

LAYOUT EM IMPLEMENTAÇÃO

OPÇÕES COM CCP

CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÕES	3
2 ENVIAR ARQUIVOS	4
2.1 REGISTRO DE CONTRATO DE OPÇÃO CCP	4
2.2 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE OPÇÕES COM CCP	6
3 RECEBER ARQUIVOS	8
3.1 MOVBALCAO.....	8

1 ATUALIZAÇÕES

Atualizado em	Referência	Atualização
06/07/2023	Enviar e Receber Arquivos	Inclusão de campos em arquivos de Registro, Antecipação e no MOVBALCAO, conforme divulgado no comunicado externo.

Legendas:

➤ Campos novos

2 ENVIAR ARQUIVOS:

2.1 REGISTRO DE CONTRATO DE OPÇÃO CCP

Registro - Opção CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
Registro de Contrato de Opção CCP	450 Posições
Descrição: Este arquivo permite ao participante realizar o registro do contrato de opção flexível com CCP.	

Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	Sim	OCCP
02	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	Código da Operação	9(04)	7 - 10	Sim	Código identificador da operação de Registro – 0002
04	Entidade que gerou o Arquivo	X(20)	11 - 30	Sim	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
05	Data	9(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
06	Filler	X(10)	39-48	Sim	Reservado para futuras implementações

Registro

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	Sim	OCCP
02	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	Código da Operação	9(04)	7 - 10	Sim	0002
04	Meu número	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	Parte Registradora	9(08)	21 - 28	Sim	Código do registrador da parte
06	Parte	9(08)	29 - 36	Sim	Código da Instituição lançadora da operação
07	Código do PR	9(10)	37 - 46	Sim	Código do Participante Registrador da Parte da operação
08	Conta SINCAD Parte	9(10)	47 - 56	Sim	Conta no SINCAD da Parte
09	Taxa Operacional Parte	9(2)	57 - 58	Não	Domínio: Percentual=00 ; Valor=01
10	Valor - Taxa Operacional Parte	9(13)v9(4)	59 - 75	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
11	Posição do Participante	9(01)	76 - 76	Sim	Domínio: Posição do participante. 0 – Lançador; 1 – Titular
12	Conta Repasse Parte	9(08)	77 - 84	Não	Código da conta de Repasse da parte
13	Contraparte Registradora	9(08)	85 - 92	Sim	Código do registrador da contraparte.
14	Contraparte	9(8)	93 - 100	Comando simples - Sim Duplo Comando - Não	Código da contraparte na operação

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
15	Código do PR	9(10)	101 - 110	Sim	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação
16	Conta SINCAD Contraparte	9(10)	111 - 120	Comando simples - Sim	Conta no SINCAD da Contraparte
				Duplo Comando – Não	
17	Taxa Operacional Contraparte	9(2)	121 - 122	Não	Percentual=00 ; Valor=01
18	Valor - Taxa Operacional Contraparte	9(13)v9(4)	123 - 139	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
19	Conta Repasse Contraparte	9(08)	140 - 147	Não	Código da conta de Repasse da Contraparte
20	Data de Início	9(08)	148 - 155	Sim	Data de início da Opção. Deve ser dia útil Formato: AAAAMMDD
21	Data de Vencimento	9(08)	156 - 163	Sim	Data do vencimento da opção. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Formato: AAAAMMDD
22	Data de Liquidação	9(08)	164 - 171	Sim	Data de Liquidação da opção. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Deve ser obrigatoriamente D+1 da "Data de Vencimento". Formato: AAAAMMDD.
23	Quantidade	9(15)v9(2)	172 - 188	Sim	Quantidade base do contrato
24	Nº de Controle do PR	X(32)	189 - 220	Não	Número de Controle do PR
25	Tipo Contrato	X(06)	221 - 226	Sim	Domínio: COMPRA – Contrato de Opção de Call / VENDA – Contrato de Opção de Put
26	Variável	X(10)	227 - 236	Sim	Código de referência externa
27	Tipo de Indicador	9(02)	237 - 238	Sim	01 - ETF; 02 - ACOES; 03 - PARIDADE; 04 – INDICES; 05 – BDR
28	Preço Exercício	9(15),9(7)	239 - 260	Sim	Campo tipo numérico com 22 caracteres
29	Data de Liquidação do Exercício	9(01)	261 - 261	Sim	Domínio: 1 – "D+1"
30	Tipo Opção	9(02)	262 - 263	Sim	Domínio: 01- Européia
31	Tipo Preço	9(02)	264 - 265	Sim	Domínio: 01- Último; 02 – Médio
32	Nº Dias de Apuração	9(04)	266 - 269	Sim	Númerico
33	Data Fixing	9(01)	270 - 270	Sim	Domínio: 0 – "D0"; 1 – "D-1"; 2 - "D-2"
34	Boletim	9(02)	271 - 272	Sim	Domínio: 01 - PTAX Venda; 02 - Fechamento; 03 - Liquidação; 04 - 2005; 05 – 2009
35	Proteção contra Proventos	9(02)	273 - 274	Somente ação – Sim	Domínio: 01 – SIM
36	Limitador	9(15),9(7)	275 - 296	Não	Campo Numérico
37	Prêmio Unitário	9(15),9(7)	297 - 318	Sim	Campo Numérico
38	Data de Pagamento de Prêmio	9(08)	319 - 326	Sim	Campo tipo data AAAAMMDD

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
39	ID - Knock In and Down	9(15)v9(7)	327 - 348	Não	Valor da barreira ID
40	IU - Knock In and Up	9(15)v9(7)	349 - 370	Não	Valor da barreira IU
41	OD - Knock Out and Down	9(15)v9(7)	371 - 392	Não	Valor da barreira OD
42	OU - Knock Out and Up	9(15)v9(7)	393 - 414	Não	Valor da barreira OU
43	Tipo de Rebate	9(02)	415 - 416	Não	Domínio: 01 – “Valor” 02 – “Percentual”
44	Monitoramento de Barreira	X(01)	417 - 417	Não	C – Contínuo; D – Discreto
45	Rebate Unitário	9(15)v9(7)	418 - 439	Não	Valor do Rebate
46	Data de Liquidação do Rebate	9(02)	440 - 441	Não	Domínio: 01- D+1
47	Trade	9(09)	442 - 450	Sim	Campo usado para usuário B3. Participante preencher com “ ” (espaço)
48	Código Confirmação Lançamento Pendente	X(15)	451-465	Não	Código de controle atribuído pelo participante
49	Parâmetros em %	X(1)	466-466	Sim	" " – Vazio; S – SIM

(fim)

2.2 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE OPÇÕES COM CCP

Antecipação - Opções com CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
Antecipação de Contrato de Opções com CCP	127 Posições
Descrição: Arquivo a ser utilizado para registro de operação de antecipação de contratos de Opções com CCP.	

Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	Id do sistema	X(05)	1 - 5	Sim	OPCCP
02	Id tipo linha	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	Código operação	9(04)	7 - 10	Sim	Código da operação: 0036 - Antecipação
04	Participante	X(20)	11 - 30	Sim	Nome Simplificado ou conta própria CCP do Participante de Registro
05	Data	9(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
06	Filler	X(10)	39-48	Sim	Reservado para futuras implementações

Registro – Dados Iniciais

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	Id do sistema	X(5)	1 - 5	Sim	OPCCP
02	Id tipo linha	X(1)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
03	Código operação	X(4)	7 - 10	Sim	0036
04	Meu Número	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	Titular	9(08)	21 - 28	Não	Código da Conta do Titular
06	Lançador	9(08)	29 - 36	Não	Código da Conta do Lançador
07	Contrato	X (9)	37 - 45	Sim	Código do Contrato.
08	Valor a Antecipar	9(17)V9(02)	46 - 64	Sim, caso queira preencher Valor.	Valor base a Antecipar. Formato IIIIIIIIIIIIDD 17 inteiros e 2 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto) Deve ser utilizado o campo "Valor a antecipar" OU "Percentual a antecipar" para o lançamento da antecipação. Para contratos a mercado, é necessário que ambas as partes lancem como "Valor" ou "Percentual" para que ocorra o <i>matching</i> da operação.
09	Percentual a Antecipar	9(04)V9(06)	65 - 74	Sim, caso queira preencher %	Percentual do Valor base a Antecipar. Formato IIIIDDDDDD 4 inteiros e 6 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto) Deve ser utilizado o campo "Valor a antecipar" OU "Percentual a antecipar" para o lançamento da antecipação. Para contratos a mercado, é necessário que ambas as partes lancem como "Valor" ou "Percentual" para que ocorra o <i>matching</i> da operação.
10	Taxa Operacional Parte	9(2)	75 - 76	Não	Percentual=00 ; Valor=01; vazio=02
11	Valor - Taxa Operacional	9(17)v9(4)	77 - 97	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
12	Data da antecipação	X(8)	98 - 105	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
13	Prêmio Unitário	9(15)V9(07)	106 - 127	Sim	Valor Financeiro da operação. Formato IIIIIIIIIIIIDD 15 inteiros e 7 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)
14	Data Liquidação Antecipação	9(8)	128-135	Sim	Data de Liquidação da Antecipação, tipo AAAAMMDD

Footer

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	Sim	OPCCP
02	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Footer = 9
03	Quantidade de Registros	9(10)	7 - 16	Sim	
04	Filler			Sim	Reservado para futuras implementações

(fim)

3 RECEBER ARQUIVOS:

3.1 MOVBALCAO

Arquivo de conciliação de movimentação - Movbalcão							
Nome do Arquivo							
Movimentação de Derivativos MovBalcão							
Descrição: Esse arquivo possibilita a conciliação da movimentação de Derivativos com CCP. Este arquivo é gerado somente quando ocorre operação de Anulação de Antecipação, Anulação de Registro, Exclusão, Antecipação, ou Transferência.							

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
Seq	Arquivo TXT POSICIONAL - MovBalcão	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
01	Tipo de registro	N	1		1	1	1 - Exclusão de Posição (Transferência Origem - com todos os dados de negócio) 2 - Recebimento de Posição (Transferência: Destino - com todos os dados de negócio) 7 - Atualização de Eventos Corporativos (Ações - Importação de novo Registro com todos os dados de negócios)
02	Membro de Compensação	N	6		2	7	
03	Código da Corretora	N	6		8	13	
04	Código do cliente	N	9		14	22	
05	Número do contrato	N	9		23	31	
06	Código do contrato	A	5		32	36	
07	Tipo do contrato	A	1		37	37	1 - SWAP 2 - OPÇÃO COMPRA 3 - OPÇÃO VENDA 4 - TERMO
08	Data da operação	N	8		38	45	AAAAMMDD
09	Data-base	N	8		46	53	AAAAMMDD
10	Data de vencimento	N	8		54	61	AAAAMMDD
11	Código da variável	A	15		62	76	
12	Código opção da variável	A	2		77	78	

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
13	Código do período da variável	A	4		79	82	
14	Tamanho-base	N	17	2	83	99	
15	Tamanho-base atualizado	N	17	2	100	116	
16	Fator de atualização	A	22		117	138	
17	Fator de atual. - índice	A	22		139	160	
18	Fator de atual. - juros	A	22		161	182	
19	Valor de liquidação	N	17	2	183	199	
20	Sinal do valor de liquidação	A	1		200	200	
21	Prêmio (*)	N	22		201	222	
22	Preço de exercício	N	22	7	223	244	
23	Código da operação	A	6		245	250	
24	Sinal dos juros	A	1		251	251	+ / -
25	Juros	N	13	7	252	264	
26	Percentual da taxa da variável	N	11	7	265	275	
27	Período da taxa da variável	A	1		276	276	
28	Indicador de garantia	A	1		277	277	S (sem) C (com)
29	Tipo da operação	A	1		278	278	C (compra) V (venda)
30	Tipo da Taxa Operacional	A	1		279	279	P (percentual) V (valor)
31	Valor da Taxa Operacional	N	17	4	280	296	
32	Data de pagamento do prêmio	N	8		297	304	AAAAMMDD
33	Tipo da opção	A	1		305	305	A (americana) E (européia)

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
34	Limite da variação inferior	N	13	7	306	318	
35	Limite da variação superior	N	13	7	319	331	
36	Número do negócio em pregão	N	7		332	338	
37	Liquidação de exercício	A	1		339	339	S (liquid. D+0) N (liquid. D+1)
38	Tipo de exercício	A	1		340	340	A (autom.)/S (solicit.comprador)
39	Tamanho-base atualizado du	N	17	2	341	357	
40	Fator de atualização du (dias úteis)	A	22		358	379	
41	Fator de atual. - índice du (dias úteis)	A	22		380	401	
42	Fator de atual. - juros du (dias úteis)	A	22		402	423	
43	Valor de liquidação du (dias úteis)	N	17	2	424	440	
44	Sinal do valor de liquidação du (dias úteis)	A	1		441	441	
45	Tipo de rebate	A	1		442	442	V (valor)/P (percentual)
46	Valor do rebate (*)	N	22	7	443	464	
47	Rebate em D+0	A	1		465	465	S (D+0)/N (D+1)
48	Sinal da cotação da variável	A	1		466	466	+ / -
49	Cotação da variável	N	3		467	469	0 / 1
50	Tipo da liquidação progr.	A	1		470	470	1, 2, 3 ou 4
51	Percentual do limite de liquidação programada 4	N	10	7	471	480	
52	Variável de desistência	A	5		481	485	

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
53	Data início da valorização	N	8		486	493	AAAAMMDD
54	Data fim da valorização	N	8		494	501	AAAAMMDD
55	Numero do broker	N	9		502	510	
56	Data do broker	N	8		511	518	AAAAMMDD
57	Valor da cotação	N	13	7	519	531	
58	Dados da contraparte						
59	Sinal da cotação da variável	A	1		532	532	+ / -
60	Cotação da variável	N	3		533	535	0 / 1
61	Código da Corretora	N	6		536	541	
62	Código da variável	A	5		542	556	
63	Código opção da variável	A	2		557	558	Tabela 2.
64	Código do período da variável	A	4		559	562	
65	Indicador de garantia	A	1		563	563	S (sem) C (com)
66	Sinal dos juros	A	1		564	564	+ / -
67	Juros	N	13	7	565	577	
68	Percentual da taxa da variável	N	11	7	578	588	
69	Período da taxa da variável	A	1		589	589	
70	Limite da variação inferior	N	13	7	590	602	
71	Limite da variação superior	N	13	7	603	615	
72	Nome do cliente contraparte	A	60		616	675	
73	Data início da valorização	N	8		676	683	AAAAMMDD Data Início Contrato

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
74	Data fim da valorização	N	8		684	691	AAAAMMDD Data Vencimento
75	Tamanho-base atualizado cp	N	17	2	692	708	
76	Fator de atualização cp	A	22		709	730	
77	Fator de atual. - índice cp	A	22		731	752	
78	Fator de atual. - juros cp	A	22		753	774	
79	Valor de liquidação cp	N	17	2	775	791	
80	Sinal do valor de liquidação cp	A	1		792	792	
81	Valor-base atual du cp (dias úteis)	N	17	2	793	809	
82	Fator de atualização du cp (dias úteis)	A	22		810	831	
83	Fator de atual. - índice du cp (dias úteis)	A	22		832	853	
84	Fator de atual. - juros du cp (dias úteis)	A	22		854	875	
85	Valor de liquidação du cp (dias úteis)	N	17	2	876	892	
86	Sinal do valor de liquidação du cp (dias úteis)	A	1		893	893	+ / -
87	Valor da cotação cp	N	13	7	894	906	
88	Dados complementares						
89	Tipo de preço de exercício de liquidação	A	1		907	907	
90	Numero de dias de apuração de preço	N	7		908	914	
91	Indicador de bloqueio de exercício	A	1		915	915	S (exercício bloqueado)

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
Registro Tipo 03 - Dados da Barreira							
Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
92	Tipo de Registro	N	1		1	1	3 - Dados da Barreira
93	Número do Contrato	N	9		2	10	
94	Código da Barreira	A	5		11	15	
95	Preço da Barreira	N	22	7	16	37	
Registro Tipo 04 - Liquidação Antecipada							
Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
96	Tipo de Registro	N	1		1	1	4 - Liquidação Antecipada
97	Número do Contrato	N	9		2	10	
98	Código da Corretora	N	6		11	16	
99	Código do cliente Parte	N	9		17	25	
100	Tamanho-base	N	17	2	26	42	
101	Tamanho-base de Liquidação	N	17	2	43	59	
102	Prêmio Unitário de Liquidação	N	22		60	81	
103	Tipo da Tx Operacional de Liq. Antecipada	A	1		82	82	P (percentual)/V (valor)
104	Valor da Tx Operacional de Liq. Antecipada	N	17		83	99	4 decimais para Percentual e 2 decimais para valor
105	Numero do broker	N	9		100	108	
106	Sinal do valor de liquidação	A	1		109	109	+ ou -
107	Valor de Liquidação Finceira	N	17	2	110	126	
108	Data de Operação	N	8		127	134	AAAAMMDD

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
109	Data Liquidação Antecipação	N	8		135	142	AAAAMMDD
Registro Tipo 05 - Anulação de Registro/ Anulação de Liq. Antecipada (D+0)							
Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
111	Tipo de Registro	N	1		1	1	5 - anulação (intradiária)
112	Número do Contrato	N	9		2	10	
113	Justificativa	A	100		11	110	Justificativa informada pelo Participante.
Registro Tipo 06 - Cancelamento (D+n)							
Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
114	Tipo de Registro	N	1		1	1	6 - anulação (intradiária)
115	Número do Contrato	N	9		2	10	
116	Justificativa	A	100		11	110	Justificativa informada pelo Participante.

(fim)