice:	SELECIONE: ▼
Moeda Cotada:	SELECIONE: ▼
Data Início:	/ /
Data Vencimento:	/ /
Preço Exercício:	,
Prêmio Unitário:	,
Data de Liquidação do Prêmio:	/ /
Valor Base / Quantidade:	,
Limite:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Moeda Base/Ações/Índice	É o ativo-subjacente da opção.	Obrigatório	As moedas disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCAO. Caixa de seleção com a lista de moedas 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. <u>O capítulo Informações Adicionais</u> <u>exibe as possíveis combinações.</u>
Moeda Cotada	Indica a moeda de referência em que a Moeda Base é cotada.	Obrigatório	Caixa de seleção com a lista de moedas. As moedas disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCAO. A Moeda Cotada não pode ser igual à Moeda Base.
Data de Início	Data de seu registro no Módulo.	Obrigatório	Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Tipo: DD/MM/AAAA.
Data de Vencimento	Data do exercício da opção.	Obrigatório	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Tipo: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Preço de Exercício	Valor da taxa de câmbio ou preço da Ação/Índice contratado entre Titular e Lançador para o exercício da opção.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 6 (seis) decimais para moeda US\$ (Dólar dos Estados Unidos), com até 8 (oito) decimais para demais moedas. A precisão da paridade se dá de acordo com a Moeda Base.
Prêmio Unitário	Preço unitário, em Reais, pago pelo Titular ao Lançador, na data de registro.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 8 (oito) decimais
Data de Liquidação do Prêmio	Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada, o sistema utiliza a data de registro para data de liquidação do prêmio	Obrigatório	A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento. Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da B3 Tipo: DD/MM/AAAA.
Valor Base/ Quantidade	Valor Base em moeda estrangeira	Obrigatório	14 casas inteiras e 8 casas decimais.

Limite: ,

Tipo de Exercício:	SELECIONE: ▼
Barreiras:	SELECIONE: ▼
Liquidante:	. -
Modalidade:	SELECIONE: ▼
Adesão a Contrato:	▼
Meu Número:	
Intermediador:	. -
Comissão paga pelo Titular em R\$:	,
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	,
Cross-Rate na Avaliação?:	☐
Média para Opção Asiática:	SELECIONE: ▼
Datas de Verificação:	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limite	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.	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda. Pode ser informado para contrato com Barreira. Tipo: Numérico: 14 (quartoze) inteiros, caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais.
Tipo de Exercício	Indica quando o titular poderá exercer a opção.	Obrigatório	Caixa de seleção Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício. Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de exercício. Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Barreiras	Indica qual o tipo de barreira que o contrato possui	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Caixa de Seleção: Knock In, Knock Out e Knock In-Out.
Trigger In	Cotação indicada para determinar a efetivação do contrato, quando este for atingido.	Condicional	Informar quando tipo de Barreira for igual à Knock In ou Knock In-Out. Tipo: Numérico: 14(quatorze), caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Trigger Out	Cotação indicada para determinar a rescisão do contrato, quando este for atingido.	Condicional	Informar quando tipo de Barreira for igual à Knock Out ou Knock In-Out. Tipo: Numérico: 14(quatorze), caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Trigger - Proporção	Quando marcado indica que o Trigger In e/ou Trigger Out é na forma de percentual do Preço de Exercício	Condicional	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. Tipo: Caixa de Seleção Para maiores informações, consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.
Tipo de Disparo	As barreiras podem ser classificadas de duas maneiras: - Baixa (down) - Alta (up)	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de Seleção: ALTA e BAIXA
Forma de Disparo	CONTÍNUO: verifica se houve disparo observando os tipos de cotação "Máxima" e "Mínima" do indicador. DISCRETO: o sistema verifica se houve disparo observando o tipo de cotação "Fechamento" ou "Ajuste" (dependendo da classe do indexador).	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de seleção com as opções: CONTINUO e DISCRETO Para Paridade, apenas DISCRETO está disponível.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Forma de Verificação	Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i> forem preenchidos. Caixa de Seleção com as opções: <i>Diária</i> ou <i>Final</i>
Rebate	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> .	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>. Caixa de seleção com as opções: 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); 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); Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).
Rebate Unitário	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.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro. Tipo: Numérico(10(dez) inteiros e 8(oito) decimais)
Liquidação do Rebate	Define a ocasião da liquidação financeira do rebate.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Liquidação, no campo Rebate. Caixa de seleção com as opções: <i>Vencimento</i> e <i>Trigger Out</i>.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			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. 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>.
Liquidante	Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante. Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Modalidade	Forma de liquidação financeira do valor correspondente ao prêmio e ao valor da comissão a ser paga pela intermediação.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório. Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.

Adesão a Contrato:	
Meu Número:	
Intermediador:	. -
Comissão paga pelo Titular em R\$:	,
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Adesão do Contrato	Indica se o contrato que está sendo registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos.	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Vazio, Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico. (até 8(oito) dígitos)
Intermediador	Código da conta de intermediação do Participante <i>intermediador</i> na operação de opção.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório se um dos campos de comissão for preenchido. Campo: Tipo de conta: 69
Comissão paga pelo <i>Titular</i> em R\$	Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Titular</i> ao <i>Intermediador</i> .	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros
Comissão paga pelo <i>Lançador</i> em R\$	Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo <i>Lançador</i> ao <i>Intermediador</i> .	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros

Cross-Rate na Avaliação?:	☐
Média para Opção Asiática:	SELECIONE: 
Datas de Verificação:	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cross Rate na Avaliação	É a taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Exclusivo para opção de paridade. 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.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Média para opção Asiática		Condicional	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	Informar as referidas datas para formação da média asiática. Clique no botão Informar Datas é exibida tela para indicar as datas de referência para cálculo da média.	Condicional	Campo Obrigatório quando opção for Média Asiática. Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. A data indicada pode ser feriado, mas não é aceito datas de finais de semana. A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de ajustes, vencimento, antecipação informadas aplicando-se o deslocamento indicado. Devem ser indicadas, pelo menos, uma data de verificação e no máximo 500. *Mais informações sobre o deslocamento, consultar a

Registro Opção de Paridade - Sisbacen/Feeder

Fonte de Informação:	SISBACEN/FEEDER		
Cotação para o Vencimento:	SELECIONE:		
Boletim:	PTAX800	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 :			

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Fonte de informação	Indicar fonte da captura das cotações	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder e Spot.
Cotação para o Vencimento	Determina a data da cotação da moeda objeto da opção.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: D-1 e D-2
Boletim	Boletins intermediários e de fechamento de cotação de venda da moeda.	Obrigatório	Caixa de seleção com a opção PTAX800 e horário do boletim (18h00minh-Fechamento).

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Fonte de Consulta	Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda.	Obrigatório	Caixa de seleção com as seguintes opções: Reuters, Bloomberg, Broadcast, Spot e Outros.
Outra fonte de consulta	Campo livre para descrição de outra fonte de consulta, caso o item Outros tenha sido escolhido na caixa de seleção Fonte de Consulta.	Obrigatório	Campo livre.
Tela ou função de consulta	Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que será utilizada pelos participantes para cotação..	Obrigatório	Campo livre.
Praça de negociação	Local de negociação da moeda se Opção sobre taxa de câmbio e fonte de informação Feeder, Sisbacen/Feeder ou Spot.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório. Campo livre.
Horário de consulta	Horário de verificação da taxa de câmbio.	Obrigatório	Campo livre.
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	Informação do tipo de cotação para a taxa de câmbio, a ser informada na tela de avaliação	Obrigatório	Caixa de seleção: venda.
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Informação da paridade a ser utilizada na tela de avaliação	Obrigatório	Caixa de seleção: compra, venda ou média.
Data de avaliação	Data pactuada entre as partes para avaliação do contrato mediante informação da taxa de câmbio e paridade.	Obrigatório	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. Tipo: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Observação	Complemento da descrição do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Com até 280 caracteres.

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:	
EnviarLimpar CamposVoltar	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cotação para o Vencimento	Determina a data da cotação da moeda objeto da opção.	Obrigatório	Para a fonte de informação Feeder ou Spot são apresentadas as opções: D0, D-1 e D-2.
Fonte de Consulta	Nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda	Obrigatório	Caixa de seleção. Quando Fonte de Informação Feeder é exibida as opções: Reuters, Bloomberg, Broadcast e Outros. Quando Fonte de Informação Spot é exibida a opção: Spot.
Outra fonte de consulta	Descrição de outra fonte de consulta, caso o item Outros tenha sido escolhido na caixa de seleção Fonte de Consulta.	Obrigatório	Campo livre.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Tela ou função de consulta	Nome da função de consulta ou código da tela, que será utilizada pelos participantes para cotação.	Obrigatório	Campo livre.
Praça de negociação	Local de negociação da moeda se Opção sobre taxa de câmbio e fonte de informação Feeder, Sisbacen/Feeder ou Spot.	Obrigatório	Campo livre.
Horário de consulta	Horário de verificação da taxa de câmbio.	Obrigatório	Campo livre. Não pode ser informado quando indicador financeiro forem Ações.
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	Informação do tipo de cotação para a taxa de câmbio, a ser informada na tela de avaliação.	Obrigatório	Para Fonte de Informação Feeder compra, venda média ou nenhuma . Para Fonte de Informação Spot: compra, venda ou média . Se indicador financeiro for Ação, deve ser selecionada a opção nenhuma.
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Informação da paridade a ser utilizada na tela de avaliação.	Obrigatório	Caixa de seleção: Para Fonte de Informação Feeder: compra, venda média ou nenhuma. Se indicador financeiro for Ação, deve ser selecionada a opção nenhuma. Para Fonte de Informação Spot: nenhuma.
Data de avaliação	Data pactuada entre as partes para avaliação do contrato mediante informação da paridade ou Cotação.	Obrigatório	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. Tipo: DD/MM/AAAA.
Observação	Complemento da descrição do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Com até 280 caracteres.

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	Nenhum
	Compra	
	Média	
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	Nenhum
	Compra	
	Média	

Não é possível informar Tipo-Paridade e *Cross Rate*

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	Venda ou Compra ou Média
	Compra	
	Média	

É obrigatório informar Tipo-Paridade e *Cross Rate*

Não é permitida Fonte de Consulta **Spot**

1.2. Mercadoria

Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato – MERCADORIA

Registro de Opção - OFCC RIO M239ABK			
Parte:		.	- SELECIONE: ▼
CPF / CNPJ (Parte):			
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO ▼		
Contraparte:		.	-
CPF / CNPJ (Contraparte):			

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros) e Caixa de Seleção: TITULAR e LANÇADOR
CPF/CNPJ Cliente Parte		Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
Cesta de Garantias - Lançador	Funcionalidade descontinuada pelo Módulo de Gestão de Colateral.		Caixa de Seleção com as opções: Não (default) ou Sim. <u>Deve ser selecionada a opção Não</u>
Contraparte	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	-	Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)

Mercadoria:	
Data Início:	/ /
Data Vencimento:	/ /
Preço Exercício:	,
Preço de Exercício em Reais:	☐
Prêmio Unitário:	,
Data de Liquidação do Prêmio:	/ /
Opção Quanto:	☐
Cotação para Opção Quanto:	,
Valor Base / Quantidade:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Mercadoria	É o ativo-subjacente da opção.	Obrigatório	Deve ser indicado o código da mercadoria. O código da mercadoria pode ser consultado no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias
Data de Início	Data de seu registro no Módulo.	Obrigatório	Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Tipo: DD/MM/AAAA.
Data de Vencimento	Data do exercício da opção.	Obrigatório	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Tipo: DD/MM/AAAA.
Preço de Exercício	Valor da mercadoria contratada entre Titular e Lançador para o exercício da opção.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 8 (oito) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com 0(zeros).
Prêmio Unitário	Preço unitário, em Reais, pago pelo Titular ao Lançador, na data de registro.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 8 (oito) decimais
Data de Liquidação do Prêmio	Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada, o sistema utiliza a data de registro para data de liquidação do prêmio	Obrigatório	A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento. Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da B3 Tipo: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Opção Quanto	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.	Opcional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Permitido para mercadoria cotada em moeda diferente do real. O valor do exercício é apurado pela multiplicação da diferença de cotações (em moeda estrangeira) e a quantidade do contrato. Tipo: Caixa de Seleção
Cotação para Opção Quanto	Valor da cotação para Opção Quanto.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando campo "Opção Quanto" for indicado.
Valor Base/ Quantidade	Quantidade de mercadorias	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 14 casas inteiras e 8 casas decimais.

Limite: , Tipo de Exercício: SELECIONE: Barreiras: SELECIONE: Liquidante: . - Modalidade: SELECIONE: Adesão a Contrato: Meu Número: Intermediador: . - Comissão paga pelo Titular em R\$: , Comissão paga pelo Lançador em R\$: , Cross-Rate na Avaliação?: ☐Média para Opção Asiática: SELECIONE:

Datas de Verificação:

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limite	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.	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda. Pode ser informado para contrato com Barreira. Tipo: Numérico: 14(quatorze), caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Tipo de Exercício	Indica quando o titular poderá exercer a opção.	Obrigatório	Caixa de seleção Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício. Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de exercício. Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática
Barreiras	Indica qual o tipo de barreira que o contrato possui	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Caixa de Seleção: Knock In, Knock Out e Knock In-Out.
Trigger In	Cotação indicada para determinar a efetivação do contrato, quando este for atingido.	Condicional	Informar quando tipo de Barreira for igual à Knock In ou Knock In-Out. Tipo: Numérico: Tipo: Numérico: 14(quatorze) inteiros, caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Trigger Out	Cotação indicada para determinar a rescisão do contrato, quando este for atingido.	Condicional	Informar quando tipo de Barreira for igual à Knock Out ou Knock In-Out. Tipo: Numérico: Tipo: Numérico: 14(quatorze) inteiros, caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Trigger - Proporção	Quando marcado indica que o Trigger In e/ou Trigger Out é na forma de percentual do Preço de Exercício	Condicional	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. Tipo: Caixa de Seleção Para maiores informações, consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Tipo de Disparo	As barreiras podem ser classificadas de duas maneiras: - Baixa (down) - Alta (up)	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de Seleção: ALTA e BAIXA
Forma de Disparo	CONTÍNUO: verifica se houve disparo observando os tipos de cotação “Máxima” e “Mínima” do indicador. DISCRETO: o sistema verifica se houve disparo observando o tipo de cotação “Fechamento” ou “Ajuste” (dependendo da classe do indexador).	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de seleção com as opções: CONTINUO e DISCRETO
Forma de Verificação	Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de Seleção com as opções: Diária ou Final
Rebate	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> .	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i> . Caixa de seleção com as opções: 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); 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); Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).
Rebate Unitário	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.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro , no campo Rebate . O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Tipo: Numérico(10(dez) inteiros e 8(oito) decimais)
Liquidação do Rebate	Define a ocasião da liquidação financeira do rebate.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Liquidação, no campo Rebate. Caixa de seleção com as opções: Vencimento e <i>Trigger Out</i>. 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. 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>.
Liquidante	Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante. Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Modalidade	Forma de liquidação financeira do valor correspondente ao prêmio e ao valor da comissão a ser paga pela intermediação.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório. Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.

Adesão a Contrato:	
Meu Número:	
Intermediador:	. -
Comissão paga pelo Titular em R\$:	,
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Adesão do Contrato	Indica se o contrato que está sendo registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos.	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Vazio, Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico. (até 8(oito) dígitos)
Intermediador	Código da conta de intermediação do Participante intermediador na operação de opção.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório se um dos campos de comissão for preenchido. Campo: Tipo de conta: 69
Comissão paga pelo Titular em R\$	Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo Titular ao Intermediador.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros
Comissão paga pelo Lançador em R\$	Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo Lançador ao Intermediador.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros

Média para Opção Asiática:

SELECIONE: ▼

Datas de Verificação:

Informar Datas

Cotação para o Vencimento:

SELECIONE: ▼

Cotação para Moeda:

SELECIONE: ▼

Observação :

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cross Rate na Avaliação	É a taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Exclusivo para opção de paridade. 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		Opcional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa de seleção com as opções: 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	Informar as referidas datas para formação da média asiática. Clique no botão Informar Datas é exibida tela para indicar as datas de referência para cálculo da média.	Condicional	Campo Obrigatório quando opção for Média Asiática. Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. A data indicada pode ser feriado, mas não é aceito datas de finais de semana. A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de ajustes, vencimento, antecipação informadas aplicando-se o deslocamento indicado.

REGISTRO

ALTERAÇÃO

EXCLUSÃO

ANTECIPAÇÃO

AVALIAÇÃO

(NÃO) EXERCÍCIO

CANCELAMENTO

REBATE

CESSÃO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

+INFOS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Devem ser indicadas, pelo menos, uma data de verificação e no máximo 500. A última data deve coincidir com o vencimento do contrato. *Mais informações sobre o deslocamento, consultar a seção “Opção de Mercadoria – Datas de Fixing”.
Cotação para o Vencimento	Cotação para o Vencimento da Mercadoria. Determina a data da cotação da mercadoria objeto da opção.	Obrigatório	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”.
Cotação para Moeda	Determina a data da cotação da moeda cotada do objeto da opção.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.
Observação	Complemento da descrição do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Com até 200 (duzentos) caracteres

Regras para Registro de Contrato de Mercadoria

Principais campos:

Moeda Base/Ações/ Mercadorias		Moeda Cotada
Mercadorias		Real

As cotações relativas às Mercadorias são capturadas automaticamente

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 Subsistema de Registro do Balcão B3.

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.

1.3. Ação Nacional

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.

Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato – AÇÃO NACIONAL

Registro de Opção - OFCC RIO M239ABK			
Parte:		.	- SELECIONE: ▼
CPF / CNPJ (Parte):			
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO ▼		
Contraparte:		.	-
CPF / CNPJ (Contraparte):			

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros) e Caixa de Seleção: TITULAR e LANÇADOR
CPF/CNPJ Cliente Parte		Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
Cesta de Garantias - Lançador	Funcionalidade descontinuada pelo Módulo de Gestão de Colateral.		Caixa de Seleção com as opções: Não (default) ou Sim. <u>Deve ser selecionada a opção Não</u>
Contraparte	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	-	Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)

Moeda Base / Ações / Índice:	SELECIONE: ▼
Moeda Cotada:	SELECIONE: ▼
Data Início:	/ /
Data Vencimento:	/ /
Preço Exercício:	,
Prêmio Unitário:	,
Data de Liquidação do Prêmio:	/ /
Valor Base / Quantidade:	,
Limite:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Moeda Base/Ações/ Índice	É o ativo-subjacente da opção.	Obrigatório	Indica a classe do ativo-subjacente. Caixa de seleção - Opção única: Ações Nacionais.
Moeda Cotada	Indica a moeda de referência em que a ativo-subjacente é cotado.	Obrigatório	Indica a moeda de referência em que a Ação é cotada. Caixa de seleção - Opção única: Real.
Data de Início	Data de seu registro no Módulo.	Obrigatório	Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Tipo: DD/MM/AAAA.
Data de Vencimento	Data do exercício da opção.	Obrigatório	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Tipo: DD/MM/AAAA.

SUMÁRIO

REGISTRO

ALTERAÇÃO

EXCLUSÃO

ANTECIPAÇÃO

AVALIAÇÃO

(NÃO) EXERCÍCIO

CANCELAMENTO

REBATE

CESSÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

+INFOS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Preço de Exercício	Valor da taxa de câmbio ou preço da Ação/Índice contratado entre Titular e Lançador para o exercício da opção.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 8 (oito) casas decimais para demais moedas e com até 2 (duas) casas decimais
Prêmio Unitário	Preço unitário, em Reais, pago pelo Titular ao Lançador, na data de registro.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 8 (oito) decimais
Data de Liquidação do Prêmio	Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada, o sistema utiliza a data de registro para data de liquidação do prêmio.	Obrigatório	A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento. Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da B3 Tipo: DD/MM/AAAA.
Valor Base/Quantidade	Quantidade de ações.	Obrigatório	14 casas inteiras e 8 casas decimais.

Limite:

Tipo de Exercício:

SELECIONE:

Barreiras:

SELECIONE:

Liquidante:

.

-

Modalidade:

SELECIONE:

Adesão a Contrato:

Meu Número:

Intermediador:

.

-

Comissão paga pelo Titular em R\$:

,

Comissão paga pelo Lançador em R\$:

,

Cross-Rate na Avaliação?:

Média para Opção Asiática:

SELECIONE:

Datas de Verificação:

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limite	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.	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda. Pode ser informado para contrato com Barreira. Tipo: Numérico: 14(quatorze) inteiros, caso US\$, até 2(dois) decimais
Tipo de Exercício	Indica quando o titular poderá exercer a opção.	Obrigatório	Caixa de seleção Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício. Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de exercício. Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática
Barreiras	Indica qual o tipo de barreira que o contrato possui	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Caixa de Seleção: Knock In, Knock Out e Knock In-Out.
Trigger In	Cotação indicada para determinar a efetivação do contrato, quando este for atingido.	Condicional	Informar quando tipo de Barreira for igual à Knock In ou Knock In-Out. Tipo: Numérico: Caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Trigger Out	Cotação indicada para determinar a rescisão do contrato, quando este for atingido.	Condicional	Informar quando tipo de Barreira for igual à Knock Out ou Knock In-Out. Tipo: Numérico: Caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Trigger - Proporção	Quando marcado indica que o Trigger In e/ou Trigger Out é na forma de percentual do Preço de Exercício	Condicional	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. Tipo: Caixa de Seleção Para maiores informações, consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Tipo de Disparo	As barreiras podem ser classificadas de duas maneiras: Baixa (down) Alta (up)	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de Seleção: ALTA e BAIXA
Forma de Disparo	CONTÍNUO: verifica se houve disparo observando os tipos de cotação “Máxima” e “Mínima” do indicador. DISCRETO: o sistema verifica se houve disparo observando o tipo de cotação “Fechamento” ou “Ajuste” (dependendo da classe do indexador).	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de seleção com as opções: CONTINUO e DISCRETO
Forma de Verificação	Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de Seleção com as opções: Diária ou Final
Rebate	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> .	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i> . Caixa de seleção com as opções: 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); 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); Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).
Rebate Unitário	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</i>	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro , no campo Rebate .

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	Out), até a data de vencimento do contrato.		O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro. Tipo: Numérico(10(dez) inteiros e 8(oito) decimais)
Liquidação do Rebate	Define a ocasião da liquidação financeira do rebate.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Liquidação , no campo Rebate . Caixa de seleção com as opções: Vencimento e <i>Trigger Out</i> . 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. 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> .
Liquidante	Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante. Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Modalidade	Forma de liquidação financeira do valor correspondente ao prêmio e ao valor da comissão a ser paga pela intermediação.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório. Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.

Adesão a Contrato:	
Meu Número:	
Intermediador:	. -
Comissão paga pelo Titular em R\$:	,
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	,

SUMÁRIO

REGISTRO

ALTERAÇÃO

EXCLUSÃO

ANTECIPAÇÃO

AValiação

(NÃO) EXERCÍCIO

CANCELAMENTO

REBATE

CESSÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

+INFOS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Adesão do Contrato	Indica se o contrato que está sendo registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos.	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Vazio, Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico. (até 8(oito) dígitos)
Intermediador	Código da conta de intermediação do Participante intermediador na operação de opção.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório se um dos campos de comissão for preenchido. Campo: Tipo de conta: 69
Comissão paga pelo Titular em R\$	Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo Titular ao Intermediador.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros
Comissão paga pelo Lançador em R\$	Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo Lançador ao Intermediador.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros

Cross-Rate na Avaliação?:

Média para Opção Asiática:

SELECIONE:

Datas de Verificação:

Cotação para o Vencimento:	SELECIONE: ▼
Ação:	SELECIONE: ▼
Ajuste de Proventos pelas Partes:	SELECIONE: ▼
Proteção contra Provento em Dinheiro:	SELECIONE: ▼
Observação :	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cross Rate na Avaliação	É a taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Exclusivo para opção de paridade. O uso desta opção não é permitido, quando Ação.
Média para opção Asiática		Condicional	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	Informar as referidas datas para formação da média asiática. Clique no botão Informar Datas é exibida tela para indicar as datas de referência para cálculo da média.	Condicional	Campo Obrigatório quando opção for Média Asiática.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. A data indicada pode ser feriado, mas não é aceito datas de finais de semana. A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de ajustes, vencimento, antecipação informadas aplicando-se o deslocamento indicado. Devem ser indicadas, pelo menos, uma data de verificação e no máximo 500. <i>*Mais informações sobre o deslocamento, consultar a seção “Opção de Mercadoria – Datas de Fixing”.</i>
Cotação para o Vencimento	Cotação para o Vencimento da Ação. Determina a data da cotação da mercadoria objeto da opção.	Obrigatório	Caixa de seleção: D-1; D-2; D-3; D-4; D-5.
Ação	Indica o ativo-subjacente da opção.	Obrigatório	Caixa de seleção com os códigos das ações disponíveis. As ações disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores OPC AO.
Ajuste de Proventos pelas partes		Obrigatório	Deve ser selecionada a opção Não.
Proteção contra Provento em Dinheiro	Indica se haverá proteção contra-proventos.	Obrigatório	Também se aplica para proventos em quantidade.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			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. Caixa de seleção com as opções Sim ou Não 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. 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. Consulte Seção – Tratamento de Proventos
Observação	Complemento da descrição do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Com até 200 (duzentos) caracteres

Regras para Registro de Contrato de 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	Opções: Não e Sim

As cotações relativas às ações são capturadas automaticamente da Reuters.

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 B3 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.

1.4. Índice

Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato – ÍNDICE

Registro de Opção - OFCC RIO M239ABK			
Parte:		.	- SELECIONE: ▼
CPF / CNPJ (Parte):			
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO ▼		
Contraparte:		.	-
CPF / CNPJ (Contraparte):			

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros) e Caixa de Seleção: TITULAR e LANÇADOR
CPF/CNPJ Cliente Parte		Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
Cesta de Garantias - Lançador	Funcionalidade descontinuada pelo Módulo de Gestão de Colateral.		Caixa de Seleção com as opções: Não (default) ou Sim. Deve ser selecionada a opção Não
Contraparte	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	-	Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)

Moeda Base / Ações / Índice:	SELECIONE: ▼
Moeda Cotada:	SELECIONE: ▼
Data Início:	/ /
Data Vencimento:	/ /
Preço Exercício:	,
Prêmio Unitário:	,
Data de Liquidação do Prêmio:	/ /
Valor Base / Quantidade:	,
Limite:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Moeda Base/Ações/ Índice	É o ativo-subjacente da opção.	Obrigatório	Caixa de seleção com a lista de índices. Os Índices disponíveis podem ser consultados no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCA O. 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.
Moeda Cotada	Indica a moeda de referência em que a Moeda Base é cotada.	Obrigatório	Caixa de seleção com a lista de moedas. As moedas disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCA O. A Moeda Cotada não pode ser igual à Moeda Base.
Data de Início	Data de seu registro no Módulo.	Obrigatório	Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Tipo: DD/MM/AAAA.
Data de Vencimento	Data do exercício da opção.	Obrigatório	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Tipo: DD/MM/AAAA.
Preço de Exercício	Valor da taxa de câmbio ou preço da Ação/Índice contratado entre Titular e Lançador para o exercício da opção.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 6 (seis) inteiros para moeda e 2 (duas) casas decimais para índices, caso contrário, o Módulo preenche com zeros.
Prêmio Unitário	Preço unitário, em Reais, pago pelo Titular ao Lançador, na data de registro.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 8 (oito) decimais

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data de Liquidação do Prêmio	Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada, o sistema utiliza a data de registro para data de liquidação do prêmio	Obrigatório	A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento. Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da B3 Tipo: DD/MM/AAAA.
Valor Base/Quantidade	Quantidade de contratos de índice	Obrigatório	14 casas inteiras e 8 casas decimais.

Limite:		,	
Tipo de Exercício:	SELECIONE: v		
Barreiras:	SELECIONE: v		
Liquidante:		.	-
Modalidade:	SELECIONE: v		
Adesão a Contrato:	v		
Meu Número:			
Intermediador:		.	-
Comissão paga pelo Titular em R\$:		,	
Comissão paga pelo Lançador em R\$:		,	
Cross-Rate na Avaliação?:	☐		
Média para Opção Asiática:	SELECIONE: v		
Datas de Verificação:			

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limite	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.	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda. Pode ser informado para contrato com Barreira. Tipo: Numérico: 14 (quatorze) inteiros, 8(oito) decimais.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Tipo de Exercício	Indica quando o titular poderá exercer a opção.	Obrigatório	Caixa de seleção Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício. Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de exercício. Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática
Barreiras	Indica qual o tipo de barreira que o contrato possui	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Caixa de Seleção: Knock In, Knock Out e Knock In-Out.
Trigger In	Cotação indicada para determinar a efetivação do contrato, quando este for atingido.	Condicional	Informar quando tipo de Barreira for igual à Knock In ou Knock In-Out. Tipo: Numérico: Caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Trigger Out	Cotação indicada para determinar a rescisão do contrato, quando este for atingido.	Condicional	Informar quando tipo de Barreira for igual à Knock Out ou Knock In-Out. Tipo: Numérico: Caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Trigger - Proporção	Quando marcado indica que o Trigger In e/ou Trigger Out é na forma de percentual do Preço de Exercício	Condicional	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. Tipo: Caixa de Seleção Para maiores informações, consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.
Tipo de Disparo	As barreiras podem ser classificadas de duas maneiras: - Baixa (down) - Alta (up)	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de Seleção: ALTA e BAIXA
Forma de Disparo	CONTÍNUO: verifica se houve disparo observando os tipos de cotação “Máxima” e “Mínima” do indicador. DISCRETO: o sistema verifica se houve disparo	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de seleção com as opções: CONTINUO e DISCRETO

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	observando o tipo de cotação “Fechamento” ou “Ajuste” (dependendo da classe do indexador).		
Forma de Verificação	Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de Seleção com as opções: Diária ou Final
Rebate	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> .	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>. Caixa de seleção com as opções: 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); 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); Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).
Rebate Unitário	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.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro. Tipo: Numérico(10(dez) inteiros e 8(oito) decimais)
Liquidação do Rebate	Define a ocasião da liquidação financeira do rebate.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Liquidação, no campo Rebate. Caixa de seleção com as opções: Vencimento e <i>Trigger Out</i>.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			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. 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>.
Liquidante	Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda.	Condicional	Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante. Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Modalidade	Forma de liquidação financeira do valor correspondente ao prêmio e ao valor da comissão a ser paga pela intermediação.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório. Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.

Adesão a Contrato:	
Meu Número:	
Intermediador:	. -
Comissão paga pelo Titular em R\$:	,
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Adesão do Contrato	Indica se o contrato que está sendo registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos.	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Vazio, Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico. (até 8(oito) dígitos)

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Intermediador	<i>Código da conta de intermediação do Participante intermediador na operação de opção.</i>	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório se um dos campos de comissão for preenchido. Campo: Tipo de conta: 69
Comissão paga pelo Titular em R\$	<i>Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo Titular ao Intermediador.</i>	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros
Comissão paga pelo Lançador em R\$	<i>Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo Lançador ao Intermediador.</i>	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros

Média para Opção Asiática:	SELECIONE: ▼
Datas de Verificação:	Informar Datas
Cotação para o Vencimento:	SELECIONE: ▼
Observação :	
EnviarLimpar CamposVoltar	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cross Rate na Avaliação	É a taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Exclusivo para opção de paridade.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			O uso desta opção não é permitido, quando Índice ou quando a Fonte de Informação for Sisbacen ou Spot.
Média para Opção Asiática		Condicional	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	Informar as referidas datas para formação da média asiática. Clique no botão Informar Datas é exibida tela para indicar as datas de referência para cálculo da média.	Condicional	Campo Obrigatório quando opção for Média Asiática. Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. A data indicada pode ser feriado, mas não é aceito datas de finais de semana. A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de ajustes, vencimento, antecipação informadas aplicando-se o deslocamento indicado. Devem ser indicadas, pelo menos, uma data de verificação e no máximo 500. *Mais informações sobre o deslocamento, consultar a seção

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			“Opção de Mercadoria – Datas de Fixing”.
Cotação para o Vencimento	Determina a data da cotação do índice objeto da opção.	Obrigatório	Caixa de seleção: D0, D-1, D-2, D-3.
Fonte de Consulta		Opcional	Caixa de seleção: B3 e CETIP.
Observação	Complemento da descrição do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Com até 200 (duzentos) caracteres

Regras para Registro de Contrato de Índice

Principais campos:

Moeda Base/Ações/Índices	Moeda Cotada	Cross Rate	Boletim
DI	Real	Não se aplica	Não se aplica
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 têm como fonte de consulta a B3.

As cotações relativas ao índice internacional são capturadas automaticamente.

1.5. Índices Internacionais

Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato – ÍNDICES INTERNACIONAIS

Registro de Opção - OFCC RIO M239ABK			
Parte:		.	- SELECIONE: ▼
CPF / CNPJ (Parte):			
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO ▼		
Contraparte:		.	-
CPF / CNPJ (Contraparte):			

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros) e Caixa de Seleção: TITULAR e LANÇADOR
CPF/CNPJ Cliente Parte		Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
Cesta de Garantias - Lançador	Funcionalidade descontinuada pelo Módulo de Gestão de Colateral.		Caixa de Seleção com as opções: Não (default) ou Sim. <u>Deve ser selecionada a opção Não</u>
Contraparte	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	-	Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)

CPF / CNPJ (Contraparte):	
Moeda Base / Ações / Índice:	SELECIONE:
Data Início:	/ /
Data Vencimento:	/ /
Preço Exercício:	,
Prêmio Unitário:	,
Data de Liquidação do Prêmio:	/ /
Valor Base / Quantidade:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Moeda Base/Ações/ Índice	É o ativo-subjacente da opção.	Obrigatório	Caixa de seleção com a lista de índices internacionais. Os Índices disponíveis podem ser consultados no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCA O. 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.
Data de Início	Data de seu registro no Módulo.	Obrigatório	Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Tipo: DD/MM/AAAA.
Data de Vencimento	Data do exercício da opção.	Obrigatório	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Tipo: DD/MM/AAAA.
Preço de Exercício	Valor da taxa de câmbio ou preço da Ação/Índice contratado entre Titular e Lançador para o exercício da opção.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 6 (seis) inteiros para moeda e 2 (duas) casas decimais para índices, caso contrário, o Módulo preenche com zeros.
Prêmio Unitário	Preço unitário, em Reais, pago pelo Titular ao Lançador, na data de registro.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 8 (oito) decimais
Data de Liquidação do Prêmio	Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada, o sistema utiliza a data de registro para data de liquidação do prêmio	Obrigatório	A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento. Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da B3 Tipo: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Valor Base/ Quantidade	Quantidade de contratos de índice	Obrigatório	14 casas inteiras e sem decimais.

Limite:		,	
Tipo de Exercício:	SELECIONE: v		
Barreiras:	SELECIONE: v		
Liquidante:		.	-
Modalidade:	SELECIONE: v		
Adesão a Contrato:	v		
Meu Número:			
Intermediador:		.	-
Comissão paga pelo Titular em R\$:		,	
Comissão paga pelo Lançador em R\$:		,	
Cross-Rate na Avaliação?:	☐		
Média para Opção Asiática:	SELECIONE: v		
Datas de Verificação:			

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limite	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.	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda. Pode ser informado para contrato com Barreira. Tipo: Numérico: 14(quatorze) inteiros e 8(oito) decimais.
Tipo de Exercício	Indica quando o titular poderá exercer a opção.	Obrigatório	Caixa de seleção Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de exercício. Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática
Barreiras	Indica qual o tipo de barreira que o contrato possui	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Caixa de Seleção: Knock In, Knock Out e Knock In-Out.
Trigger In	Cotação indicada para determinar a efetivação do contrato, quando este for atingido.	Condicional	Informar quando tipo de Barreira for igual à Knock In ou Knock In-Out. Tipo: Numérico: Caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Trigger Out	Cotação indicada para determinar a rescisão do contrato, quando este for atingido.	Condicional	Informar quando tipo de Barreira for igual à Knock Out ou Knock In-Out. Tipo: Numérico: Caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais
Trigger - Proporção	Quando marcado indica que o Trigger In e/ou Trigger Out é na forma de percentual do Preço de Exercício	Condicional	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. Tipo: Caixa de Seleção Para maiores informações, consulte Caderno de Fórmulas de Opções Flexíveis.
Tipo de Disparo	As barreiras podem ser classificadas de duas maneiras: - Baixa (down) - Alta (up)	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de Seleção: ALTA e BAIXA
Forma de Disparo	CONTÍNUO: verifica se houve disparo observando os tipos de cotação "Máxima" e "Mínima" do indicador. DISCRETO: o sistema verifica se houve disparo observando o tipo de cotação "Fechamento" ou "Ajuste" (dependendo da classe do indexador).	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de seleção com as opções: CONTINUO e DISCRETO

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Forma de Verificação	Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i> forem preenchidos. Caixa de Seleção com as opções: Diária ou Final
Rebate	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> .	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>. Caixa de seleção com as opções: 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); 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); Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).
Rebate Unitário	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.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro. Tipo: Numérico (10(dez) inteiros e 8(oito) decimais)
Liquidação do Rebate	Define a ocasião da liquidação financeira do rebate.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Liquidação, no campo Rebate. Caixa de seleção com as opções: Vencimento e <i>Trigger Out</i>. 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. Opção Trigger Out é válida para contratos com <i>Trigger Out</i> ou

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			<i>Trigger In-Out</i> , a liquidação ocorre no disparo do <i>Trigger Out</i> .
Liquidante	Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda.	Condicional	Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante. Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Modalidade	Forma de liquidação financeira do valor correspondente ao prêmio e ao valor da comissão a ser paga pela intermediação.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório. Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.

Adesão a Contrato:	
Meu Número:	
Intermediador:	. -
Comissão paga pelo Titular em R\$:	,
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Adesão do Contrato	Indica se o contrato que está sendo registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos.	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Vazio, Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico. (até 8(oito) dígitos)
Intermediador	Código da conta de intermediação do Participante intermediador na operação de opção.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório se um dos campos de comissão for preenchido. Campo: Tipo de conta: 69

SUMÁRIO				REGISTRO
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras	ALTERAÇÃO
Comissão paga pelo Titular em R\$	Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo Titular ao Intermediador.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros	EXCLUSÃO
Comissão paga pelo Lançador em R\$	Valor em Reais, da comissão a ser paga pelo Lançador ao Intermediador.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher com 2 (duas) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros	ANTECIPAÇÃO

Cross-Rate na Avaliação?:	☐
Média para Opção Asiática:	SELECIONE: 
Datas de Verificação:	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras	(NÃO) EXERCÍCIO
Cross Rate na Avaliação	É a taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Exclusivo para opção de paridade. O uso desta opção não é permitido, quando Índice ou quando a Fonte de Informação for Sisbacen ou Spot.	CANCELAMENTO
Média para Opção Asiática		Condicional	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).	REBATE
				CESSÃO
				INTERMEDIÇÃO
				CONSULTAS
				+INFOS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			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	Informar as referidas datas para formação da média asiática. Clique no botão Informar Datas é exibida tela para indicar as datas de referência para cálculo da média.	Condicional	Campo Obrigatório quando opção for Média Asiática. Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. A data indicada pode ser feriado, mas não é aceito datas de finais de semana. A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de ajustes, vencimento, antecipação informadas aplicando-se o deslocamento indicado. Devem ser indicadas, pelo menos, uma data de verificação e no máximo 500. <i>*Mais informações sobre o deslocamento, consultar a seção “Opção de Mercadoria – Datas de Fixing”.</i>
Cotação para o Vencimento	Determina a data da cotação do índice objeto da opção.	Obrigatório	Caixa de seleção: D0, D-1, D-2, D-3.
Fonte de Consulta		Opcional	Caixa de seleção: B3 e CETIP.
Observação	Complemento da descrição do contrato.	Opcional	Máximo até 200 (duzentos) caracteres

Descrição dos campos Índices Internacionais (SISBACEN)

Fonte de Informação:	ÍNDICES INTERNACIONAIS [SISBACEN] ▼		
Cotação para o Vencimento:	SELECIONE: ▼		
Boletim:	PTAX800 ▼	SELECIONE:	▼
Índice Internacional:	SELECIONE: ▼		
Observação :			

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Fonte de Informação	Fonte utilizada para captura da cotação do ativo subjacente	Obrigatório	Caixa de Seleção: Índices Internacionais SISBACEN ou Índices Internacionais FEEDER. 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.
Cotação para o Vencimento	Determina a data da cotação do índice internacional objeto da opção.	Obrigatório	A mesma data será utilizada como data de cotação da moeda do índice. Caixa de seleção com as opções: D-1 e D-2.
Boletim	Boletins intermediários e de fechamento de cotação de venda da moeda.	Obrigatório	Caixa de seleção com a opção PTAX800 e horário do boletim (18h00minh-Fechamento).
Índice Internacional	É o objeto da opção flexível.	Obrigatório	Caixa de seleção com a lista dos tipos de Índices.
Observação	Complemento da descrição do contrato.	Opcional	Máximo de 200 (duzentos) caracteres

Descrição dos campos Índices Internacionais (FEEDER)

Fonte de Informação:	INDICES INTERNACIONAIS [FEEDER] ▼
Fonte de Consulta:	SELECIONE: ▼
Outra Fonte de Consulta:	
Tela ou Função de Consulta:	
Praça de Negociação:	
Horário de Consulta:	
Índice Internacional:	SELECIONE: ▼
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD:	SELECIONE: ▼
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda):	SELECIONE: ▼
Data de Avaliação:	/ /
Observação :	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Fonte de Informação	Fonte de Informação que a cotação do ativo subjacente será capturada	Obrigatório	Caixa de Seleção: Índices Internacionais SISBACEN ou Índices Internacionais FEEDER. 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.
Fonte de Consulta	Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda.	Obrigatório	Caixa de seleção com as seguintes opções: Reuters, Bloomberg, Broadcast, Spot e Outros.
Outra Fonte de Consulta		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	Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que será utilizada pelos participantes para cotação.	Obrigatório	Campo livre.

SUMÁRIO				REGISTRO
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras	ALTERAÇÃO
Horário de Consulta	Horário de verificação da taxa de câmbio.	Obrigatório	Campo livre.	EXCLUSÃO
Índice Internacional	É o objeto da opção flexível.	Obrigatório	Caixa de seleção com a lista dos tipos de Índices.	ANTECIPAÇÃO
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	Informação do tipo de cotação para a taxa de câmbio, a ser informada na tela de avaliação	Obrigatório	Caixa de seleção: venda .	AValiação
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Informação da paridade a ser utilizada na tela de avaliação	Obrigatório	Caixa de seleção: compra, venda ou média .	(NÃO) EXERCÍCIO
Data de avaliação	Data pactuada entre as partes para avaliação do contrato mediante informação da taxa de câmbio e paridade.	Obrigatório	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. Tipo: Data (DD/MM/AAAA)	CANCELAMENTO
Observação	Complemento da descrição do contrato.	Opcional	Máximo de 200 (duzentos) caracteres	REBATE
				CESSÃO
				INTERMEDIÇÃO
				CONSULTAS
				+INFOS

2. ALTERAÇÃO

Esta função permite ao participante com perfil de SUPERVISOR ou DIGITADOR, alterar os contratos realizados entre Participantes distintos, nos prazos especificados abaixo:

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Estratégia e Opções > Lançamentos > Registro de Contrato > Ação: CORREÇÃO

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

Tabela com o prazo para alteração em contrato de Opções Flexíveis:

Tipo de Contrato	Prazo para Alteração				
	D0	D+1	D+2	D+3	D+4
Mercado x Cliente (00x10, 10x10, 00x20 própria)	Sim	Sim	Sim	Sim	Não*
Mercado x Mercado (00x00, 00x20 mercado)	Sim	Sim	Sim	Sim	Não*

*: Para solicitar alterações fora do prazo atualmente permitido pelo sistema, contatar a área de atendimento operacional de Derivativos de Balcão.

Tela de Filtro

> Estratégias e Opções > Lançamentos > Registro de Contrato

Registro/Entrada			
Instrumento Financeiro			
Tipo	Código	Tipo Indicator	Ação
SELECIONE ▼		SELECIONE ▼	INCLUSÃO ▼
Avançar Limpar Campos			

Regras gerais para Alteração e Exclusão de Contrato:

- Os contratos não podendo estar nas situações: VENCIDO, CEDIDO, ANTECIPADO ou AVALIADO.
- Quando operação efetuada entre contas de clientes 1 do participante ou entre o participante e seu cliente 1, é necessário apenas o lançamento do participante. No caso de contrato entre Participantes ou entre o Participante e seu cliente 2, o duplo lançamento é obrigatório.
- A alteração/exclusão do contrato deve obedecer a Grade Sem Liquidação STR - CTP11 e não pode ocorrer na data do vencimento do contrato.
- O contrato pode ser alterado mais de uma vez no mesmo dia desde que a alteração anterior esteja confirmada/aprovada ou cancelada.
- Para alterações realizadas pelo participante em até D+3 do registro, é gerada a operação **99 – ALTERAÇÃO DE CONTRATO**
- Para alterações realizadas pela B3 (mediante solicitação do Participante), é gerada a operação **98 – ALTERAÇÃO DE CONTRATO P/ CETIP**
- Alterações e exclusões não envolvem financeiro.

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.

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 Paridade (Exemplo)

Registro de Opção - OFCC RIO M239ABK	
Parte:	. - SELECIONE: ▼
CPF / CNPJ (Parte):	
Cesta de Garantias - Lançador:	NÃO ▼
Contraparte:	. -
CPF / CNPJ (Contraparte):	

Moeda Base / Ações / Índice:	SELECIONE: ▼
Moeda Cotada:	SELECIONE: ▼
Data Início:	/ /
Data Vencimento:	/ /
Preço Exercício:	,
Prêmio Unitário:	,
Data de Liquidação do Prêmio:	/ /
Valor Base / Quantidade:	,
Limite:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Moeda Base/Ações/ Índice	É o ativo-subjacente da opção.	Obrigatório	As moedas disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCA O. Caixa de seleção com a lista de moedas 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.
Moeda Cotada	Indica a moeda de referência em que a Moeda Base é cotada.	Obrigatório	Caixa de seleção com a lista de moedas. As moedas disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_OPCA O. A Moeda Cotada não pode ser igual à Moeda Base.
Data de Início	Data de seu registro no Módulo.	Obrigatório	Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Tipo: DD/MM/AAAA.
Data de Vencimento	Data do exercício da opção.	Obrigatório	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Tipo: DD/MM/AAAA.
Preço de Exercício	Valor da taxa de câmbio ou preço da Ação/Índice contratado entre Titular e Lançador para o exercício da opção.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 6 (seis) decimais para moeda US\$ (Dólar dos Estados Unidos), com até 8 (oito) decimais para demais moedas.

REGISTRO

ALTERAÇÃO

EXCLUSÃO

ANTECIPAÇÃO

AVALIAÇÃO

(NÃO) EXERCÍCIO

CANCELAMENTO

REBATE

CESSÃO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

+INFOS

SUMÁRIO

REGISTRO

ALTERAÇÃO

EXCLUSÃO

ANTECIPAÇÃO

AVALIAÇÃO

(NÃO) EXERCÍCIO

CANCELAMENTO

REBATE

CESSÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

+INFOS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			A precisão da paridade se dá de acordo com a Moeda Base.
Prêmio Unitário	Preço unitário, em Reais, pago pelo Titular ao Lançador, na data de registro.	Obrigatório	Tipo: Numérico. Até 8 (oito) decimais
Data de Liquidação do Prêmio	Data de liquidação do Prêmio. Se a data não for informada, o sistema utiliza a data de registro para data de liquidação do prêmio	Obrigatório	A data deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento. Se a data for menor que a data de registro, indica que o prêmio foi liquidado fora do âmbito da B3 Tipo: DD/MM/AAAA.
Valor Base/Quantidade	Valor Base em moeda estrangeira	Obrigatório	14 casas inteiras e 8 casas decimais.

Limite:

Tipo de Exercício:

SELECIONE:

Barreiras:

SELECIONE:

Liquidante:

.

-

Modalidade:

SELECIONE:

Adesão a Contrato:

Meu Número:

Intermediador:

.

-

Comissão paga pelo Titular em R\$:

,

Comissão paga pelo Lançador em R\$:

,

Cross-Rate na Avaliação?:

Média para Opção Asiática:

SELECIONE:

Datas de Verificação:

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limite	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.	Condicional	Preenchimento obrigatório, se houver. Deve ser maior que Preço de Exercício se opção de Compra e menor quando opção de Venda. Pode ser informado para contrato com Barreira. Tipo: Numérico:14(quatorze) inteiros, caso US\$, até 6(seis) decimais; demais moedas até 8(oito) decimais.
Tipo de Exercício	Indica quando o titular poderá exercer a opção.	Obrigatório	Caixa de seleção Americana: opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício. Europeia: opções que só podem ser exercidas na data de exercício. Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática
Forma de Verificação	Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando os campos Trigger In e/ou Trigger Out forem preenchidos. Caixa de Seleção com as opções: Diária ou Final
Rebate	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> .	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando indicados os campos <i>Trigger In</i> e/ou <i>Trigger Out</i>. Caixa de seleção com as opções: 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); 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); Sem Rebate (Não há previsão de rebate para o contrato).

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Rebate Unitário	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.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro. Tipo: Numérico(10(dez) inteiros e 8(oito) decimais)
Liquidação do Rebate	Define a ocasião da liquidação financeira do rebate.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Liquidação, no campo Rebate. Caixa de seleção com as opções: Vencimento e <i>Trigger Out</i>. 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. 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>.
Liquidante	Banco Liquidante do participante que liquidará os prêmios das opções de compra e venda.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caso o campo não seja preenchido, a aplicação assume automaticamente o banco liquidante principal do Participante. Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Modalidade	Forma de liquidação financeira do valor correspondente ao prêmio e ao valor da comissão a ser paga pela intermediação.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório. Modalidade de Liquidação Financeira. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.

Adesão a Contrato:	
Meu Número:	
Intermediador:	. -
Comissão paga pelo Titular em R\$:	,
Comissão paga pelo Lançador em R\$:	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Adesão do Contrato	Indica se o contrato que está sendo registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos.	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Vazio, Sem adesão, CGD, CSA, CGD/CSA.
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico. (até 8(oito) dígitos)

Cross-Rate na Avaliação?:	☐
Média para Opção Asiática:	SELECIONE:
Datas de Verificação:	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cross Rate na Avaliação	É a taxa de câmbio resultante da cotação de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Exclusivo para opção de paridade. 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.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Média para opção Asiática		Condicional	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	Informar as referidas datas para formação da média asiática. Clique no botão Informar Datas é exibida tela para indicar as datas de referência para cálculo da média.	Condicional	Campo Obrigatório quando opção for Média Asiática. Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. A data indicada pode ser feriado, mas não é aceito datas de finais de semana. A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de ajustes, vencimento, antecipação informadas aplicando-se o deslocamento indicado. Devem ser indicadas, pelo menos, uma data de verificação e no máximo 500. <i>*Mais informações sobre o deslocamento, consultar a seção “Opção de Mercadoria – Datas de Fixing”.</i>

REGISTRO

ALTERAÇÃO

EXCLUSÃO

ANTECIPAÇÃO

AVALIAÇÃO

(NÃO) EXERCÍCIO

CANCELAMENTO

REBATE

CESSÃO

INTERMEDIAÇÃO

CONSULTAS

+INFOS

Registro Opção de Paridade - Sisbacen/Feeder

Fonte de Informação:	SISBACEN/FEEDER	
Cotação para o Vencimento:	SELECIONE:	
Boletim:	PTAX800	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 :		

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Fonte de informação	Indicar fonte da captura das cotações	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder e Spot.
Cotação para o Vencimento	Determina a data da cotação da moeda objeto da opção.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: D-1 e D-2
Boletim	Boletins intermediários e de fechamento de cotação de venda da moeda.	Obrigatório	Caixa de seleção com a opção PTAX800 e horário do boletim (18h00minh-Fechamento).
Fonte de Consulta	Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda.	Obrigatório	Caixa de seleção com as seguintes opções: Reuters, Bloomberg, Broadcast, Spot e Outros.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Outra fonte de consulta	Campo livre para descrição de outra fonte de consulta, caso o item Outros tenha sido escolhido na caixa de seleção Fonte de Consulta.	Obrigatório	Campo livre.
Tela ou função de consulta	Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que será utilizada pelos participantes para cotação..	Obrigatório	Campo livre.
Praça de negociação	Local de negociação da moeda se Opção sobre taxa de câmbio e fonte de informação Feeder, Sisbacen/Feeder ou Spot.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório. Campo livre.
Horário de consulta	Horário de verificação da taxa de câmbio.	Obrigatório	Campo livre.
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	Informação do tipo de cotação para a taxa de câmbio, a ser informada na tela de avaliação	Obrigatório	Caixa de seleção: venda.
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Informação da paridade a ser utilizada na tela de avaliação	Obrigatório	Caixa de seleção: compra, venda ou média.
Data de avaliação	Data pactuada entre as partes para avaliação do contrato mediante informação da taxa de câmbio e paridade.	Obrigatório	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. Tipo: DD/MM/AAAA.
Observação	Complemento da descrição do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Com até 280 caracteres.

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 :	
Enviar Limpar Campos Voltar	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cotação para o Vencimento	Determina a data da cotação da moeda objeto da opção.	Obrigatório	Para a fonte de informação Feeder ou Spot são apresentadas as opções: D0, D-1 e D-2.
Fonte de Consulta	Nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda	Obrigatório	Caixa de seleção. Quando Fonte de Informação Feeder é exibida as opções: Reuters, Bloomberg, Broadcast e Outros. Quando Fonte de Informação Spot é exibida a opção: Spot.
Outra fonte de consulta	Descrição de outra fonte de consulta, caso o item Outros tenha sido escolhido na caixa de seleção Fonte de Consulta.	Obrigatório	Campo livre.
Tela ou função de consulta	Nome da função de consulta ou código da tela, que será utilizada pelos participantes para cotação.	Obrigatório	Campo livre.
Praça de negociação	Local de negociação da moeda se Opção sobre taxa de câmbio e fonte de informação Feeder, Sisbacen/Feeder ou Spot.	Obrigatório	Campo livre.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Horário de consulta	Horário de verificação da taxa de câmbio.	Obrigatório	Campo livre. Não pode ser informado quando indicador financeiro forem Ações.
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	Informação do tipo de cotação para a taxa de câmbio, a ser informada na tela de avaliação.	Obrigatório	Para Fonte de Informação Feeder compra, venda média ou nenhuma . Para Fonte de Informação Spot: compra, venda ou média . Se indicador financeiro for Ação, deve ser selecionada a opção nenhuma.
Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	Informação da paridade a ser utilizada na tela de avaliação.	Obrigatório	Caixa de seleção: Para Fonte de Informação Feeder: compra, venda média ou nenhuma. Se indicador financeiro for Ação, deve ser selecionada a opção nenhuma. Para Fonte de Informação Spot: nenhuma.
Data de avaliação	Data pactuada entre as partes para avaliação do contrato mediante informação da paridade ou Cotação.	Obrigatório	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. Tipo: DD/MM/AAAA.
Observação	Complemento da descrição do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Com até 280 caracteres.

Campos que NÃO podem ser alterados

Campos

Parte/Titular

CPF/CNPJ Titular

Contraparte/Lançador

Campos

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)

Forma de Disparo (Se trigger disparado)

Intermediador

Comissão paga pelo Titular

Comissão paga pelo Lançador

3. EXCLUSÃO

Esta função permite ao participante com perfil de SUPERVISOR ou DIGITADOR, excluir os contratos realizados entre Participantes distintos, nos prazos especificados abaixo.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Estratégia e Opções > Lançamentos > Registro de Contrato > Ação:

EXCLUSÃO

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

Tabela com o prazo para Exclusão de contrato de Opções Flexíveis

Tipo de Contrato	Prazo para Exclusão				
	D0	D+1	D+2	D+3	D+4
Mercado x Cliente (00x10, 10x10, 00x20 própria)	Sim	Sim	Sim	Sim	Não *
Mercado x Mercado (00x00, 00x20 mercado)	Sim	Sim	Sim	Sim	Não *

*: Para solicitar alterações/exclusões fora do prazo atualmente permitido pelo sistema, contatar a área de atendimento operacional de Derivativos de Balcão.

Tela de Filtro

Estratégias e Opções > Lançamentos > Registro de Contrato

Registro/Emissão			
Instrumento Financeiro			Ação
Tipo	Código	Tipo Indicador	
OFCC	GEPEM24ABC	MERCADORIAS	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
Confirmar Desistir		

4. ANTECIPAÇÃO

Esta função permite aos participantes realizarem 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.

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu > Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Antecipação de Contrato	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. 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.
Arquivo: 5.2.3. Antecipação de Contrato de Opção Flexível	
Mensageria: Não disponível	
PRAZO: 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.	

Tela de Inclusão dos Detalhes para Antecipação

Antecipação de Opção - OFCC RIO M231113		
Valor a Antecipar:	10	.00
Prêmio Unitário da Antecipação - R\$:	1	.0
Data Original da Operação:	05	/ 12 / 2023
Novo Rebate Unitário:		
Meu Número:	11113	
Liquidante:		-
Modalidade:	SEM MODALIDADE	
Enviar Limpar Campos Voltar		

Tela de Confirmação dos Detalhes para Antecipação

Confirmação de Antecipação de Opção - OFCC RIO M231113		
Valor a Antecipar 10,00000000	Prêmio Unitário da Antecipação - R\$ 1,00000000	Valor Financeiro a Antecipar - R\$ 10,00
Data Original da Operação 05/12/2023	Novo Rebate Unitário	
Liquidante 07570.00-7 BANCO KEB DO BRASIL S/A	Modalidade SEM MODALIDADE	Meu Número 11113
Confirmar Desistir Corrigir		

Mensagem de Confirmação da Antecipação

Antecipação realizada. Operação de Antecipação No. 2023120615580252.		
Antecipação de Opções / Estratégias		
Participante	Instrumento Financeiro Código	Contraparte
Avançar Limpar Campos		

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

Descrição dos campos da tela de inclusão de detalhes

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Valor a antecipar	Valor Base ou Quantidade a ser antecipada	Obrigatório	Tipo: numérico (até 14 dígitos inteiros e 8 decimais) Com até 8 (oito) casas decimais. Este campo não é exibido quando contrato com opção de média asiática ponderada.
Prêmio unitário da antecipação em R\$	Prêmio unitário da antecipação. É creditado ao Titular e debitado do Lançador.	Obrigatório	Tipo: numérico (até 10 dígitos inteiros e 8 decimais) Preencher com até 8 (oito) casas decimais, caso contrário, o Módulo preenche com zeros.
Data Original da Operação		Obrigatório	Formato: DD/MM/AAAA Deve ser dia útil, anterior a Data Atual em até D-2 e que envolva conta de cliente 1.
Novo Valor de Rebate	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.	Obrigatório	Tipo: numérico (até 10 dígitos inteiros e 8 decimais) Exclusivo para antecipação de Opção de Mercadoria
Meu número	Número de identificação do lançamento	Obrigatório	Tipo: Numérico (Com 10 inteiros) Não é necessário que o Titular e o Lançador informem o mesmo número.
Liquidante	Banco que deve liquidar o prêmio da antecipação.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros) Caso o campo não seja preenchido, o Módulo assume automaticamente o Banco

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Liquidante principal do Participante.

Dados Asiáticos (Os campos referentes a este item são exibidos quando opção Asiática com média Aritmética ponderada)			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data	Data de referência para a apuração do trigger.	Obrigatório	Formato: DD/MM/AAAA
Valor Referência Remanescente	Valor remanescente do Valor Base.	Obrigatório	Tipo: numérico (até 10 dígitos inteiros e 8 decimais)
Valor a Antecipar	Valor da opção a ser antecipada do Valor Remanescente.	Obrigatório	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 da B3, em: www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/negociacao/caderno-de-formulas/.

REGISTRO

ALTERAÇÃO

EXCLUSÃO

ANTECIPAÇÃO

AVALIAÇÃO

(NÃO) EXERCÍCIO

CANCELAMENTO

REBATE

CESSÃO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

+INFOS

5. AVALIAÇÃO DE CONTRATO DE OPÇÃO

Função exclusiva para contratos registrados com Índices Internacionais e Paridades 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

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Avaliação de Contrato de Opção	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.
Arquivo: 5.2.6. Avaliação de Contrato de Opção Flexível	
Mensageria: Não disponível	
PRAZO: É possível a partir do primeiro dia útil subsequente ao seu registro no Módulo e até o vencimento da opção (inclusive). 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		
Participante	Instrumento Financeiro	Contraparte
	Código	
- -		- -
Avançar Limpar Campos		

Avaliação de Contrato de Opção - OFCC RIO M231211	
Paridade a Vista/Preço do Índice:	1 ,
Cotação(R\$/Moeda Cotada):	5 ,
Meu Número:	4326
Enviar Limpar Campos Voltar	

Tela de inclusão dos detalhes da Avaliação – Índices Internacionais

Modelo sem Cross rate

Avaliação de Contrato de Opção - OFCC RIO M231211	
Paridade a Vista/Preço do Índice:	1 ,
Cotação(R\$/Moeda Cotada):	5 ,
Meu Número:	4326
Enviar Limpar Campos Voltar	

(continua)

Modelo com Cross rate

Avaliação de Contrato de Opção - OFCC RIO M231222	
Paridade a Vista/Preço do Índice:	,
Paridade(USD/Moeda Cotada):	,
Cotação - Taxa de Câmbio R\$/USD:	,
Meu Número:	
Enviar Limpar Campos Voltar	

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.

Descrição dos campos da tela de inclusão de detalhes

Campo: São apresentados de acordo com a Fonte de Informação utilizada para a consulta de cotação. (Veja TABELA 1).

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu número	Número que identifica a operação para controle do participante.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Com 10 inteiros)
Paridade a Vista	Paridade à vista, entendida como sendo o valor em moeda cotada que é necessário para comprar/vender uma unidade de moeda base.	Condicional	Tipo: Numérico (até 10 dígitos inteiros e 8 decimais)
Cotação (R\$/Moeda cotada)	Valor em Reais que é necessário para comprar/vender uma unidade de "moeda cotada"	Condicional	Tipo: Numérico (até 10 dígitos inteiros e 8 decimais)
Paridade a Vista	Paridade à vista, entendida como sendo o valor em moeda cotada que é necessário para comprar/vender uma unidade de moeda base.	Condicional	Tipo: Numérico (até 10 dígitos inteiros e 8 decimais)
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	Condicional	Tipo: Numérico (até 10 dígitos inteiros e 8 decimais)

Campo: São apresentados de acordo com a Fonte de Informação utilizada para a consulta de cotação. (Veja TABELA 1).

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	para comprar/vender uma unidade de dólar.		
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".	Condicional	Tipo: Numérico (até 10 dígitos inteiros e 8 decimais)
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.	Condicional	Tipo: Numérico (até 10 dígitos inteiros e 8 decimais)
Data de verificação	O campo indica qual data da verificação está sendo avaliada.	Obrigatório	Formato: DD/MM/AAAA

TABELA 1- Campos exibidos conforme Fonte de Informação

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

REGISTRO

ALTERAÇÃO

EXCLUSÃO

ANTECIPAÇÃO

AVALIAÇÃO

(NÃO) EXERCÍCIO

CANCELAMENTO

REBATE

CESSÃO

INTERMEDIAÇÃO

CONSULTAS

+INFOS

6. (NÃO) EXERCÍCIO DE CONTRATO DE OPÇÃO

Ao acessar a função, o módulo reconhece que se trata de opção de exercício e envia tela para confirmação do participante.

Os contratos de opção americana exercidos antes do vencimento utilizarão a cotação do dia anterior para calcular o valor financeiro. 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.

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > (Não) Exercício de Contrato de Opção Arquivo: 5.2.2. Exercício de Contrato de Opção Mensageria: Não disponível	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 conta de 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.
PRAZO: É possível a partir do primeiro dia útil subsequente ao seu registro no Módulo e até o vencimento da opção (inclusive). Os contratos de opção de compra ou de venda na modalidade de exercício americana podem ser exercidos antes da data do vencimento do contrato.	

Tela de inclusão dos detalhes de Exercício

Exercício de Opções / Estratégia			
Meu N°	Dados da Operação Original		
	Participante	Instrumento Financeiro	Contraparte
		Código	
1234	05000 . 00 . 5	RIO M240104	05000 . 10 . 8
Avançar Limpar Campos			

Descrição dos campos do Exercício de Opções/Estratégias

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu número	Número interno de identificação da operação	Obrigatório	Tipo: Numérico (Com 10 inteiros)
Participante	Código da conta do Participante que está efetuando o lançamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Instrumento Financeiro Código	Código do ativo da operação.	Obrigatório	Tipo: Alfanumérico sendo, Os cinco primeiros dígitos = Mnemônico do participante Lançador do novo contrato; 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)
Contraparte	Código da conta do outro membro envolvido na operação.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)

Tela Exemplo – Não-Exercício

Confirmação de (Não) Exercício de Opção OFCC RIO M240106		
Quantidade a Exercer 10,00000000	Valor Financeiro a Exercer - R\$ 47,80	Meu Número 1233
Liquidante TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A	Modalidade SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	Prêmio Unitário do Exercício - R\$ 4,78000000
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 012.345.678-90	Mercadoria
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)
Data de Início 02/01/2024	Data de Vencimento 05/01/2024	Prazo em Dias Úteis 3
Moeda Base / Ações / Índice / Produto AÇÕES NACIONAIS	Moeda Cotada / Moeda para Negociação REAL	Média para Opção Asiática
Valor Base / Quantidade 10,00000000	Valor Remanescente 10,00000000	Valor da Aplicação 30,00
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 Não
Rebate	Rebate Unitário	Liquidação do Rebate

Opção de COMPRA			
Prêmio Unitário 3,00000000	Preço de Exercício 33,00000000	Limite	
Data de Liquidação do Prêmio 02/01/2024	Preço de Exercício em Reais Sim	Opção Quanto	Cotação para Opção Quanto
Dados Adicionais			
Fonte de Informação ACOES NACIONAIS	Cotação para o Vencimento D-1	Boletim	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 PETR4	
Ajuste de Proventos pelas Partes NÃO	Proteção contra Provento em Dinheiro NÃO	EX	
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD NENHUMA	Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda) NENHUMA	Data de Avaliação	
	Paridade a vista/Preço Ação ou Índice 37,78000000	Cotação (R\$/Moeda Cotada) 1,00000000	Valor do Exercício 47,80
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 (Não) Exercício de Opção OFCC RIO M240104			
Quantidade a Exercer 10,00000000	Valor Financeiro a Exercer - R\$ 47,80	Meu Número 1234	
Liquidante TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A	Modalidade SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	Prêmio Unitário do Exercício - R\$ 4,78000000	
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 012.345.678-90	Mercadoria	
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)	
Data de Início 02/01/2024	Data de Vencimento 05/01/2024	Prazo em Dias Úteis 3	
Moeda Base / Ações / Índice / Produto AÇÕES NACIONAIS	Moeda Cotada / Moeda para Negociação REAL	Média para Opção Asiática	
Valor Base / Quantidade 10,00000000	Valor Remanescente 10,00000000	Valor da Aplicação 30,00	
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	Cross-Rate na Avaliação Não	
Rebate	Rebate Unitário	Liquidação do Rebate	

Opção de COMPRA			
Prêmio Unitário 3,00000000	Preço de Exercício 33,00000000	Limite	
Data de Liquidação do Prêmio 02/01/2024	Preço de Exercício em Reais Sim	Opção Quanto	Cotação para Opção Quanto
Dados Adicionais			
Fonte de Informação ACOES NACIONAIS	Cotação para o Vencimento D-1	Boletim	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 PETR4	
Ajuste de Proventos pelas Partes NAO	Proteção contra Provento em Dinheiro NAO	EX	
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD NENHUMA	Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda) NENHUMA	Data de Avaliação	
	Paridade a vista/Preço Ação ou ÍndiceCotação (R\$/Moeda Cotada)	Valor do Exercício	
	37,780000001,00000000	47,80	

Confirmar

Desistir

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

7. CANCELAMENTO DE OPERAÇÕES

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

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Cancelamento de Operações	Quando operação efetuada por duplo comando, o cancelamento é permitido desde que esteja pendente de liquidação financeira.
Arquivo: Não disponível	
Mensageria: Não disponível	
PRAZO: 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 N°	Dados da Operação Original			
	Participante	N° CETIP	Instrumento Financeiro Código	Contraparte
123	05000 - 00 - 5	2023120615579822	RIO M231111	05000 - 10
AvançarLimpar Campos				

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

Descrição dos campos da Tela de Cancelamento de Operações

Cancelamento de Operações			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu número	Número interno de identificação do lançamento do cancelamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Com 10 inteiros) Não é necessário que o Titular e o Lançador informem o mesmo número. Com até 10 dígitos.
Participante	Código da conta do Participante que está efetuando o lançamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Número Cetip	Número da operação original que deve ser cancelada.	Obrigatório	Este número pode ser obtido no item Operações – consulta Operações no campo Num Ctrl Operação .
Instrumento Financeiro Código	Código do ativo da operação.	Obrigatório	Tipo: Alfanumérico sendo, Os cinco primeiros dígitos = Mnemônico do participante Lançador do novo contrato; 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)
Contraparte	Código da conta do outro membro envolvido na operação.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)

Tela exemplo - Confirmação de Cancelamento de Registro de Opção

Confirmação de Cancelamento de Registro de Opção - OFCC RIO MZ30712

Meu Número	1234		
Titular	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	CPF / CNPJ do Titular	05000.10-8 BCO RIO S/A
Intermediador	Comissão paga pelo Titular (R\$)	Comissão paga pelo Lançador (R\$)	
Data de Início	05/12/2023	Data de Vencimento	15/12/2023
Moeda Base / Ações / Índice / Produto	ACOES NACIONAIS	Moeda Cotada / Moeda para Negociação	REAL
Valor Base / Quantidade	10,00000000	Valor Remanescente	10,00000000
Barreira		Trigger In (Cotação / Índice)	Trigger Out (Cotação / Índice)
Trigger - Proporção	Não	Forma de Disparo	Tipo de Disparo
Forma de Verificação		Adesão a Contrato	Cross-Rate na Avaliação
Rebate		Rebate Unitário	Liquidação do Rebate

Opção de COMPRA

Prêmio Unitário	10,00000000	Preço de Exercício	33,61000000	Limite	
Data de Liquidação do Prêmio	06/12/2023	Preço de Exercício em Reais	Sim	Opção Quanto	Cotação para Opção Quanto

Dados Adicionais

Fonte de Informação	ACOES NACIONAIS	Cotação para o Vencimento	D-1	Boletim	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	PETRA
Ajuste de Proventos pelas Partes	NÃO	Proteção contra Provento em Dinheiro	NÃO	EX	
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD	NENHUMA	Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	NENHUMA	Data de Avaliação	

Confirmar

Desistir

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

8. CESSÃO

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

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Cessão de Contrato de Opção	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.
Arquivo: Não disponível	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.
Mensageria: Não disponível	
PRAZO: Pode ocorrer em D+1 da data de registro e até D-1 da data de vencimento do contrato, sempre pelo valor total.	

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.

Tela de Cessão

Cessão de Contrato de Opção				
Participante		Instrumento Financeiro	Contraparte	
Conta	CPF/CNPJ	Código	Conta	CPF/CNPJ
05000 - .00 - 5		RIO M240104	05000 - .10 - 8	
Avançar Limpar Campos				

Cessão de Contrato de Opção - OFCC RIO M231211	
Cedente:	05000.10-8 BCO RIO S/A
CPF/CNPJ do Cedente:	01234567890
Adquirente:	10020.00-1 TESTE-BANCO LEME S/A_2021
CPF/CNPJ do Adquirente:	
Anuente:	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A
CPF/CNPJ do Anuente:	
Novo Código IF:	
Liquidante:	- . -
Modalidade:	SELECIONE: ▼
Valor do Prêmio em R\$:	,
Meu Número:	

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.

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	Tipo de Preenchimento	Regras
CPF/CNPJ do Adquirente	Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a conta do Adquirente for de cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC.	Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
Novo código IF	Indicação do novo código do instrumento Financeiro, que é gerado depois de finalizada a operação de cessão	Obrigatório	Tipo: Alfanumérico sendo, Os cinco primeiros dígitos = Mnemônico do participante Lançador do novo contrato;

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			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	Código da conta do Banco Liquidante que deve efetuar a liquidação do prêmio da cessão.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros) Caso o campo não seja preenchido, o Módulo assume automaticamente o Banco Liquidante principal do Participante.
Modalidade	Modalidade de Liquidação Financeira.	Obrigatório	Tipo: Caixa de Seleção com as opções: Sem modalidade, Bruta ou Bilateral.
Valor do Prêmio em R\$	Valor do prêmio unitário, em Reais, pago ou recebido pelo Adquirente, na data de registro.	Obrigatório	Tipo: numérico (16 inteiros e até duas casas decimais)
Meu número	Número interno de identificação do lançamento	Obrigatório	Tipo: Numérico (Com 10 inteiros)

9. CONFIRMAÇÃO DE CESSÃO

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

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Confirmação de Cessão de Contrato de Opção	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
Arquivo: Não disponível	
Mensageria: Não disponível	
PRAZO: 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.	

Confirmação de Cessão de Contrato de Opção - OFCC RIO M243ESW

Anuente:10020.00-1 TESTE-BANCO LEME S/A_2021

CPF / CNPJ (Anuente):

Valor do Prêmio em R\$:

Titular do Prêmio:

Liquidante:

Modalidade:

Meu Número: 5

Dados da Cessão do Contrato

Adquirente
02666.00-2 TESTE BANCO PRODUTOS E NEGOCIOS
CPF/CNPJ Adquirente

Cedente
05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A
CPF/CNPJ Cedente

Data de Cessão
12/01/2024
Novo Código IF
GEPEN241102

Dados do Contrato Original

Titular
10020.00-1 TESTE-BANCO LEME S/A_2021
CPF/CNPJ Titular

Lançador
05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A
CPF/CNPJ Lançador

Tipo de Exercício
EUROPEIA

Intermediador

Comissão paga pelo Titular (R\$)

Comissão paga pelo Lançador (R\$)

Data de Início
09/01/2024

Data de Vencimento
23/01/2024

Prazo em Dias Úteis
10

Moeda Base / Ações / Índice / Produto
AÇÕES NACIONAIS

Moeda Cotada / Moeda para Negociação
REAL

Mercadoria

Valor Base / Quantidade
100,00
Barreira

Valor Remanescente
100,00
Trigger In

Valor da Aplicação
100,00
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

Liquidação do Rebate

Opção de Compra

Prêmio Unitário
1,00000000

Preço de Exercício
35,00000000

Limite

Data de Liquidação do Prêmio
09/01/2024

Preço de Exercício em Reais
Sim

Opção Quanto

Cotação para Opção Quanto

Dados Adicionais

Fonte de Informação
ACOES

Cotação para o Vencimento
D-1

Boletim

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
PETR4

Ajuste de Proventos pelas Partes
NÃO

Proteção contra Provento em Dinheiro
EX

Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD
NENHUMA

Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)
NENHUMA

Data de Avaliação

Média para Opção Asiática

Confirmar

Desistir

Tela de Confirmação de Cessão

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu Nº	Número de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Com 10 inteiros)
Participante	Código do participante Anuente da operação.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Instrumento Financeiro	Código do IF que está sendo cedido.	Obrigatório	Tipo: Alfanumérico sendo, Os cinco primeiros dígitos = Mnemônico do participante Lançador do novo contrato; 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)
Contraparte	Código do participante Cedente da operação.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)

Mensagem confirmando a operação de cessão

GEPEN241102 incluído. Operação de Confirmação de Cessão No. 2024011217972267.

Confirmação de Cessão de Contrato de Opções			
Meu Nº	Dados da Operação Original		
	Participante	Instrumento Financeiro	Contraparte
		Código	

Avançar Limpar Campos

10. INFORMAÇÃO DE VALOR DE REBATE

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.

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu Estratégias e Opções > Lançamentos > Informação de Valor de Rebate	
Arquivo: 5.2.7. Informação de Valor de Rebate	
Mensageria: Não disponível	
PRAZO: 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 M231118	05000 - 10 - 8
Avançar Limpar Campos		

Tela de Resultado

Informação de Valor de Rebate - OFCC RIO M231118	
Rebate Unitário:	10 , 0
Meu Número:	123456
Enviar Limpar Campos Voltar	

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

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

Confirmação de Informação de Valor de Rebate - OFCC RIO M231118	
Rebate Unitário 10,00000000	Meu Número 123456
Confirmar Desistir Corrigir	

11. CONSULTA DE CARACTERÍSTICA DE CONTRATO

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.

FORMAS DE CONSULTA

Tela:

Menu Estratégias e Opções > Consultas > Características de Contratos

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

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:

Tela de Detalhes do Contrato

Características de Contrato de Opção - OFCC 130610231001 - RESGATADO					
Titular 72480.10-4 BANCO ABC-BRASIL S/A_2021 CPF / CNPJ do Titular 41.777.706/0001-41 Intermediador		Lançador 72480.00-1 BANCO ABC-BRASIL S/A_2021 CPF / CNPJ do Lançador		Tipo de Exercício EUROPEIA Cesta Garantia - Lançador NAO Comissão paga pelo Lançador (R\$)	
Comissão paga pelo Titular (R\$)				Comissão paga pelo Lançador (R\$)	
Data de Registro 23/02/2023	Data de Início 17/02/2023	Data de Vencimento 24/02/2023	Prazo em Dias Úteis 3	Data da Última Correção	Data do Último Aditamento
Moeda Base / Ações / Índice / Produto DOLAR DOS EUA		Moeda Cotada / Moeda para Negociação REAL		Mercadoria	
Valor Base / Quantidade 1.000,00000000		Valor Remanescente 1.000,00000000		Valor da Aplicação 500,00	
Barreira		Trigger In		Trigger Out	
Trigger - Proporção Não		Trigger - Forma de Disparo		Trigger - Tipo de Disparo	
Forma de Verificação		Adesão a Contrato		Cross-Rate na Avaliação Não	
Rebate		Rebate Unitário	Valor Original Rebate	Liquidação do Rebate	
Opção de COMPRA					
Prêmio Unitário 0,50000000		Preço de Exercício 4,50000000		Limite 4,75000000	
Data de Liquidação do Prêmio 24/02/2023		Preço de Exercício em Reais Sim		Opção Quanto	Cotação para Opção Quanto
Dados Adicionais					
Fonte de Informação SISBACEN		Cotação para o Vencimento D-1		Cotação para Moeda da MercadoriaBoletim PTAX300 FECHAMENTO	
Fonte de Captura		Fonte de Consulta		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		Possui Gravame NAO	Possui Garantia NAO
Tipo Taxa de Câmbio R\$/USD		Tipo Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)		Data de Avaliação	Média para Opção Asiática
		Paridade (Base) 5,17300000	Paridade (Cotada) 1,00000000	Valor do Exercício 250,00	Data da Cotação
Observação					
Sistema Origem		Código IF Sistema Origem			
Voltar Sair					

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.
RESGATADO	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 B3.

Situação do contrato	Descrição
VENCIDO E NÃO PAGO	Situação final do contrato na data de vencimento da opção. Quando há previsão de liquidação financeira no âmbito da B3 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.

REGISTRO

ALTERAÇÃO

EXCLUSÃO

ANTECIPAÇÃO

AVALIAÇÃO

(NÃO) EXERCÍCIO

CANCELAMENTO

REBATE

CESSÃO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

+INFOS

(fim)

13 . CONSULTA – LANÇAMENTO

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.

FORMAS DE CONSULTA

Tela:

Menu Estratégias e Opções > Consultas > Lançamentos

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

Tela de Filtro

Estratégias e Opções > Consultas > Lançamentos

Lançamentos	
Titular (Nome Simplificado):	
Titular (Razão Social):	
Tipo de Conta Titular:	v
Titular (conta):	- -
Lançador (Nome Simplificado):	
Lançador (Razão Social):	
Tipo de Conta Lançador:	v
Lançador (conta):	- -
Tipo de Instr. Financeiro:	v
Situação:	v
Tipo Operação:	v
Nº Operação CETIP:	
Meu N°:	
Código Instr. Financeiro:	
Pesquisar Limpar Campos	

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



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

<< <

1

Exibir página

> >>

Obter no formato:

Excel

▼

(Continua)

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

(Fim)

14 . INFORMAÇÕES ADICIONAIS

14.1. 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	Sim	N.A	Sim	Sim	Não	Sim	Sim
Knock Out	Sim	N.A	N.A	Sim	Sim	Não	Sim	Sim
Knock In Out	N.A	N.A	N.A	Sim	Sim	Não	Sim	Sim
Opção Índice/ Ação	Sim	Sim	Sim	N.A	N.A	Sim	Sim	Não
Opção Paridade	Sim	Sim	Sim	N.A	N.A	Sim	Sim	Sim
Opção Mercadoria	Sim	Sim	Sim	N.A	N.A	Sim	Sim	Sim
Média Asiática	Não	Não	Não	Sim	Sim	N.A	Sim	Sim
Limitadores	Sim	Sim	Sim	Sim	Sim	Sim	N.A	Sim
Opção Quanto/ Opção em Reais	Sim	Sim	Sim	Não	Não	Sim	Sim	N.A
Exercício Americana	Sim	Sim	Sim	Sim	Sim	Sim	Sim	Sim
Exercício Europeia	Sim	Sim	Sim	Sim	Sim	Sim	Sim	Sim

Legenda:	Não	- Impossível
	N. A	- Não se aplica
	Sim	- Possível

14.2. Ativos Subjacentes Disponíveis

A consulta dos ativos subjacentes disponíveis para registro pode ser consultada através dos seguintes arquivos públicos e funcionalidades da plataforma NoMe:

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

Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos > AAAAMMDD_Indexadores_OPCAO

Caso o Tipo Indicador seja MERCADORIA:

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

REGISTRO

ALTERAÇÃO

EXCLUSÃO

ANTECIPAÇÃO

AVALIAÇÃO

(NÃO) EXERCÍCIO

CANCELAMENTO

REBATE

CESSÃO

INTERMEDIAÇÃO

CONSULTAS

+INFOS

+INFOS

CONSULTAS

INTERMEDIAÇÃO

CESSÃO

REBATE

CANCELAMENTO

(NÃO) EXERCÍCIO

AVALIAÇÃO

ANTECIPAÇÃO

EXCLUSÃO

ALTERAÇÃO

REGISTRO

1. REGISTRO

Através desta função, o participante pode realizar o registro de um contrato com ativo subjacente com payoff calculado pela B3.

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.

FORMAS DE LANÇAMENTO	FUNCIONALIDADES
Tela: Menu Opções Flexíveis > Lançamentos > Registro Arquivo: 5.3.1. Registro de Contrato de Opção VCP 5.3.2. Registro de Contrato de Opção VCP Versão 2 Mensageria:	• Opção com Verificação Europeia ou Americana • Barreiras (Knock In, Knock Out Knock In/Out) • Limitadores • Proventos

Tela de Filtro



> Opções Flexíveis > Lançamentos > Registro

Registro de contrato

Ação

Código IF

Classe do Ativo Subjacente

Classe do Ativo VCP

No dia do registro, o contrato pode assumir as seguintes situações abaixo:

- **PENDENTE DE LANÇAMENTO: LANÇADOR:** Em contratos com Participantes (Mercado x Mercado) onde falta a Confirmação do Lançador da Opção
- **PENDENTE DE LANÇAMENTO: TITULAR:** Em contratos com Participantes (Mercado x Mercado) onde falta a Confirmação do Titular da Opção
- **PENDENTE DE LIQUIDACAO DE PRÊMIO:** Em contratos com prêmio feito com Participantes (Mercado x Mercado) que ainda não tenha liquidado o prêmio com data de liquidação na data de registro.
- **CONFIRMADO:** Quando o contrato é com Cliente (Mercado x Cliente próprio) ou com Participantes (Mercado x Mercado) onde as partes confirmaram e o prêmio, se houver, foi liquidado.

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

O registro pode ser feito na base financeira total, para o qual deve-se informar o Valor Base e/ou o Valor do Prêmio Total, ou na base financeira unitária, para o qual deve-se informar a Quantidade e/ou o Prêmio Unitário.

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.

Descrição dos Campos da Tela Filtro de Contrato

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Ação	Informar o tipo de ação a ser realizada.	Obrigatório	tipo domínio com as opções: INCLUIR
Código IF	Código do instrumento financeiro	Não Preencher	Gerado automaticamente pelo sistema.
Classe do Ativo Subjacente	Informar a classe do ativo subjacente diferente de "VCP".	Obrigatório	Caixa de Seleção: VCP, ACOES (Ações Nacionais), ACOES INTERNACIONAIS, COMMODITIES, ÍNDICES (Índices Nacionais), INDICES INTERNACIONAIS e TAXAS DE CAMBIO
Classe do Ativo VCP	Informar a classe do ativo subjacente quando "VCP".	Obrigatório	Somente deve ser preenchido este campo quando a Classe do Ativo Subjacente for "VCP". Campo tipo domínio com as opções: AÇÕES NACIONAIS; AÇÕES INTERNACIONAIS; COMMODITIES; INDICES INTERNACIONAIS

As informações são validadas e a Tela de Registro do contrato somente é disponibilizada se não houver erro.

Tela de Registro

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Registro

Registro de Opção

Instrumento Financeiro
OPC

Classe do Ativo Subjacente
ACOES INTERNACIONAIS

Partes do contrato

Parte (Conta)

Posição da Parte

CPF/CNPJ Cliente Parte

Contraparte (Conta)

CPF/CNPJ Cliente Contraparte

Descrição dos campos da Tela de Registro

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte (Conta)	Conta da Parte (Própria 00, ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato (Titular ou Lançador).	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Posição da Parte	Indica qual a posição da Parte no contrato.	Obrigatório	Campo tipo domínio com as opções: LANÇADOR e TITULAR
CPF/CNPJ Cliente Parte		Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
Contraparte (Conta)	Conta da Contraparte (Própria 00, ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato (Titular ou Lançador).	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros) e Caixa de
CPF/CNPJ Cliente Contraparte		Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)

Características			
Tipo de Opção 	Data Início 	Data Vencimento 	Ativo Subjacente
Quantidade 	Strike 	Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual? 	Data Referência para valores em %
Tipo de Exercício 	Tipo de Cotação 	Data de fixing do ativo subjacente 	Data de fixing da moeda do ativo subjacente
Opção Quanto 	Cotação para opção quanto 	Meu Número 	Combinação de Operações
Valor base 			

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Tipo de Opção		Obrigatório	Campo tipo domínio com as opções: CALL e PUT
Data Início	Data do registro do contrato no módulo	Obrigatório	Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Tipo: DD/MM/AAAA. Nos contratos que envolvam Cliente 1 ou 2, a data informada pode ser anterior a Data de Registro em até D-2, inclusive.
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato.	Obrigatório	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Tipo: DD/MM/AAAA
Ativo Subjacente	Indica o ativo-subjacente da opção.	Obrigatório	Campo tipo domínio com as opções dos ativos subjacentes habilitados para a classe de ativos selecionada. Os ativos disponíveis podem ser consultados no arquivo público AAAAMMDD_Ativos_Subjacentes para o Tipo IF = "OPC" .
Quantidade	Indica a quantidade do ativo subjacente da opção.	Condicional	Tipo: Numérico com até 14 (quatorze) inteiros e 8(oito) decimais Campo de preenchimento obrigatório quando o campo "Valor Base" não for preenchido. Caso o campo "Valor Base" seja preenchido não será permitido o preenchimento deste campo.
Strike	Indica o valor/percentual do Strike da Opção.	Obrigatório	Tipo: Numérico com até 10(dez) inteiros e 8(oito) decimais
Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?	Indica se os valores informados para o Strike e Limitador estão em valor ou percentual.	Obrigatório	Campo tipo domínio com as opções: VALOR e PERCENTUAL.
Data Referência para valores em %	Indica a data de referência para verificação da cotação utilizada para calcular o	Condicional	Tipo: Data DD/MM/AAAA

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	Strike e Limitador do contrato, se forem registrados em percentual		Campo de preenchimento obrigatório, se informado "Strike/Limitador/Barreiras" = "PERCENTUAL"
Tipo de Exercício	Indica o tipo de exercício selecionado para o contrato.	Obrigatório	AMERICANA: opções que podem ser exercidas a qualquer momento EUROPEIA: opções que só podem ser exercidas na data de vencimento.
Tipo de Cotação	Informa o tipo de cotação do ativo subjacente.	Obrigatório	Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt
Data de fixing do ativo subjacente	Indica a data que será utilizada verificação da cotação do ativo subjacente no vencimento do contrato.	Obrigatório	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana. Tipo: Data DD/MM/AAAA. É permitida a indicação da data de vencimento do contrato ("fixing D0") para a classe "Taxa de Câmbio" e "Índices Nacionais" quando o ativo for Índice DI.
Data de fixing da moeda do ativo subjacente	Indica a data que será utilizada verificação da cotação da moeda do ativo subjacente no vencimento do contrato.	Obrigatório	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana. Tipo: Data DD/MM/AAAA
Opção Quanto	Informar se a valorização do ativo subjacente será em real ou na moeda do ativo.	Obrigatório	Se a opção selecionada for NÃO: Será contabilizada a variação da moeda de cotação do ativo subjacente. Se a opção selecionada for SIM: Não será contabilizada a variação da moeda do ativo. Deverá ser utilizada a cotação informada no campo "cotação para opção quanto" para cálculo do ajuste. Para mais informações, consultar o Caderno de Fórmulas – seção Funcionalidades – Opção Quanto Permitido para ativos subjacentes cotados em moeda diferente do real. Tipo Domínio com as opções: SIM e NÃO
Cotação para opção quanto	Indica o valor da cotação para Opção Quanto	Condicional	Tipo: Numérico com até 10 inteiros e 8 decimais Campo de preenchimento obrigatório, se informado "Opção Quanto" = SIM
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: Numérico com até 10 dígitos. Não é necessário que o Titular e o Lançador informem o mesmo número.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Combinação de Operações	Possibilidade de indicar que esse registro está vinculado (de modo informativo) com outro(s) registro(s), evidenciando que se trata de operações combinadas.	Opcional	Tipo: Texto com 20 caracteres
Valor Base	Indica o Valor Base do contrato	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando o campo "Quantidade" não for preenchido. Caso o campo "Quantidade" seja preenchido não será permitido o preenchimento deste campo.

Prêmio				
Prêmio Unitário	Valor Financeiro Total do Prêmio	Modalidade de liquidação do prêmio	Data de Liquidação do Prêmio	Conta Liquidante do Prêmio

Prêmio			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Prêmio Unitário	Preço unitário, em Reais, pago pelo Titular ao Lançador.	Obrigatório	Tipo: Numérico com até 10(dez) inteiros e 8(oito) decimais Não pode ser preenchido em conjunto com o campo "Valor Financeiro Total do Prêmio" Campo de preenchimento opcional. Somente possível de ser preenchido com registros utilizando o campo "Quantidade"
Valor Financeiro Total do Prêmio	Indica o Valor Financeiro Total do Prêmio para o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico com até 10(dez) inteiros e 8(oito) decimais Deverá ser preenchido, se houver. Não pode ser preenchido em conjunto com o campo "Prêmio Unitário". Campo de preenchimento opcional. Somente possível de ser preenchido com registros utilizando o campo "Valor Base"
Modalidade de Liquidação do Prêmio	Indica qual a Modalidade se dará a Liquidação Financeira do Prêmio, caso a data de liquidação do prêmio seja igual a D0 do registro.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, se informado o "Prêmio Unitário". Caso a data de liquidação do prêmio seja diferente a data de registro, o campo só aceita a modalidade SEM MODALIDADE

Prêmio			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Campo tipo domínio com as opções: SEM MODALIDADE, BRUTA ou BILATERAL , onde: SEM MODALIDADE: Exclusivo para registro de operações com Cliente 1 ou 2 BRUTA ou BILATERAL: Exclusivo para registro de operações com mercado.
Data de liquidação do Prêmio	Indica a data no qual o prêmio informado será liquidado.	Opcional	Se informado, a Data de Liquidação do Prêmio deve ser dia útil maior ou igual à Data de Registro e menor ou igual à Data de Vencimento. Caso esse campo não seja preenchido e seja informado o "Prêmio Unitário", o sistema utilizará a data de registro para liquidação do prêmio. Tipo: Data DD/MM/AAAA
Conta Liquidante do Prêmio	Conta do Participante responsável pela liquidação do prêmio	Opcional	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)

Limitador e Barreiras			
Limitador	Periodicidade de Verificação das Barreiras	Rebate Unitário	
,	▼	,	
Barreira de KI	Direção Barreira de KI	Tipo de Cotação p/ Verificação de Barreira de KI	Trigger - Proporção
,	▼	▼	▼
Barreira de KO	Direção Barreira de KO	Tipo de Cotação p/ Verificação de Barreira de KO	Liquidação do Rebate de KO
,	▼	▼	▼

Limitador e Barreiras			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limitador	Indica o valor/percentual do Limitador da Opção.	Opcional	Tipo: Numérico com até 14(quatorze) inteiros e 8(oito) decimais Quando for informado no campo "Tipo de Opção" o domínio: • "CALL" : o valor/percentual do Limitador deve ser maior que o valor do Strike • "PUT" : o valor/percentual do Limitador deve ser menor que o valor do Strike
Periodicidade de Verificação das Barreiras	Indica o tipo de verificação da barreira.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório quando houver

Limitador e Barreiras			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Barreiras de Knock In e/ou Knock Out. Tipo domínio com as opções: AMERICANA e EUROPEIA
Rebate Unitário	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.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Barreiras de Knock In e/ou Knock Out Tipo: Numérico com até 10(dez) inteiros e 8(oito) decimais
Barreira de KI	Indica o valor da barreira	Opcional	Preenchimento obrigatório quando houver Barreira de Knock In Tipo: Numérico com até 14(quatorze) inteiros e 8(oito) decimais
Direção Barreira de KI	Indica a direção da barreira	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Knock In. Tipo domínio com as opções: ALTA e BAIXA
Tipo de Cotação p/ Verificação de Barreira de KI		Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Knock In. Tipo domínio com as opções: FECHAMENTO, MÍNIMO, MÁXIMO, MEDIO e AJUSTE
Barreira de KO	Indica o valor da barreira	Opcional	Preenchimento obrigatório quando houver Barreira de Knock Out Tipo: Numérico com até 14(quatorze) inteiros e 8(oito) decimais
Direção Barreira de KO	Indica a direção da barreira	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Knock Out. Tipo domínio com as opções: ALTA e BAIXA
Tipo de Cotação p/ Verificação de Barreira de KO		Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Knock Out. Tipo domínio com as opções: FECHAMENTO, MÍNIMO, MÁXIMO, MEDIO e AJUSTE
Trigger - Proporção	Indica que as barreiras serão ajustadas proporcionalmente ao ajuste do Strike, na ocorrência de proventos	Opcional	Tipo domínio com as opções: SIM e “Vazio”
Liquidação do Rebate de KO	Indica quando ocorrerá a liquidação do valor do rebate	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Knock Out.

Limitador e Barreiras			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Tipo domínio com as opções: NO ATO e NO VENCIMENTO

Provento

Proteção contra Proventos

▼

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Proventos			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Proteção contra Proventos	Campo informativo para indicar se haverá tratamento de proventos na Opção.	Obrigatório	Presente apenas nas telas de registro de Ações Nacionais e Internacionais. Campo tipo domínio com as opções: "SIM-B3" (apenas para Ações Nacionais) e "NÃO" (para Ações Nacionais e Internacionais)

Observação:

- Quando o Campo Trigger Proporção estiver preenchido com SIM, o sistema não realizará o ajuste nas Barreiras de KI e de KO. Pois neste modelo de registro o trigger é uma proporção percentual aplicada sobre o Preço de Exercício, então não será impactada.
- Nas classes de Ativo Subjacente: "Commodities" e "Taxas de Câmbio" é possível o registro com Média Asiática, conforme tela abaixo:
 - No caso de **Média Aritmética Simples – Informar Datas** deve ser inserida a Quantidade de "Datas de Verificação" e o sistema irá disponibilizar tantos campos de datas forem informadas neste campo
 - Caso seja **Média Aritmética Simples – Janela de Datas** o sistema disponibilizará as Datas Inicial e Final para preenchimento
 - Caso seja **Média Aritmética Ponderada – Informar Datas** deve ser inserida a Quantidade de Datas de Verificação e o sistema irá disponibilizar tantos campos de "Datas" como também os campos de "Quantidade" que foram informadas

Média Asiática

Média Asiática

▼

Quantidade de Datas de Verificação

Aritmética Simples - Informar Datas

Aritmética Simples - Janela de Datas

Aritmética Ponderada - Informar Datas

Observação: ao preencher “SIM” no campo Strike/Limitador/Barreiras em Reais, é possível indicar datas para captura da moeda diferentes das datas para captura do ativo subjacente no caso da “Média Aritmética Simples – Informar Datas” e “Média Aritmética Ponderada – Informar Datas”. Para isso, as datas de verificação da moeda devem atender os seguintes requisitos:

- Pelo menos uma das Data de Verificação da Moeda deve ser maior que a Data de Início do contrato.
- Todas as Datas de Verificação da Moeda devem ser menores que a Data de Vencimento.

[SUMÁRIO](#)[REGISTRO](#)[REGISTRO - VCP](#)[ALTERAÇÃO](#)[ANTECIPAÇÃO](#)[ATUALIZAÇÃO DA OPÇÃO](#)[CANCELAMENTO](#)[CONSULTAS](#)[+INFOS](#)

2. REGISTRO DE CONTRATO VCP

Através desta função é possível realizar o registro de um contrato da classe do ativo subjacente = VCP.

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.

FORMAS DE LANÇAMENTO	FUNCIONALIDADES
Tela: Menu Opções Flexíveis > Lançamentos > Registro	• Opção com Verificação Europeia ou Americana • Barreiras (Knock In, Knock Out Knock In/Out) • Limitadores • Média Asiática • Proventos
Arquivo: 5.3.1. Registro de Contrato de Opção VCP 5.3.2. Registro de Contrato de Opção VCP Versão 2	
Mensageria:	

Tela de Filtro

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Registro

Registro de contrato

Ação

INCLUIR

Código IF

Classe do Ativo Subjacente

VCP

Classe do Ativo VCP

COMMODITIES

Confirmar

Limpar Campos

Desistir

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Strike	Indica o valor/percentual do Strike da Opção.	Obrigatório	Tipo: Numérico com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais
Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?	Indica se os valores informados para o Strike e Limitador estão em valor ou percentual.	Obrigatório	Campo tipo domínio com as opções: VALOR e PERCENTUAL.
Data de fixing do ativo subjacente	Indica a data que será utilizada verificação da cotação do ativo subjacente no vencimento do contrato.	Obrigatório	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana. Tipo: Data DD/MM/AAAA
Opção Quanto	Informar se a valorização do ativo subjacente será em real ou na moeda do ativo.	Opcional	Se a opção selecionada for <vazio>: Será contabilizada a variação da moeda Se a opção selecionada for Sim: Não será contabilizada a variação da moeda do ativo. Deverá ser utilizada a cotação informada no campo “cotação para opção quanto” para cálculo do ajuste. Para mais informações, consultar o Caderno de Fórmulas – seção Funcionalidades – Opção Quanto Permitido para ativos subjacentes cotados em moeda diferente do real. Campo tipo domínio com as opções: SIM e <vazio>
Cotação para opção quanto	Indica o valor da cotação para Opção Quanto	Condicional	Tipo: Numérico com até 10 inteiros e 8 decimais Campo de preenchimento obrigatório, se informado “Opção “Quanto” = SIM”
Strike/Limitador/Barreiras em Reais	Indica se os valores informados para o Strike, Limitador e Barreiras estão em reais	Opcional	Permitido para ativos subjacentes cotados em moeda diferente do real. Campo tipo domínio com as opções: SIM e <vazio>
Tipo de Cotação VCP	Informa o tipo de cotação do ativo subjacente.	Obrigatório	Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVAT IVOS_COE.txt
Fonte de informação (Ativo VCP)	Indica a fonte de informação para verificação da cotação do ativo subjacente VCP.	Obrigatório	Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVAT IVOS_COE.txt
Código do Ativo VCP na Fonte de Informação	Informar o código/ticker/nome do ativo subjacente VCP na Fonte de Informação informada anteriormente.	Opcional	Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVAT IVOS_COE.txt
Data Referência para valores em %	Indica a data de referência para verificação da cotação utilizada para calcular o Strike, Limitador e Barreiras	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, se informado “Strike/Limitador/Barreiras” = “PERCENTUAL”

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	do contrato, se forem registrados em percentual		Tipo: Data DD/MM/AAAA
Moeda do Ativo VCP	Indica a moeda na qual é cotado o ativo subjacente VCP.	Opcional	Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt
Tipo de Cotação (Moeda do Ativo VCP)	Informar o tipo de cotação da moeda do ativo subjacente VCP, para cálculo da variação cambial, quando houver.	Opcional	Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt
Fonte de Informação (Moeda do Ativo VCP)	Indica a fonte de informação para verificação da cotação da moeda do ativo subjacente VCP.	Opcional	Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt
Data de fixing da moeda do ativo subjacente	Indica a data que será utilizada verificação da cotação da moeda do ativo subjacente no vencimento do contrato.	Opcional	Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana. Tipo: Data DD/MM/AAAA
Cotação Inicial do Ativo (em Reais)	Deve ser indicado a Cotação Inicial do ativo Subjacente em Reais.	Obrigatório	Tipo: Numérico com até 10(dez) inteiros e 8(oito) decimais
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Não é necessário que o Titular e o Lançador informem o mesmo número. Tipo: Numérico com até 10(dez) dígitos.
Combinação de Operações	Possibilidade de indicar que esse registro está vinculado (de modo informativo) com outro(s) registro(s), evidenciando que se trata de operações combinadas.	Opcional	Tipo: Texto com 20 caracteres
Código da Estratégia	Campo de preenchimento obrigatório para registro de uma estrutura VCP-Estratégia, quando houver.	Condicional	Informar o código da estratégia. IMPORTANTE: o código da estratégia deve estar habilitado para a conta do Participante. Para maiores informações, verificar o Manual de Operações do MID – Módulo de Informação de Derivativos.
Informações Complementares	Informar os dados adicionais necessários para o registro, de acordo com as instruções da seção: “Curvas VCP” nesse manual.	Opcional	Tipo: Texto com 50 caracteres Este campo não aceita o caractere “,”

Média Asiática

Média Asiática

Quantidade de Datas de Verificação

Média Asiática			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Média Asiática	Indica se o contrato possui média asiática e qual o tipo de média.	Opcional	Campo tipo domínio com as opções: ARITMÉTICA SIMPLES – INFORMAR DATAS; ARITMÉTICA SIMPLES – JANELA DE DATAS; ARITMÉTICA PONDERADA – INFORMAR DATAS, onde: ARITMÉTICA SIMPLES – INFORMAR DATAS: Média aritmética simples, onde o participante irá informar todas as datas de verificação da média. ARITMÉTICA SIMPLES – JANELA DE DATAS: Média aritmética simples, onde o participante irá informar a data inicial e a data final de verificação da média e serão consideradas todas as datas com cotação disponível para o ativo subjacente nesse intervalo. ARITMÉTICA PONDERADA – INFORMAR DATAS: Média aritmética ponderada, onde o participante irá informar todas as datas de verificação da média e seus respectivos pesos.
Quantidade de Datas de Verificação	Indica a quantidade de datas de verificação da média asiática	Opcional	Campo tipo numérico, limitado a 1.100 datas. Campo de preenchimento obrigatório, se informado “Média Asiática” = “ARITMÉTICA SIMPLES – INFORMAR DATAS ou ARITMÉTICA PONDERADA – INFORMAR DATAS” O campo não pode ser preenchido, se informado “Média Asiática” = “ARITMÉTICA SIMPLES – JANELA DE DATAS”

Intermediação

Conta Intermediador

Comissão Paga pelo Titular em R\$

Comissão Paga pelo Lançador em R\$

Intermediação			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Conta Intermediador	Indica se o contrato possui média asiática e qual o tipo de média.	Opcional	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Comissão Paga pelo Titular (ou Lançador) em R\$	Valor da comissão paga pelo titular, em reais, ao intermediador da Opção.	Opcional	Tipo: Numérico com até 11 (onze) inteiros e 2 (dois) decimais. A liquidação da Intermediação só ocorrerá no dia do Registro

O pagamento da comissão pela intermediação de Contrato de Opção através da B3, quando devido, somente é permitido se efetuado na mesma data em que o contrato de opção for registrado no Módulo de Opções Flexíveis.

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, caso esta já tenha sido liquidada.

2.1. VCP DE AÇÕES NACIONAIS

Informações necessárias

Informar nos respectivos campos do registro do contrato, as informações indicadas na tabela a seguir.

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Sobre o ativo		
Fonte de Informação	- Fonte de Informação VCP; - Código do Ativo na Fonte de Informação	Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novas fontes de informação, através do e-mail derivativos@b3.com.br
Tipo de cotação	Tipo de Cotação Ativo VCP	Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novos tipos de cotações, através do e-mail derivativos@b3.com.br
Se futuro ou opção sobre o ativo, informar também: - Código do contrato - Bolsa de negociação / Fonte de informação - Mês e ano de vencimento do contrato	Informações Complementares	
Strike e fixing para vencimento		
Strike da Opção	- Strike; - Strike/Limitador/Barreiras em Valour ou Percentual?	
Correção do strike da Opção (em valor) por CDI	Informações Complementares	Informar os parâmetros para correção do valor do strike: % do indexador de correção
Data de Fixing para vencimento do ativo objeto	Data de Fixing do Ativo Subjacente	
Média aritmética		
Se for simples ou ponderada: Datas da média Pesos, se média ponderada	Bloco de informações "Média Asiática"	
Limitador e Barreiras		
Limitador de alta ou baixa e Barreira de KI e/ou KO	Bloco de informações "Limitador e Barreiras"	
Verificação de barreiras (Americana/Europeia)	Periodicidade de verificação das Barreiras	A periodicidade Americana assume a verificação de D+1 da data de início até a data de fixing inclusive
Se verificação de barreiras = Americana, mas com janela de datas de observação, informar também: Janela de verificação das barreiras com a Data de Início (inclusive) e Data Final (inclusive)	Informações Complementares	Informar a janela de verificação das barreiras com a Data de Início (inclusive) e a Data Final (inclusive)

Tratamento de Proventos		
Indicar se haverá ou não ajuste de proventos no contrato	Proteção Contra Proventos	
Metodologia de tratamento de proventos	Informações Complementares	Proventos em dinheiro Informar se houver proteção contra proventos em dinheiro e se ela será sobre: a) proventos pagos durante a operação b) proventos anunciados e não pagos durante a operação (proventos pagos ex), c) os dois casos. - Indicar se os proventos em dinheiro serão ajustados nos parâmetros do contrato (strike/limitador/barreiras) ou pago no vencimento da operação. - Indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) caso haja o pagamento do provento em dinheiro no vencimento da operação, e a correção do provento for por outro indicador diferente da valorização da própria ação. - Informar se a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento; - Taxa de descapitalização do provento pago ex, se houver. - Valor do Limitador Inferior ou Superior, se houver. Proventos em quantidade - Informar se houver proteção contra proventos em quantidade. Subscrição e demais direitos de preferência - Informar se houver tratamento em função de subscrição ou qualquer outro direito de preferência; - Indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) caso a correção do valor referente ao ajuste de subscrição incorporado à curva seja por outro indicador diferente da valorização da própria ação.

Tratamento de Proventos

É disponibilizado no registro de Opções Flexíveis com VCP o campo “Proteção contra Proventos” com os seguintes domínios abaixo:

- SIM – AJUSTADO PELAS PARTES
- NÃO

Observações:

Caso seja indicado **SIM – AJUSTADO PELAS PARTES**, deverá ser informado no campo **‘Informações Complementares’** o tratamento adotado pelas partes para o contrato (para mais informações, verificar a seção “Curvas VCP” desse manual). No vencimento, será de responsabilidade do Participante considerar a inclusão do efeito do provento no Lançamento do PU para liquidação da Opção.

[SUMÁRIO](#)[REGISTRO](#)[REGISTRO - VCP](#)[ALTERAÇÃO](#)[ANTECIPAÇÃO](#)[ATUALIZAÇÃO DA OPÇÃO](#)[CANCELAMENTO](#)[CONSULTAS](#)[+INFOS](#)

2.2.VCP DE AÇÕES INTERNACIONAIS

Informações necessárias

Informar nos respectivos campos do registro do contrato, as informações indicadas na tabela a seguir.

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Sobre o ativo		
Fonte de Informação	- Fonte de Informação VCP; - Fonte de Informação Moeda do Ativo VCP; - Código do Ativo na Fonte de Informação	Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novas fontes de informação, através do e-mail derivativos@b3.com.br
Tipo de cotação	- Tipo de Cotação Ativo VCP - Tipo de Cotação Moeda do Ativo VCP	Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novos tipos de cotações, através do e-mail derivativos@b3.com.br
Se futuro ou opção sobre o ativo, informar também: - Código do contrato - Bolsa de negociação / Fonte de informação - Mês e ano de vencimento do contrato	Informações Complementares	
Strike e fixing para vencimento		
Strike da Opção	- Strike; - Strike/Limitador/Barreiras em Valour ou Percentual?	
Correção do strike da Opção (em valor) por CDI	Informações Complementares	Informar os parâmetros para correção do valor do strike: % do indexador de correção
Data de Fixing para vencimento do ativo objeto	- Data de Fixing do Ativo Subjacente - Data de Fixing da Moeda do Ativo Subjacente	
Média aritmética		
Se for simples ou ponderada: Datas da média Pesos, se média ponderada	Bloco de informações "Média Asiática"	
Limitador e Barreiras		
Limitador de alta ou baixa e Barreira de KI e/ou KO	Bloco de informações "Limitador e Barreiras"	
Verificação de barreiras (Americana/Europeia)	Periodicidade de verificação das Barreiras	A periodicidade Americana assume a verificação de D+1 da data de início até a data de fixing inclusive

Se Verificação de barreiras = Americana, mas com janela de datas de observação, informar também: Janela de verificação das barreiras com a Data de Início (inclusive) e a Data Final (inclusive)	Informações Complementares	Informar a janela de verificação das barreiras com a Data de Início (inclusive) e a Data Final (inclusive)
Tratamento de Proventos		
Indicar se haverá ou não ajuste de proventos no contrato	Proteção Contra Proventos	
Metodologia de tratamento de proventos	Informações Complementares	Proventos em dinheiro Informar se houver proteção contra proventos em dinheiro e se ela será sobre: a) proventos pagos durante a operação b) proventos anunciados e não pagos durante a operação (proventos pagos ex), c) os dois casos. - Indicar se os proventos em dinheiro serão ajustados nos parâmetros do contrato (strike/limitador/barreiras) ou pago no vencimento da operação. - Indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) caso haja o pagamento do provento em dinheiro no vencimento da operação, e a correção do provento for por outro indicador diferente da valorização da própria ação. - Informar se a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento; - Taxa de descapitalização do provento pago ex, se houver. - Valor do Limitador Inferior ou Superior, se houver. Proventos em quantidade - Informar se houver proteção contra proventos em quantidade. Subscrição e demais direitos de preferência - Informar se houver tratamento em função de subscrição ou qualquer outro direito de preferência; - Indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) caso a correção do valor referente

		ao ajuste de subscrição incorporado à curva seja por outro indicador diferente da valorização da própria ação.
--	--	--

Tratamento de Proventos

É disponibilizado no registro de Opções Flexíveis com VCP o campo “Proteção contra Proventos” com os seguintes domínios abaixo:

- SIM – AJUSTADO PELAS PARTES
- NÃO

Observações:

Caso seja indicado **SIM – AJUSTADO PELAS PARTES**, deverá ser informado no campo **‘Informações Complementares’** o tratamento adotado pelas partes para o contrato (para mais informações, verificar a seção “Curvas VCP” desse manual). No vencimento, será de responsabilidade do Participante considerar a inclusão do efeito do provento no Lançamento do PU para liquidação da Opção.

2.3.VCP DE ÍNDICES NACIONAIS

Informações necessárias

Informar nos respectivos campos do registro do contrato, as informações indicadas na tabela a seguir:

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Sobre o ativo		
Fonte de Informação	- Fonte de Informação VCP; - Código do Ativo na Fonte de Informação	Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novas fontes de informação, através do e-mail derivativos@b3.com.br
Tipo de cotação	Tipo de Cotação Ativo VCP	Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novos tipos de cotações, através do e-mail derivativos@b3.com.br
Cotação inicial	Cotação Inicial do Ativo (em reais)	
Strike e fixing para vencimento		
Strike da Opção	- Strike; - Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual? - Data Referência para Valores em %	Se o Strike for em PERCENTUAL e houver atualização da quantidade após a definição do Strike em VALOR, informar no campo "Informações Complementares" que haverá atualização. Importante: O Valor Base (em reais) da operação deverá ser refletido através dos campos de "Quantidade" e "Cotação Inicial do Ativo (em reais)" A quantidade será atualizada de acordo com a fórmula: $Quantidade\ Atualizada = Valor\ Base\ (em\ reais) / Strike\ em\ VALOR$
Data de Fixing para vencimento do ativo objeto	Data de Fixing do Ativo Subjacente	
Média aritmética		
Se for simples ou ponderada: Datas da média Pesos, se média ponderada	Bloco de informações "Média Asiática"	
Limitador e Barreiras		
Limitador de alta ou baixa e Barreira de KI e/ou KO	Bloco de informações "Limitador e Barreiras"	
Verificação de barreiras (Americana/Europeia)	Periodicidade de verificação das Barreiras	A periodicidade Americana assume a verificação de D+1 da data de início até a data de fixing inclusive
Se Verificação de barreiras = Americana, mas com janela de datas de observação, informar também: Janela de verificação das barreiras com a Data de Início	Informações Complementares	Informar a janela de verificação das barreiras com a Data de Início (inclusive) e a Data Final (inclusive)

(inclusive) e a Data Final (inclusive)		
---	--	--

+INFOS

CONSULTAS

CANCELAMENTO

ATUALIZAÇÃO DA OPÇÃO

ANTECIPAÇÃO

ALTERAÇÃO

REGISTRO - VCP

REGISTRO

SUMÁRIO

2.4.VCP DE ÍNDICES INTERNACIONAIS

Informações necessárias

Informar nos respectivos campos do registro do contrato, as informações indicadas na tabela a seguir:

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Sobre o ativo		
Fonte de Informação	- Fonte de Informação VCP; - Fonte de Informação Moeda do Ativo VCP; - Código do Ativo na Fonte de Informação	Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novas fontes de informação, através do e-mail derivativos@b3.com.br .
Tipo de cotação	- Tipo de Cotação Ativo VCP - Tipo de Cotação Moeda do Ativo VCP	Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novos tipos de cotações, através do e-mail derivativos@b3.com.br
Se futuro ou opção sobre o ativo, informar também: - Código do contrato - Bolsa de negociação / Fonte de informação - Mês e ano de vencimento do contrato futuro	Informações Complementares	
Strike e fixing para vencimento		
Strike da Opção	- Strike; - Strike/Limitador/Barreiras em Valour ou Percentual?	
Data de Fixing para vencimento do ativo objeto	- Data de Fixing do Ativo Subjacente - Data de Fixing da Moeda do Ativo Subjacente	
Média aritmética		
Se for simples ou ponderada: Datas da média Pesos, se média ponderada	Bloco de informações "Média Asiática"	
Limitador e Barreiras		
Limitador de alta ou baixa e Barreira de KI e/ou KO	Bloco de informações "Limitador e Barreiras"	
Verificação de barreiras (Americana/Europeia)	Periodicidade de verificação das Barreiras	A periodicidade Americana assume a verificação de D+1 da data de início até a data de fixing inclusive
Se verificação de barreiras = Americana, mas com uma janela de datas de observação, informar também:	Informações Complementares	Informar a janela de verificação das barreiras com a Data de Início (inclusive) e a Data Final (inclusive)

Tratamento de Proventos		
Indicar se haverá ou não ajuste de proventos no contrato	Proteção Contra Proventos	
Metodologia de tratamento de proventos	Informações Complementares	Proventos em dinheiro Informar se houver proteção contra proventos em dinheiro e se ela será sobre: a) proventos pagos durante a operação b) proventos anunciados e não pagos durante a operação (proventos pagos ex), c) os dois casos. - Indicar se os proventos em dinheiro serão ajustados nos parâmetros do contrato (strike/limitador/barreiras) ou pago no vencimento da operação. - Indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) caso haja o pagamento do provento em dinheiro no vencimento da operação, e a correção do provento for por outro indicador diferente da valorização da própria ação. - Informar se a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento; - Taxa de descapitalização do provento pago ex, se houver. - Valor do Limitador Inferior ou Superior, se houver. Proventos em quantidade - Informar se houver proteção contra proventos em quantidade. Subscrição e demais direitos de preferência - Informar se houver tratamento em função de subscrição ou qualquer outro direito de preferência; - Indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) caso a correção do valor referente ao ajuste de subscrição incorporado à curva seja por outro indicador diferente da valorização da própria ação.
Janela de verificação das barreiras com a Data de Início (inclusive) e a Data Final (inclusive)		

SUMÁRIO

REGISTRO

REGISTRO - VCP

ALTERAÇÃO

ANTECIPAÇÃO

ATUALIZAÇÃO DA OPÇÃO

CANCELAMENTO

CONSULTAS

+INFOS

2.5.VCP DE COMMODITIES

Informações necessárias

Informar nos respectivos campos do registro do contrato, as informações indicadas na tabela a seguir:

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Sobre o ativo		
Tipo de cotação	- Tipo de Cotação Ativo VCP - Tipo de Cotação Moeda do Ativo VCP	a) Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novos tipos de cotações , através do e-mail derivativos@b3.com.br
Informações da Cesta		
Tipo de Cesta <i>Para mais informações sobre os tipos de cesta disponíveis, consultar: OPÇÕES VCP COM CESTA</i>	Classe do ativo VCP (Cesta "SPREAD")	a) Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novos tipos de cesta , através do e-mail derivativos@b3.com.br
Fonte de Informação	- Fonte de Informação VCP - Fonte de Informação Moeda do Ativo VCP;	a) Quando utilizado uma cesta, deve ser indicado a fonte de todos os ativos. <i>Exemplo: Fonte A + B</i> b) Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novas fontes de informação , através do e-mail derivativos@b3.com.br
Fator de Conversão da Mercadoria	Informações Complementares	a) Caso a mercadoria possua algum Fator de Conversão (para alterar a unidade de negociação, por ex, de barris para litros) informar o nome/ticker do ativo e o fator de conversão aplicado. <i>Exemplo: Ativo A * 1,12</i>
Moeda do Ativo Subjacente	Moeda do Ativo VCP	a) Quando utilizado uma cesta, indicar em qual moeda os ativos estão cotados. Caso existam ativos em diferentes moedas, deve ser indicado a moeda de todos eles. <i>Exemplo: Moeda A e B</i> b) Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novas moedas , através do e-mail derivativos@b3.com.br

2.6. VCP DE MOEDAS

Informações necessárias

Informar nos respectivos campos do registro do contrato, as informações indicadas na tabela a seguir:

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Sobre o ativo		
Fonte de Informação	- Fonte de Informação VCP; - Código do Ativo na Fonte de Informação	Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novas fontes de informação, através do e-mail derivativos@b3.com.br
Tipo de cotação	Tipo de Cotação Ativo VCP	Se necessário, é possível solicitar a inclusão de novos tipos de cotações, através do e-mail derivativos@b3.com.br
Informações Complementares	Informações Complementares	É possível indicar que o preço do Strike e Limitador serão compostos pela média asiática do período indicado.
Strike e fixing para vencimento		
Strike da Opção	- Strike; - Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?	É possível indicar que Strike e o Limitador serão preenchidos em PERCENTUAL para os casos onde os valores devem refletir a média asiática do período informado. Importante: É necessário informar no campo " Informações Complementares " que haverá esse tipo de atualização.
Data de Fixing para vencimento do ativo objeto	Data de Fixing do Ativo Subjacente	Deverá ser indicado a data de fixing para o vencimento da moeda indicada.
Média aritmética		
Se for simples ou ponderada: Datas da média Pesos, se média ponderada	Bloco de informações "Média Asiática"	Possibilidade de indicar o período de composição da média asiática para a formação do Strike e Limitador.
Limitador e Barreiras		
Limitador de alta ou baixa e Barreira de KI e/ou KO	Bloco de informações "Limitador e Barreiras"	Possibilidade de indicação dos valores em %.

2.7. OPÇÕES VCP COM CESTA

Atualmente, é possível utilizar alguns tipos de cesta no Opções VCP, através do campo “**Classe do Ativo VCP**”.

Cestas disponíveis:

1. **SPREAD**: O preço final da cesta é calculado pela diferença de preço dos ativos A e B.
 - a. Os ativos subjacentes que serão utilizados devem ser informados no campo “**Código do Ativo VCP na Fonte de Informação**” já no formato A-B (ativo A menos B) ou B-A (ativo B menos A).
 - b. O tipo de ativo utilizado deve ser informado no campo “**Ativo Subjacente VCP**”. (Por ex.: “PETRÓLEO”)

O cadastro de **novos tipos de cesta e os ativos subjacentes** delas podem ser demandados através do e-mail **derivativos@b3.com.br**

2.8. OPÇÕES VCP COM DUPLO KNOCK OUT/IN

Atualmente, é possível registrar uma opção com duas barreiras de Knock In ou duas barreiras de Knock Out no módulo de Opções VCP, através do campo “**Informações Complementares**”.

Deverá ser incluído o texto:

1. **Double KO**: Caso a opção tenha dois Knock Outs (Up and Out e Down and Out), deverá ser incluído o texto “Double KO” no campo **Informações Complementares**. (conforme exemplo abaixo)



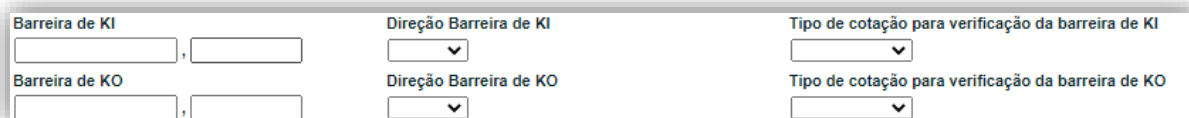
Informações Complementares

Double KO

2. **Double KI**: Caso a opção tenha dois Knock Ins (Up and In e Down and In), deverá ser incluído o texto “Double KI” no campo **Informações Complementares**, de forma análoga ao Double KI acima.

Em ambos os casos acima, os dados específicos das duas barreiras deverão ser informados obrigatoriamente nos campos:

- Barreira de KI
- Direção Barreira de KI
- Tipo de cotação para verificação de barreira de KI
- Barreira de KO
- Direção Barreira de KO
- Tipo de cotação para verificação de barreira de KO



Barreira de KI	Direção Barreira de KI	Tipo de cotação para verificação da barreira de KI
,		
Barreira de KO	Direção Barreira de KO	Tipo de cotação para verificação da barreira de KO
,		

2.9. OPÇÕES VCP - ESTRATÉGIA

O registro de Opção VCP - Estratégia poderá ser feito somente após a aprovação da estrutura conforme procedimento descrito no Manual de Normas de Operação com Derivativo.

3. ALTERAÇÃO

Através desta função, o participante pode realizar a alteração de um contrato de D0 até D+3 do registro.

A alteração do contrato pelo participante poderá ser feita tanto em contratos com Cliente quanto com Mercado.

As operações com cliente são finalizadas por comando único enquanto operações com Mercado requerem o duplo comando para o sistema de acatar a alteração

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu Opções Flexíveis > Lançamentos > Alteração e Exclusão de Contrato	1) A operação de antecipação pode ser estornada, através da função de Cancelamento de Operações neste módulo.
Arquivo: Não disponível	
Mensageria: Não disponível	

Para alterar o contrato de opção, o participante deve selecionar na Tela de Filtro, o Código IF e a ação **CORREÇÃO**.

Tela de Filtro

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Alteração e Exclusão de Contrato

Alteração e Exclusão de Contrato

Código IF

Ação

CORRECAO ▾

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Tela de Inclusão de Alteração de Contrato

Opções Flexíveis > Lançamentos > Alteração e Exclusão de Contrato

Correção de Opção

Código IF
24J00019776

Data Registro
03/10/2024

Instrumento Financeiro
OPC

Classe do Ativo Subjacente
ACOES

Partes do contrato

Parte (Conta)
10020.001

Posição da Parte
TITULAR

CPF/CNPJ Cliente Parte

Contraparte (Conta)
05000.005

CPF/CNPJ Cliente Contraparte

Características

Tipo de Opção
Call

Strike
35

Tipo de Cotação
FECHAMENTO

Data Início
3/10/2024

Strike (percentual)

Data de fixing do ativo subjacente
30/10/2024

Data Vencimento
9/9/2025

Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?
VALOR

Combinação de Operações

Ativo Subjacente
PETR4

Data Referência para valores em %

Valor base

Quantidade
8000

Tipo de Exercício
AMERICANA

Meu Número

Prêmio

Prêmio Unitário
0.25000000

Valor Financeiro Total do Prêmio

Modalidade de liquidação do prêmio
BILATERAL

Data de Liquidação do Prêmio
30/10/2024

Conta Liquidante do Prêmio

Limitador e Barreiras

Limitador

Barreira de KI

Barreira de KO

Liquidação do Rebate de KO

Limitador (percentual)

Barreira KI (percentual)

Barreira KO (percentual)

Periodicidade de Verificação das Barreiras

Direção Barreira de KI

Direção Barreira de KO

Rebate Unitário

Tipo de Cotação p/ Verificação de Barreira de KI

Tipo de Cotação p/ Verificação de Barreira de KO

Situação Barreira KI

Situação Barreira KO

Data de Atingimento de KI

Data de Atingimento de KO

Provento

Proteção contra Proventos
SIM - B3

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

- SUMÁRIO
- REGISTRO
- REGISTRO - VCP
- ALTERAÇÃO
- ANTECIPAÇÃO
- ATUALIZAÇÃO DA OPÇÃO
- CANCELAMENTO
- CONSULTAS
- +INFOS

Descrição dos campos da Tela de Alteração

Características			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Tipo de Opção	O tipo de opção do contrato.	Obrigatório	Tipo: domínio com as opções: CALL e PUT
Data Início	Data de início do contrato	Obrigatório	Formato: DD/MM/YYYY Não pode ser menor do que a Data de Registro, exceto quando operação realizada com conta cliente 1, limitado a D-2. Nos contratos que envolvam Cliente 1 ou 2, a data informada pode ser anterior a Data de Registro em até D-2, inclusive.
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato.	Obrigatório	Formato: DD/MM/YYYY Deve ser maior que Data Início.
Ativo Subjacente	Indica o ativo subjacente da opção.	Obrigatório	Tipo: domínio com as opções dos ativos subjacentes habilitados para a classe de ativos selecionada.
Quantidade	Indica a quantidade do ativo subjacente da opção.	Condicional	Tipo: numérico com até 14 inteiros e 8 decimais. Campo de preenchimento obrigatório quando o campo "Valor Base" não for preenchido. Caso o campo "Valor Base" seja preenchido não será permitido o preenchimento deste campo.
Strike	Indica o valor/percentual do Strike da Opção	Obrigatório	Tipo: Numérico com até 10 inteiros e 8 decimais

Características			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?	Indica se os valores informados para o Strike e Limitador estão em valor ou percentual.	Obrigatório	Tipo: domínio com as opções: VALOR e PERCENTUAL.
Data Referência para valores em %	Indica a data de referência para verificação da cotação utilizada para calcular o Strike e Limitador do contrato, se forem registrados em percentual	Condicional	Formato: DD/MM/YYYY
Tipo de Exercício	Indica o tipo de exercício selecionado para o contrato.	Obrigatório	Tipo: domínio com as opções: EUROPEIA e AMERICANA.
Tipo de Cotação	Indica o tipo de cotação selecionado para o contrato.	Obrigatório	Tipo: domínio com as opções: MÍNIMO, MÁXIMO, FECHAMENTO, MÉDIO E AJUSTE. Mais informações: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt
Data de fixing do ativo subjacente	Indica a data que será utilizada verificação da cotação do ativo subjacente no vencimento do contrato.	Obrigatório	Formato: DD/MM/YYYY Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana.
Data de fixing da moeda do ativo subjacente	Indica a data que será utilizada verificação da cotação da moeda do ativo subjacente no vencimento do contrato.	Obrigatório	Formato: DD/MM/YYYY Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana.
Opção Quanto	Campo para informar se a valorização do ativo subjacente será em real ou na moeda do ativo.	Obrigatório	Tipo: domínio com as opções SIM E NÃO. Se a opção selecionada for NÃO : Será contabilizada a variação da moeda de cotação do ativo subjacente. Se a opção selecionada for SIM : Não será contabilizada a

Características			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			variação da moeda do ativo. Deverá ser utilizada a cotação informada no campo “cotação para opção quanto” para cálculo do ajuste
Cotação para opção quanto	Indica o valor da cotação para Opção Quanto	Condicional	Obrigatório caso preencha o campo “Opção Quanto” como SIM. Tipo: numérico com até 10 dígitos inteiros e 8 decimais.
Meu número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: numérico com até 10 dígitos.
Combinação de Operações	Possibilidade de indicar que esse registro está vinculado (de modo informativo) com outro(s) registro(s), evidenciando que tratam-se de operações combinadas.	Condicional	Tipo: alfanumérico com até 20 dígitos
Valor Base	Indica o Valor Base do contrato	Condicional	Tipo: numérico com até 14 dígitos inteiros e 2 dígitos decimais. Campo de preenchimento obrigatório quando o campo “Quantidade” não for preenchido. Caso o campo “Quantidade” seja preenchido não será permitido o preenchimento deste campo.

Prêmio			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Prêmio Unitário	Prêmio unitário da opção.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campo com 10 números inteiros e 8 decimais).
Valor Financeiro Total do Prêmio	Valor Financeiro do Prêmio	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campo com 10 números inteiros e 2 decimais).
Modalidade de Liquidação do Prêmio	Indica qual a Modalidade se dará a Liquidação Financeira do Prêmio, caso a data de liquidação do prêmio seja igual a D0 do registro.	Obrigatório	Tipo: domínio com opções BRUTA, BILATERAL e SEM MODALIDADE. Caso a data de liquidação do prêmio seja diferente a data de registro, o campo só aceita a modalidade SEM MODALIDADE Campo tipo domínio com as opções: SEM MODALIDADE, BRUTA ou BILATERAL.
Data de liquidação do Prêmio	Indica a data no qual o prêmio informado será liquidado.	Obrigatório	Formato: DD/MM/AAAA A data informada deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento.
Conta Liquidante do Prêmio	Conta do Participante responsável pela liquidação do prêmio	Obrigatório	Tipo: numérico com (5,2 e 1 números inteiros)
Limitador	Indica o valor/percentual do Limitador da Opção.	Opcional	Tipo: Numérico com até 14(quatorze) inteiros e 8(oito) decimais Quando for informado no campo "Tipo de Opção" o domínio: • "CALL": o valor/percentual do Limitador deve ser maior que o valor do Strike • "PUT": o valor/percentual do Limitador deve ser menor que o valor do Strike

Prêmio			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limitador (percentual)	Indica o valor em percentual do Limitador da Opção.	Opcional	Tipo: Numérico (Campo com 14 números inteiros e 8 decimais). Quando for informado no campo “Tipo de Opção” o domínio: “CALL”: o valor/percentual do Limitador deve ser maior que o valor do Strike “PUT”: o valor/percentual do Limitador deve ser menor que o valor do Strike
Periodicidade de Verificação das Barreiras	Indica o tipo de verificação da barreira.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Barreiras de Knock In e/ou Knock Out. Tipo domínio com as opções: AMERICANA e EUROPEIA
Rebate Unitário	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.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Barreiras de Knock In e/ou Knock Out Tipo: Numérico com até 10(dez) inteiros e 8(oito) decimais
Barreira de KI	Indica o valor da barreira	Opcional	Preenchimento obrigatório quando houver Barreira de Knock In Tipo: Numérico com até 14(quatorze) inteiros e 8(oito) decimais
Barreira de KI (percentual)	Indica o valor em percentual da Barreira de KI da Opção.	Opcional	Tipo: Numérico (Campo com 14 números inteiros e 8 decimais).

Prêmio			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Quando for informado no campo “Tipo de Opção” o domínio: “CALL” : o valor/percentual da Barreira de KI deve ser maior que o valor do Strike “PUT” : o valor/percentual da Barreira de KI deve ser menor que o valor do Strike
Direção Barreira de KI	Indica a direção da barreira	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Knock In. Tipo domínio com as opções: ALTA e BAIXA
Tipo de Cotação p/ Verificação de Barreira de KI		Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Knock In. Tipo domínio com as opções: FECHAMENTO, MÍNIMO, MÁXIMO, MEDIO e AJUSTE
Situação Barreira KI	Indica o atingimento ou não da Barreira de KI	Condicional	Tipo domínio com as opções: ATINGIDA e NÃO ATINGIDA
Data de Atingimento de KI	Informa a data do atingimento da Barreira de KI	Condicional	Tipo data dd/mm/aaaa
Barreira de KO	Indica o valor da barreira	Opcional	Preenchimento obrigatório quando houver Barreira de Knock Out Tipo: Numérico com até 14(quatorze) inteiros e 8(oito) decimais
Barreira de KO (percentual)	Indica o valor em percentual da Barreira de KO da Opção.	Opcional	Tipo: Numérico (Campo com 14 números inteiros e 8 decimais). Quando for informado no campo “Tipo de Opção” o domínio: “CALL” : o valor/percentual da Barreira de KO deve ser maior que o valor do Strike

Prêmio			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			“PUT” : o valor/percentual da Barreira de KO deve ser menor que o valor do Strike
Direção Barreira de KO	Indica a direção da barreira	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Knock Out. Tipo domínio com as opções: ALTA e BAIXA
Tipo de Cotação p/ Verificação de Barreira de KO		Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Knock Out Tipo domínio com as opções: FECHAMENTO, MÍNIMO, MÁXIMO, MEDIO e AJUSTE
Situação Barreira KO	Indica o atingimento ou não da Barreira de KO	Condicional	Tipo domínio com as opções: ATINGIDA e NÃO ATINGIDA
Data de Atingimento de KO	Informa a data do atingimento da Barreira de KO	Condicional	Tipo data dd/mm/aaaa
Liquidação do Rebate de KO	Indica quando ocorrerá a liquidação do valor do rebate	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando houver Knock Out. Tipo domínio com as opções: NO ATO e NO VENCIMENTO

Proventos			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Proteção contra Proventos	Campo informativo para indicar se haverá tratamento de proventos na Opção.	Obrigatório	Tipo: domínio com a opção: “NÃO”

4. ANTECIPAÇÃO

Esta função permite aos participantes realizarem 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 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 B3.

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu > Opções Flexíveis > Lançamentos > Antecipação de Contrato Arquivo: 5.3.3. Antecipação de Opção Mensageria: Não disponível	1) A operação de antecipação pode ser estornada, através da função de Cancelamento de Operações neste módulo.
PRAZOS: É possível a partir do primeiro dia útil subsequente ao seu registro no Módulo até o dia útil anterior (D-1) ao vencimento da opção.	

Tela de Filtro

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato	
Código IF	
Pesquisar	Limpar Campos Desistir

Tela de Inclusão dos Detalhes para Antecipação

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato				
Quantidade a antecipar	Prêmio Unitário da Antecipação (R\$)	Valor Financeiro da Antecipação		
Liquidante	Modalidade	Data da antecipação	Pagador do Prêmio	Meu Número
Características de Contrato de Opção				
Código IF	Classe do Ativo Subjacente	Situação do contrato		
21H00004501	VCP	CONFIRMADO		
Partes do contrato				
Parte (Conta)	Parte (Nome simplificado)	CPF/CNPJ Cliente Parte	Posição da Parte	
05000.00-5	RIOBM		LANÇADOR	
Contraparte (Conta)	Contraparte (Nome simplificado)	CPF/CNPJ Cliente Contraparte		
05000.10-8	RIOBM	012.345.678-90		
Características				
Tipo de Opção	Data Registro	Data Início	Data Vencimento	Tipo de exercício
Call	30/08/2021	30/08/2021	30/08/2022	Europeia
Ativo Subjacente VCP	Tipo de Cotação VCP	Código do Ativo VCP na Fonte de Informação	Fonte de informação (Ativo VCP)	
AÇÕES	Fechamento		Bloomberg	
Quantidade	Strike (valor)	Strike (percentual)	Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?	
1.000.00000000	10.00000000		VALOR	
Moeda do Ativo VCP	Tipo de Cotação (Moeda do Ativo VCP)	Fonte de Informação (Moeda do Ativo VCP)	Data de fixing da moeda do ativo subjacente	
			Strike/Limitador/Barreiras em Reais	
Data de fixing do ativo subjacente	Cotação para opção quanto	Opção Quanto		
29/08/2022				
Quantidade Antecipada	Combinação de Operações	Código da estratégia	Valor base	Data Referência para valores em %
			10.000,00	
Cotação Inicial do Ativo (em reais) Informações Complementares				
Prêmio				
Prêmio Unitário	Modalidade de liquidação do prêmio	Data de Liquidação do Prêmio	Conta Liquidante do Prêmio	
0,70000000	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	30/08/2021		
Valor financeiro total do prêmio				
700,00				
Média Asiática				
Média Asiática	Quantidade de Datas de Verificação			
Intermediação				
Conta Intermediador	Comissão Paga pelo Titular em R\$	Comissão Paga pelo Lançador em R\$		
Limitador e Barreiras				
Limitador	Limitador (percentual)	Periodicidade de Verificação das Barreiras	Rebate Unitário	
Valor financeiro Total do Rebate	Barreira de KI	Barreira KI (percentual)	Direção Barreira de KI	
Tipo de cotação para verificação da barreira de KI	Situação Barreira KI	Data de Atingimento de KI	Barreira de KO	
Barreira KO (percentual)	Direção Barreira de KO	Tipo de cotação para verificação da barreira de KO	Situação Barreira KO	
Data de Atingimento de KO	Liquidação do Rebate de KO			
Provento				
Proteção contra Proventos				
Informações Adicionais				
Data da Última Correção	Data do Último Aditamento	Data da Última Antecipação		
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir				
Versão para Impressão				

Descrição dos campos da tela de inclusão de detalhes

Antecipação de Contrato			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Quantidade a antecipar	Quantidade a ser antecipada	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campo com 14 números inteiros e 8 decimais). Este campo não é exibido quando o contrato a ser antecipado possui média asiática ponderada.
Prêmio Unitário da Antecipação (R\$)	Valor unitário da antecipação.	Opcional	Tipo: Numérico (Campo com 10 números inteiros e 8 decimais). Se não for informado, será considerado que não há liquidação financeira para a antecipação.
Liquidante	Indica o participante que deve liquidar o prêmio da antecipação.	Opcional	Tipo: numérico com (5,2 e 1 números inteiros) Se não for preenchido, será considerado o Banco Liquidante principal do participante informado no campo "Pagador do Prêmio".
Modalidade	Indica qual a Modalidade se dará a Liquidação Financeira do valor da antecipação.	Condicional	Tipo: domínio com as opções: SEM MODALIDADE, BRUTA ou BILATERAL, onde: SEM MODALIDADE: Exclusivo para registro de operações com clientes. BRUTA ou BILATERAL: Exclusivo para registro de operações com mercado. Campo de preenchimento obrigatório, se informado o "Prêmio Unitário da Antecipação".

Antecipação de Contrato			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data da Antecipação	Indica a data da antecipação, que deve ser obrigatoriamente igual a data do lançamento no sistema.	Obrigatório	Formato: DD/MM/YYYY
Pagador do Prêmio	Indica quem será o pagador do valor da antecipação.	Condicional	Tipo: domínio com as opções: TITULAR e LANÇADOR Campo de preenchimento obrigatório, se informado o "Prêmio Unitário da Antecipação".
Meu número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: numérico com até 10 dígitos.

Dados Asiáticos – apenas para contratos com VCP

(Os campos abaixo são exibidos quando opção Asiática com média Aritmética ponderada)

Média Asiática - Informar Datas

Data de Fixing do Ativo Subjacente

18/08/2020

20/08/2020

Quantidade Remanescente

10.000,00000000

2.000,00000000

Quantidade Antecipada

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data de Fixing do Ativo Subjacente	Campo informativo com a data de fixing do ativo subjacente informada no registro.	-	-
Quantidade Remanescente	Campo informativo com a quantidade de referência remanescente para cada data de fixing informada.	-	-
Quantidade Antecipada	Quantidade a ser antecipada.	Condicional	Tipo: numérico com 14 inteiros e 8 casas decimais. Campo apresentado para cada data de verificação do contrato com média asiática.

Dados Asiáticos – apenas para contratos com VCP

(Os campos abaixo são exibidos quando opção Asiática com média Aritmética ponderada)

Média Asiática - Informar Datas

Data de Fixing do Ativo Subjacente	Quantidade Remanescente	Quantidade Antecipada
18/08/2020	10.000,00000000	,
20/08/2020	2.000,00000000	,

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			A soma das quantidades deve ser igual ao campo "Quantidade a antecipar" informada anteriormente.

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, calculado com base no Prêmio Unitário da Antecipação x Quantidade Antecipada**.

Em caso de confirmação, é enviada mensagem com o número da operação de antecipação e direciona para liquidação financeira, quando for o caso.

5. ATUALIZAÇÃO DE OPÇÃO - VCP

Função permite a atualização do contrato de Opções em determinadas situações:

- 1) Contrato VCP;
- 2) Contratos com Prêmio Agendado para data posterior ao atingimento do KO, quando o tipo de rebate é igual NO ATO.

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu Opções Flexíveis > Lançamentos > Atualização de Opções Arquivo: Não disponível Mensageria: Não disponível	Quando a operação envolve 2 Participante a Atualização de PU é efetuada por duplo comando. Quando operação efetuada com conta cliente do tipo 1 ou 2 do Participante, a Atualização de PU é feita por simples comando.
PRAZO: D+1 do início até o vencimento (inclusive).	

Tela de Filtro

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Atualização de Opções

Atualização de Opções

Código IF

Tipo Atualização Atualização de PU ▼

Descrição dos campos da Tela de Filtro de Atualização de Opções

Atualização de Opção			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Código IF	Campo para informar o código do contrato.	Obrigatório	Tipo: Alfanumérico (Campo com 11 caracteres).
Tipo de Atualização	Indica o tipo de atualização a ser realizada no contrato.	Obrigatório	Tipo: Campo tipo domínio com as opções: “ Atualização de PU ” e “ Antecipação de Prêmio ”

Para tipo de Atualização = Atualização de PU.

Tela exemplo – Atualização de Opções

Opções Flexíveis > Lançamentos > Atualização de Opções

Atualização de Opções

Dados do Registro

Parte (Conta)	Contraparte (Conta)
10020.00-1	10020.10-4
Parte (Nome simplificado)	Contraparte (Nome simplificado)
LEMEBM	LEMEBM
CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
	987.654.321-00
Posição da Parte	Código IF
TITULAR	21B00003725
Ativo Subjacente VCP	Tipo de Cotação VCP
TESTE Marcos OPC1	Fechamento
Meu Número	Data PU
Valor do PU	Motivo
Data Vencimento	
15/12/2021	

Descrição dos campos da Tela de Atualização de Opções

Dados do Registro			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: numérico com até 10 dígitos.
Data PU	Indica a data de atualização do PU.	Obrigatório	Formato: DD/MM/AAAA Deve ser posterior a data de início, anterior ou igual a data de vencimento e não deve ser final de semana
Meu número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: numérico com até 10 dígitos.
Valor do PU	Valor do PU do contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campo com 10 números inteiros e 8 decimais).
Motivo	Indica o tipo de atualização de PU a ser realizada.	Obrigatório	Tipo: domínio com as opções: MENSAL e VENCIMENTO onde: MENSAL : Deve ser indicada para realizar as atualizações de PU obrigatórias no último dia útil do mês ou lançamentos diários de PU.

Dados do Registro			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			VENCIMENTO: Deve ser indicada para realizar a atualização de PU no vencimento do contrato, para geração do valor da liquidação financeira.

Ao clicar em “Enviar” será levada para uma tela de confirmação, ver abaixo

Tela de exemplo de Confirmação – Atualização de Opções

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Atualização de Opções

Atualização de Opções

Dados do Registro

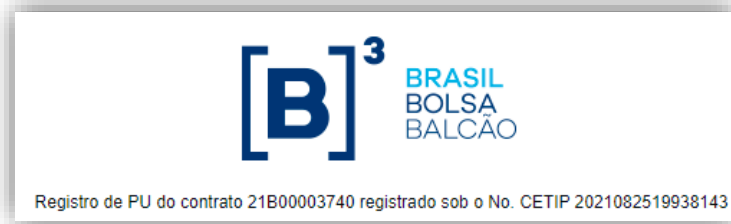
Parte (Conta)	Contraparte (Conta)
10020.00-1	10020.10-4
Parte (Nome simplificado)	Contraparte (Nome simplificado)
LEMEBM	LEMEBM
CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
	987.654.321-00
Posição da Parte	Código IF
TITULAR	21B00003725
Ativo Subjacente VCP	Tipo de Cotação VCP
TESTE Marcos OPC1	Fechamento
Meu Número	Data PU
7368	18/08/2021
Valor do PU	Motivo
132,00000000	VENCIMENTO
Data Vencimento	Valor Financeiro de Liquidação
15/12/2021	1.584.000,00
Situação do contrato	
EXERCIDO	

Essa tela apresenta as características do contrato mostradas anteriormente.

Quando o campo **Motivo** for = VENCIMENTO o sistema apresentará adicionalmente:

- **Valor Financeiro da Liquidação:** calculado com base no PU de vencimento informado x Quantidade Remanescente do contrato)
- **Situação do Contrato:** é alterada de acordo com o lançamento efetuado do PU de vencimento informado. Caso haja financeiro, o contrato passa para a situação EXERCIDO. Caso não haja financeiro, o contrato passa para a situação NÃO EXERCÍDO.

Ao ser confirmado o lançamento o sistema irá apresentar o lançamento com o N° da Operação.



Para tipo de Atualização = Antecipação de Prêmio.

Tela de exemplo– Antecipação de Prêmio

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Atualização de Opções

Atualização de Opções

Código IF

Tipo Atualização

Confirmar

Limpar Campos

Desistir

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Atualização de Opções

Antecipação de Prêmio

Código IF 25B00010597

Valor Financeiro Total do Prêmio

 ,

Modalidade de liquidação do prêmio

Data de Liquidação do Prêmio

13/02/2025

Conta Liquidante do Prêmio

 - -

Confirmar

Corrigir

Voltar

Desistir

Descrição dos campos da Tela de Antecipação de Prêmio

Dados do Registro			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Valor Financeiro Total do Prêmio	Indica o valor financeiro que será liquidado no dia. Este valor é definido pelas partes e refere-se ao Prêmio da Opção que estava agendado para data futura	Obrigatório	Campo numérico, com 10 inteiros e 02 decimais. Admite valor maior ou igual a 0 (zero).
Modalidade de Liquidação do Prêmio	Indica a modalidade de liquidação do Valor Financeiro Total do Prêmio	Condicional	Combobox com as opções: BILATERAL, BRUTA e SEM MODALIDADE. Obrigatoriedade da indicação "SEM MODALIDADE" caso o Valor Financeiro Total de Prêmio seja 0 (zero)
Data de liquidação do Prêmio	Indica a data em que o Prêmio será antecipado.	Autopreenchido	-
Conta Liquidante do Prêmio	Indica a conta 00 da instituição que fará a liquidação da antecipação do prêmio da opção	Opcional	Caso não seja preenchido o será considerada a Conta Liquidante do Prêmio default

Essa modalidade de atualização estará disponível apenas quando as seguintes condições forem atendidas:

- Contrato com Rebate "NO ATO" no momento que atingiu a barreira de Rebate (no dia seguinte que é gerada a operação de Rebate);
- Contrato com pagamento de Prêmio posterior ao da liquidação do Rebate.

6. CANCELAMENTO DE OPERAÇÕES

Esta função permite efetuar o cancelamento de operações registradas no NoMe.

FORMAS DE LANÇAMENTO	OBSERVAÇÃO
Tela: Menu Opções Flexíveis > Lançamentos > Atualização de Opções	Regras gerais: • Quando a operação estiver com status Finalizado, o cancelamento não é permitido; • Considerar o horário das modalidades de liquidação; • As operações sem modalidade financeira podem ser canceladas.
Arquivo: Não disponível	
Mensageria: Não disponível	
PRAZO: Até D-5 do vencimento	

Tela de Cancelamento de Operações

Operações > Lançamentos > Cancelamento de Operação

Cancelamento de Operações

Dados da Operação de Cancelamento

Dados da Operação Original

Participante

Meu número

Num. Cetip Op. Original

Instrumento Financeiro

Contraparte

Enviar

Limpar Campos

Desistir

Descrição dos campos da Tela de Cancelamento de Operações

Dados do Registro			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Participante	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Meu número	Número interno de identificação do lançamento.	Obrigatório	Tipo: numérico com até 10 dígitos.
Num. Cetip Op. Original	Número interno de identificação do lançamento que deve ser cancelada.	Obrigatório	Este número pode ser obtido no item Operações – consulta Operações no campo Num Ctrl Operação.
Instrumento Financeiro	Código do ativo da operação.	Obrigatório	Tipo: numérico com até 10 dígitos. Tipo: Alfanumérico sendo, Os cinco primeiros dígitos = Mnemônico do participante Lançador do novo contrato; 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)
Contraparte	Código da conta do outro membro envolvido na operação.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)

Tela de confirmação de Cancelamento de Operações

Cancelamento de Operações	
Dados da Operação de Cancelamento	
Participante 05000.00-5	RIOBM
Ponta na operação a cancelar TITULAR	
Meu número 908	Num. Cetip Op. Original 2024011017931851
Dados da Operação Original	
Tipo de operação à cancelar REGISTRO	
Estado da operação à cancelar FINALIZADA	
Tipo IF OPC	
Código IF 24A00006725	
Data Emissão 10/01/2024	Prazo em dias úteis 15
Data Vencimento 31/01/2024	Prazo em dias corridos 21
Código Contraparte 05000.10-8	RIOBM
Confirmar Corrigir Desistir	

Após a confirmação o sistema irá gerar o número de confirmação do lançamento.



Lançamento 2024011017931852 efetuado

7. CONSULTA DE CARACTERÍSTICAS DE CONTRATO

Esta função permite a consulta das características dos contratos de Opções.

É necessário que ao menos um dos campos da tela de filtro seja preenchido para efetuar a consulta.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos

Arquivo: DEPOSICAO.OPC

Mensageria: Não disponível

Tela de Filtro

> Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos

Características de contrato	
Tipo de Opção	
Classe do Ativo Subjacente	
Classe do ativo subjacente VCP	
Código IF	
Filtro do Ativo Subjacente	
>>	
Ativo Subjacente	
Ativo Subjacente VCP	
Moeda do Ativo / Moeda Cotada	
Moeda do Ativo VCP	
Lançador (Nome Simplificado)	
Lançador (Conta)	
Titular (Nome Simplificado)	
Titular (Conta)	
Data de registro	
Data de Início	
Data de Vencimento	
Situação do Contrato	
Tipo de Exercício	
Limitador	
Barreiras	
Média Asiática	
Combinação de Operações	
Proteção contra Proventos	
Tipo de Mercadoria	
Data Referência para valores em %	
Pesquisar Limpar Campos Desistir	

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

Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos

Consulta de Contrato

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)

Data e Hora da Consulta: 09/06/2021 - 16:38:14

1 Critério de pesquisa

Código IF	Tipo de Opção	Combinação de operações	Posição da Parte	Parte (Conta)	Parte (Nome simplificado)	CPF/CNPJ Cliente Parte	Contraparte (Conta)	Contraparte (Nome simplificado)	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Data Registro	Data Início	Data Vencimento	Classe do ativo subjacente	Classe do Ativo VCP
21F00000532	CALL		TITULAR	05000.00-5	RIOBM		05000.10-8	RIOBM	012.345.678-90	09/06/2021	09/06/2021	09/06/2022	VCP	COMMODITIES
21F00000532	CALL		LANÇADOR	05000.10-8	RIOBM	012.345.678-90	05000.00-5	RIOBM		09/06/2021	09/06/2021	09/06/2022	VCP	COMMODITIES

(continua)

Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos

Tipo de Mercadoria	Opção quanto	Cotação para opção quanto	Ativo subjacente / Moeda base	Moeda do ativo / Moeda cotada	Quantidade	Quantidade Antecipada	Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?	Strike (percentual)	Strike (valor)	Valor base	Tipo de Exercício	Situação do contrato	Data Referência para valores em %	Data de fixing do ativo subjacente
	NÃO				1.000.00000000		VALOR		100.00000000	100.000.00	Americana	CONFIRMADO		
	NÃO				1.000.00000000		VALOR		100.00000000	100.000.00	Americana	CONFIRMADO		

(continua)

Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos

Tipo de cotação	Data de fixing da moeda do ativo subjacente	Strike/Limitador/Barreiras em Reais	Limitador	Limitador (percentual)	Periodicidade de Verificação das Barreiras	Rebate Unitário	Barreira de KI	Direção Barreira de KI	Barreira KI (percentual)	Tipo de Cotação p/ Verificação de Barreira de KI	Barreira de KO	Direção Barreira de KO	Barreira KO (percentual)	Tipo de Cotação p/ Verificação de Barreira de KO	Liquidação do Rebate de KO
	NÃO														
	NÃO														

(continua)

Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos

Situação Barreira KI	Situação Barreira KO	Opções Digitais	Média Asiática	Quantidade de datas de verificação	Ativo Subjacente VCP	Tipo de Cotação VCP	Fonte de informação (Ativo VCP)	Código do Ativo VCP na Fonte de Informação	Moeda do Ativo VCP	Tipo de Cotação (Moeda do Ativo VCP)	Fonte de Informação (Moeda do Ativo VCP)	Conta Intermediador	Comissão Paga pelo Titular em R\$	Comissão Paga pelo Lançador em R\$
			Aritmética Ponderada - Informar Datas	3,0000000000	TESTE HOMOLOGAÇÃO PRI		B3							
			Aritmética Ponderada - Informar Datas	3,0000000000	TESTE HOMOLOGAÇÃO PRI		B3							

(continua)

Modalidade de liquidação do prêmio	Conta Liquidante do Prêmio	Prêmio Unitário	Valor financeiro total do prêmio	Valor financeiro Total do Rebate	Data de Liquidação do Prêmio	Data da Última Correção	Data do Último Aditamento	Data da Última Antecipação	DRRC - Agente de Cálculo Parte	DRRC - Agente de Cálculo ContraParte	Responsável pela Aceleração - Parte	Responsável pela Aceleração - Contraparte	Proteção contra Proventos	Informações Complementares	Código da estratégia	Cotação Inicial do Ativo (em reais)
Bilateral		19.000.00000000	19.000,00		02/02/2022								NAO			

(fim)

Tela de Detalhes do Contrato com VCP

Características de contrato de Opção			
Código IF 21F00000532	Classe do Ativo Subjacente VCP	Classe do Ativo VCP COMMODITIES	Situação do contrato CONFIRMADO
Partes do contrato			
Parte (Conta) 05000.10-8	Parte (Nome simplificado) RIOBM	CPF/CNPJ Cliente Parte 012.345.678-90	Posição da Parte LANÇADOR
Contraparte (Conta) 05000.00-5	Contraparte (Nome simplificado) RIOBM	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	
Características			
Tipo de Opção Call	Data Registro 09/06/2021	Data Início 09/06/2021	Data Vencimento 09/06/2022
Ativo Subjacente VCP SOJA TIPO 2	Tipo de Cotação VCP	Código do Ativo VCP na Fonte de Informação B3	Fonte de informação (Ativo VCP) VALOR
Quantidade 1.000.00000000	Strike (valor) 100,00000000	Strike (percentual)	Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?
Moeda do Ativo VCP	Tipo de Cotação (Moeda do Ativo VCP)	Fonte de Informação (Moeda do Ativo VCP)	Data de fixing da moeda do ativo subjacente
Data de fixing do ativo subjacente	Cotação para opção quanto	Opção Quanto	Strike/Limitador/Barreiras em Reais
Quantidade Antecipada	Combinação de Operações	Valor base 100.000,00	Data Referência para valores em %
Cotação Inicial do Ativo (em reais) 18,30000000	Informações Complementares		
Prêmio			
Prêmio Unitário 3,00000000	Modalidade de liquidação do prêmio SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	Data de Liquidação do Prêmio 11/04/2022	Conta Liquidante do Prêmio
Valor financeiro total do prêmio 3.000,00			
Média Asiática			
Média Asiática Aritmética Ponderada - Informar Datas	Quantidade de Datas de Verificação 3		
Intermediação			
Conta Intermediador	Comissão Paga pelo Titular em R\$	Comissão Paga pelo Lançador em R\$	
Limitador e Barreiras			
Limitador	Limitador (percentual)	Periodicidade de Verificação das Barreiras	Rebate Unitário
Valor financeiro Total do Rebate	Barreira de KI	Barreira KI (percentual)	Direção Barreira de KI
Tipo de cotação para verificação da barreira de KI	Situação Barreira KI	Barreira de KO	Barreira KO (percentual)
Direção Barreira de KO	Tipo de cotação para verificação da barreira de KO	Situação Barreira KO	Liquidação do Rebate de KO
Provento			
Proteção contra Proventos			
Informações Adicionais			
Data da Última Correção	Data do Último Aditamento	Data da Última Antecipação	
Média Asiática - Informar Datas			
Data de Fixing do Ativo Subjacente	Data de Fixing da Moeda do Ativo Subjacente	Quantidade de referência	Pesos (%)
07/07/2021		100,00000000	10,00000000
14/07/2021		200,00000000	20,00000000
21/07/2021		700,00000000	70,00000000

[Voltar](#)
[Sair](#)

[Versão para Impressão](#)

Quadro de situações possíveis

Observação: Os contratos de opções flexíveis podem apresentar as Datas: da última Correção, do último Aditamento e da última Antecipação, se houver.

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.
EXERCIDO	Situação do contrato na data de vencimento da opção, quando o valor financeiro lançado representa o exercício (Valor Financeiro do Exercício for diferente de "0" (zero)) da opção pelo titular.
NÃO EXERCIDO	Situação do contrato na data de vencimento da opção, quando o valor financeiro lançado representa o não exercício (Valor Financeiro do Exercício for igual a "0" (zero)) da opção pelo titular.
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.

8. CONSULTA DE ERROS

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.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Transf.de Arquivo > Arquivo > Erros em Arquivos

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

Tela de Filtro

> Transf.de Arquivo > Arquivo > Erros em Arquivos

Erros em Arquivos

Nome do Arquivo:

ID da Solicitação:

Data da Solicitação: / /

Pesquisar

Limpar Campos

Tela de Resultados

> Transf.de Arquivo > Arquivo > Erros em Arquivos

Erros em Arquivos

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)

Data e Hora da Consulta: 25/08/2021 - 14:21:41



Critério de pesquisa

Número da Solicitação	Nome do Arquivo	Data da Solicitação	Num. Linha Erro	Descrição do Erro	Texto Linha Origem
2035438	OP 52 TESTE.TXT	25/08/2021	4	Campos inválidos[Campo 14 obrigatório.]	OPC 1005221E00270486 0105 2 <

<< 1 >> Exibir página

Obter no formato: Excel

9. LANÇAMENTOS PENDENTES

Permite consultar todos os lançamentos 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) e 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 na primeira coluna “Ação” onde quando acionada, leva as opções:

1. “CONFIRMAR” ou “DETALHAR” para a Contraparte do contrato.

2. “CANCELAR” ou “DETALHAR” para a Parte que lançou o contrato.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

Tela de Filtro

> Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes

Manutenção de Operações Pendentes

Parte (Conta)	
Contraparte (Conta)	
Tipo IF	
Código IF	
Cód Operação	
Tipo de Operação	
Modalidade	
Situação	
Meu número	
Num Ctrl Operação	
Data de Liquidação	

Tela de Resultados

> Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes

Manutenção de Operações Pendentes

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)
Data e Hora da Consulta: 25/08/2021 - 14:36:31



Ação	Parte (Conta)	Contraparte (Conta)	Tipo IF	Código IF	Quantidade	PU	Valor	Num Ctrl Operação	Meu número	Cód Operação	Tipo de Operação	Ponta na Operação
	10020.00-1	05000.00-5	OPC	21H00004161	1.000.00000000	1.00000000	0,00	2021082519938078		1	REGISTRO	LANCADOR

(Continua)

Situação	Modalidade	Rentabilidade/Indexador/Taxa Flutuante	% da Taxa Flutuante	Taxa de Juros/Spread	Taxa Prefixada (%)	Num. Cetip Op. Original	Data Emissão	Data Vencimento
PENDENTE DE LANÇAMENTO	LANCADOR	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO					25/08/2021	01/09/2021

Atualizar Voltar

(Fim)

10. CONSULTA DE LANÇAMENTOS

Permite consultar todos os lançamentos feitos no dia.

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.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Operações > Consultas > Operações

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

Tela de Filtro

> Operações > Consultas > Operações

Consulta de Operações

Participante (Nome Simplificado)

Participante (Conta)

Tipo de Conta Participante

Contraparte (Conta)

Tipo de Conta Contraparte

Tipo Operação

Eventos

Tipo de Título

Instr. Financeiro

Código IF Anterior

Sistema

Modalidade de Liquidação

Situação da Operação

Data de Liquidação 25 / 8 / 2021

Data de Origem 25 / 8 / 2021

Número Operação

Número de Controle Operação

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Tela de Resultados

Operações > Consultas > Operações

Consulta de Operações

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)
Data e Hora da Consulta: 25/08/2021 - 14:46:31

Critério de pesquisa

Participante (Nome Simpl.)	Conta	Liquidante	Cód.Operação	Tipo Operação	C/V	Tipo Compra/Venda	Título	Código IF Anterior	Tipo Título	Tipo de Regime	Eventos Cursados pela Cetip?	Data Emissão	Data Vencimento
LEMEBM	10020.00-1		1	REGISTRO	LANÇADOR	----	21H00004161		OPC	NÃO HABILITADO		25/08/2021	01/09/2021
RIOBM	05000.00-5		1	REGISTRO	TITULAR	----	21H00004161		OPC	NÃO HABILITADO		25/08/2021	01/09/2021

(Continua)

Quantidade	PU	Valor	Tx Colocação	Sistema	Modalidade Liquidação	Status	Número Operação	Número Associação	Data Liquidação	Data Origem	Instituicao Confirmadora(Conta)
1.000.000000000	1.000000000	0.00		CETIP21	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	FINALIZADA	773		25/08/2021	25/08/2021	
1.000.000000000	1.000000000	0.00		CETIP21	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	FINALIZADA	4367		25/08/2021	25/08/2021	

(Continua)

Instituicao Confirmadora(Papel)	Contraparte (Nome Simpl.)	Conta Contraparte	Data Compromisso	PU/Ida Compromisso	Número Operação Original	Data Operação Original	PU Op Original	Qtd Op Original	Liquidante Contraparte	ISPB Liq. Contraparte	Nu Op Msg	Num Ctrl Operação
	RIOBM	05000.00-5		0.000000000								#2021082519938078
	LEMEBM	10020.00-1		0.000000000								#2021082519938078

(Continua)

Número de Controle de Associação	Cód.Proc.	Data Inclusão	Data Última Atualização	Usuário	Horário	Programa de Emissão	Num Ctrl Operação Futura
	Ok	25/08/2021 14:36:05	25/08/2021 14:46:17	GOMES	25/08/2021 14:46:17		
	Ok	25/08/2021 14:36:05	25/08/2021 14:46:17	GOMES	25/08/2021 14:36:05		

(Fim)

11. INFORMAÇÕES ADICIONAIS

11.1. Como funcionam as curvas VCP:

O que são:

As curvas VCP disponíveis para uso nos módulos de Swap e Opções Flexíveis Sem CCP são curvas de indexadores não calculadas pelo sistema. Elas podem ser utilizadas nos seguintes casos:

1. indexadores que não estão disponíveis como curvas calculadas, ou
2. para os indexadores que já tenham curvas calculadas, o VCP poderá ser utilizado somente se o critério de apuração da curva pactuado entre as partes do contrato for diferente da metodologia da curva calculada (prevista no caderno de fórmulas e manuais de operação da B3).
3. para contratos com características que não estão habilitadas para os indexadores calculados (p.e. média asiática e barreiras de knock-in e knock-out).

Como funcionam as curvas VCP:

1. **No registro da operação:** As partes do contrato informam a descrição completa dos parâmetros utilizados para apuração da curva VCP, de modo a possibilitar que a B3, a qualquer tempo, verifique a consistência das metodologias adotadas e dos preços praticados.
2. **No vencimento do contrato (liquidação financeira):** As partes do contrato são responsáveis por informar no sistema o PU da curva VCP. Com esse lançamento, o sistema calculará o ajuste do contrato, conforme abaixo:.

Liquidação do Opções VCP:

$$\text{Valor do Exercício} = PU_{\text{informado}} \times \text{Quantidade Remanescente}$$

Regras de utilização:

Apesar de não serem calculadas e dependerem da atualização de PU pelas partes do contrato, as curvas VCP possuem regras de utilização, previstas abaixo:

1. O campo “**Informações Complementares**” deve ser utilizado exclusivamente para detalhar as informações sobre os parâmetros de atualização das curvas VCP solicitadas neste manual.
2. A indicação de uma curva VCP no registro do contrato significa, obrigatoriamente, que a atualização da curva toma por base exclusivamente este parâmetro, não existindo outra condição ou critério para a sua apuração.

11.2. VCP Informações adicionais obrigatórias

A utilização de curvas VCP implica aos Participantes a prestação de informações adicionais, que devem ser informadas no sistema obedecendo os seguintes prazos:

Informação	Curvas aplicáveis	Periodicidade	Prazo	Módulo/Função
Marcação a Mercado (MtM)	Todas as curvas VCP	Mensal	Do último dia útil do mês de referência até o 4º dia útil do mês subsequente	MID > Marcação a Mercado de IF ou Registro de Informações de Derivativos
Atualização de PU	Todas as curvas VCP	Mensal	No último dia útil do mês	Opções > Atualização de Opções > Tipo de Atualização: Atualização de PU

11.3. Curvas calculadas disponíveis e cadastro de novas curvas

As curvas VCP disponíveis para utilização nos módulos de Swap e Opções Flexíveis sem Contraparte Central Garantidora podem ser consultadas no arquivo público **AAAAMMDD_Ativos_Subjacentes**, disponível em:

- 1) <ftp://ftp.cetip.com.br/Public> ou:
- 2) Sistema NoMe > Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos

Solicitações para inclusão de novos indexadores como curvas VCP podem ser feitas através do e-mail op.derivativobalcao@b3.com.br

11.4. Curvas VCP disponíveis e cadastro de novas curvas

As curvas VCP disponíveis para utilização nos módulos de Swap e Opções Flexíveis sem Contraparte Central Garantidora podem ser consultadas no arquivo público **AAAAMMDD_Indexadores_Derivativos_VCP**, disponível em:

- 1) <ftp://ftp.cetip.com.br/Public> ou:
- 2) Sistema NoMe > Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos

Solicitações para inclusão de novos indexadores como curvas VCP podem ser feitas através do e-mail op.derivativobalcao@b3.com.br

11.5. Metodologia de cálculo de valores financeiros para liquidação

Consulte o **Caderno de Fórmulas: Opções Flexíveis Sem CCP - Ativos VCP e Calculados**, do item Documentação Técnica, no *site* da B3

http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/negociacao/caderno-de-formulas/

SUMÁRIO

REGISTRO

REGISTRO - VCP

ALTERAÇÃO

ANTECIPAÇÃO

ATUALIZAÇÃO DA OPÇÃO

CANCELAMENTO

CONSULTAS

+INFOS

ATUALIZAÇÃO DA VERSÃO

Opções Flexíveis Sem CCP

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
28/08/2025	03/10/2025	Lançamentos – Registro	Ajuste no campo “Strike/Limitador/Barreiras” no sentido de esclarecer que ao preencher SIM, será possível indicar datas para captura de moeda diferente das datas para captura do ativo subjacente no caso da “Média Aritmética Simples” e “Média Aritmética Ponderada”. Os requisitos para as datas de verificação da moeda devem atender os critérios informados ao longo do texto.
28/07/2025	27/08/2025	Lançamentos – (Não) Exercício de Contrato de Opção	Complemento de regra adicionado no sentido de informar que os contratos de opção americana antes do vencimento utilizarão a cotação do dia anterior para calcular o valor financeiro.
28/07/2025	22/08/2025	Lançamentos - Registro	Ajuste na descrição, tornando o campo “Data de fixing da moeda do ativo subjacente” de preenchimento obrigatório.
28/07/2025	28/07/2025	Lançamentos – Registro	Inclusão da tela de Média Asiática Ponderada para Commodities e Taxas de Câmbio (OPC), conforme divulgado no Comunicado 028/2025-VPC
30/06/2025	30/06/2025	Lançamentos – Registro	Inclusão da tela de Média Asiática para Commodities e Taxas de Câmbio (OPC), conforme divulgado no Comunicado 020/2025-VPC
26/05/2025	26/05/2025	Lançamentos – Registro	Inclusão do campo “Trigger – Proporção”, conforme divulgado nos Comunicados 007/2025-VPC, 009/2025-VPC, 010/2025-VPC e 012/2025-VPC.
14/04/2025	14/04/2025	Atualização de Opções	Inclusão do novo domínio “Antecipação de Prêmio” na funcionalidade Atualização de Opções, conforme divulgado no Comunicado Externo 006/2025-VPC.
14/04/2025	14/04/2025	Fixing – Ativo Subjacente	Possibilidade de realizar o registro de Contrato de Opções Flexíveis com Fixing em D0 para classe “Taxa de Câmbio” e “Índices Nacionais”, conforme divulgado no Comunicado Externo 006/2025-VPC.
10/03/2025	10/03/2025	Lançamentos – Registro	Disponibilização da classe “Índices Nacionais” para registro calculado de Opções Flexíveis sem CCP, conforme divulgado no Comunicado Externo 004/2025-VPC.
10/03/2025	10/03/2025	Lançamentos – Registro	Exclusão da menção referente ao registro em até D+2 da contratação do derivativo para Conta 00 x Conta 10 ou 20.
26/08/2024	30/01/2025	Lançamentos – Registro	Ajuste na regra do campo “Data de liquidação do Prêmio” ressaltando que se a data for informada, deverá ser dia útil maior ou igual à data de registro e menor ou igual à Data de Vencimento.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
26/08/2024	05/11/2024	Lançamentos – Alteração e Exclusão de Contratos	Inclusão de diversos campos na funcionalidade ref. a alteração de contratos.
26/08/2024	26/08/2024	Registro – Lançamento de Opções Flexíveis Sem CCP	Ajuste na descrição com a disponibilização da classe “Taxas de Câmbio” para registro calculado de Opções Flexíveis sem CCP adicionado às classes já existentes de “Ações”, “Ações Internacionais”, “Índices Internacionais”, “Commodities” e “VCP”, conforme divulgado no Comunicado Externo 024/2024-VPC.
24/06/2024	24/06/2024	Opções Flexíveis Sem CCP	Ajuste na descrição e regras relacionadas ao campo “Forma de Disparo”, no sentido de atribuir maior clareza.
22/04/2024	06/06/2024	Opções Flexíveis Sem CCP	Ajuste no campo “Tipo de Exercício” ressaltando a possibilidade da opção Americana que poderá ser utilizada a qualquer momento.
22/04/2024	22/04/2024	Opções Flexíveis Sem CCP	Disponibilização da classe “Ações Nacionais” para registro calculado de Opções Flexíveis sem CCP (novo módulo, tipo IF = OPC), conforme divulgado no Comunicado Externo 001/2024-VPC.
12/06/2023	19/03/2024	Opções Flexíveis Sem CCP	Novo documento unificando os manuais de operações “Opções Flexíveis Sem CCP – OPC” e “Opções Flexíveis sobre Paridade, Ações, Índices e Mercadoria”.

Opções Flexíveis 2.0 Sem CCP Ativos Calculados E VCP [Novo Módulo - OPC]

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
12/06/2023	12/06/2023	Barreiras de Knock In e Knock Out	Inclusão de Barreiras de Knock In e de Knock Out nas classes de ativos calculados, conforme divulgado no comunicado 017/2023-VPC.
24/04/2023	24/04/2023	Commodities	Inclusão de Classe de Ativos Subjacentes com payoff calculado, conforme divulgado no comunicado 002/2023-VPC.
24/04/2023	24/04/2023	Estratégia	Ajustes na descrição do campo “Código Estratégia”.
05/12/2022	15/02/2023	Exclusão da ação REAPROVEITAR	Exclusão da ação REAPROVEITAR na tela de registro de contrato.
05/12/2022	05/12/2022	Inclusão de Registro de Opções com Estratégia	Inclusão da possibilidade de Registro de Opção (OPC) com Estratégia, conforme divulgado no comunicado 084/2022-VPC.
10/10/2022	10/10/2022	Inclusão da funcionalidade de Alteração	Inclusão da funcionalidade de Alteração para contratos VCP e de Curvas Calculadas
08/08/2022	11/08/2022	Inclusão de Informações necessárias para registros VCP	Inclusão de “VCP de Moedas”

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
08/08/2022	08/08/2022	Registro com Valor Base	Possibilidade de registrar um contrato com Valor Base
06/06/2022	21/07/2022	Inclusão do item: OPÇÕES VCP COM DUPLO KNOCK OUT/IN	Opções com VCP com duplo Knock In ou duplo Knock Out
06/06/2022	06/06/2022	Inclusão de Classe de Ativos Subjacentes com payoff calculado	Ações Internacionais e Índices Internacionais
06/06/2022	06/06/2022	Inclusão de Informações necessárias para registros VCP	Inclusão de “VCP de Commodities” e “Opção VCP com Cesta”
14/03/2022	14/03/2022	Registro de Contrato	Atualização das observações sobre as Informações complementares.
18/10/2021	14/02/2022	VCP Índices internacionais	Atualização das observações tipo de cotação e informações necessárias sobre verificação de barreiras
18/10/2021	14/02/2022	VCP Índices Nacionais	Inclusão de Nova Seção
18/10/2021	14/02/2022	VCP Ações internacionais	Atualização das observações tipo de cotação e informações necessárias sobre verificação de barreiras
18/10/2021	14/02/2022	VCP Ações Nacionais	Atualização das observações tipo de cotação e informações necessárias sobre verificação de barreiras
18/10/2021	17/11/2021	Registro de Contrato	Inclusão de informações sobre valor base em reais do contrato, no campo “Informações Complementares”
18/10/2021	18/10/2021	Manual Novo	Versão inicial do Manual de Operações do módulo de Opções Flexíveis sem CCP que permite o registro de contratos utilizando a Curva VCP

Opções Flexíveis sobre Paridade, Ações, Índices e Mercadoria

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
05/12/2022	05/12/2022	Registro de Contrato e Alteração e Exclusão de Contrato	Atualização do campo “Data de Liquidação do Prêmio” indicando que é permitido prêmio no dia de vencimento para todas as classes de ativo.
05/12/2022	05/12/2022	Alteração e Exclusão de Contrato	Alteração e Exclusão de contratos de D0 até D+3 do registro, diretamente no sistema, tanto para contraparte Cliente quanto contraparte Mercado, conforme divulgado no comunicado 084/2022-VPC

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
10/10/2022	10/10/2022	Registro de Contrato	Ajustes para tornar o campo “Adesão a Contrato” opcional, permitir indicação das datas de média asiática em feriado, conforme divulgado no comunicado 067/2022-VPC
28/09/2021	16/03/2022	Registro de Mercadoria	Atualização referente a data de verificação asiática.
28/09/2021	16/03/2022	Registro Opção de Ações Nacionais	Atualização referente a data de verificação asiática.
28/09/2021	18/10/2021	Contratos de Opções Flexíveis	Atualização de termos obsoletos do manual em aderência aos OC 005-2021 PRE, OC 022-2021 PRE, OC 109-2020 PRE quando se aplicar.
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”.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
28/05/2018	28/05/2018	Lançamentos – Antecipação de Contrato	Alteração no comportamento das antecipações de derivativos com Redutor do Risco de Crédito, conforme divulgado no COMUNICADO EXTERNO 006/2018-VPC, 008/2018 – VPC e 012/2017 – DN.
11/09/2017	29/01/2018	Registro Opção de Índices Internacionais Registro Opção de Índice Registro Opção de Paridade Registro Opção de Ações Nacionais Registro de Mercadoria	Alteração de regra para combinação de Parte e Contraparte nos contratos.
11/09/2017	29/01/2018	Registro Opção de Índices Internacionais Registro Opção de Índice Registro Opção de Paridade Registro Opção de Ações Nacionais Registro de Mercadoria	Melhoria nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
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.

INFORMAÇÃO PÚBLICA – PUBLIC INFORMATION

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”.
23/11/2015	23/11/2015	Registro Opção de Paridade	Alteração da tela Registro Opção de Paridade - Feeder ou Spot (tela) e inclusão dos campos “Fonte de Informação e Cotação para o vencimento”, conforme comunicados 015/15, 042/15 e 087/15.
18/05/2015	27/08/2015	Registro de Mercadoria Registro Opção de Ações Nacionais Registro Opção de Paridade Registro Opção de Índice Registro Opção Índices Internacionais	Alteração na descrição do campo “Forma de Disparo”.
18/05/2015	21/07/2015	Registro Opção de Ações Nacionais e Índices	Melhoria na descrição do campo Valor Base/Quantidade.

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

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
02/06/2014	02/06/2014	Registro de Opção de Ações Nacionais, Registro de Ação de Índice e Índices Internacionais	Mudança na descrição do campo "Data de Liquidação do Prêmio". Conforme comunicado 061/14.
10/12/2012	24/02/2014	Ações Negociadas	Inclusão da ação BBTG11.
10/12/2012	04/11/2013	Registro de Mercadoria e Opção de Paridade	Mudança na descrição do campo "Data de Liquidação do Prêmio".
10/12/2012	07/08/2013	Informações Adicionais	Inclusão da linha índice internacional em Regras para Registro de Contrato de Ações/Índice/Mercadoria.
10/12/2012	21/02/2013	Campos com a descrição opcional.	Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
10/12/2012	14/02/2013	Registro/Exclusão	Mudança: Exclusão mercado x mercado será permitida apenas em D0.
10/12/2012	10/12/2012	Registro de Mercadoria	Inclusão do campo "Cotação para Moeda".
19/09/2012	10/05/2012	Ações Negociadas	Inclusão das ações negociadas
18/06/2012	25/09/2012	Campo: Data da Liquidação do Prêmio	Melhoria no texto.
18/06/2012	17/09/2012	Alteração de Contrato	Impossibilidade de alteração de CPF/CNPJ.
18/06/2012	18/06/2012	Registro de Opções	Registro de contrato referenciado em cotação de índices Internacionais e valor de cotas de ETFs internacionais
18/06/2012	18/06/2012	Registro de Opções	É possível o registro de contrato de opções onde o lançador e o titular podem ser uma conta cliente.
19/09/2011	07/05/2012	Registro de Ações	Melhorias no texto do campo "Data de Avaliação" do Registro de Contrato.