# MANUAL DE OPERAÇÕES - DERIVATIVOS COM CCP

Versão: 4.3
Atualização: 26/05/2025

## CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÕES DA VERSÃO ..... 3
2 INTRODUÇÃO ..... 4
2.1 Ações dos botões das telas ..... 5
3 LANÇAMENTOS ..... 6
3.1 Cadastro ..... 6
3.2 Registro de Contrato de SWAP ..... 7
3.3 Registro de Contrato de Termo de Moedas ..... 12
3.4 Registro de Contrato de Opções ..... 15
3.5 Antecipação ..... 21
3.6 Anulação de Registro ..... 28
3.7 Cancelamento de Antecipação ..... 29
3.8 Exclusão de Contrato ..... 30
3.9 Transferência de Conta e Posição ..... 32
3.10 Cessão de Direito ..... 36
3.11 Brokeragem ..... 40
3.12 Registro e operações por arquivo ..... 44
4 CONSULTA ..... 46
4.1 Características de Contratos de Swap ..... 46
4.2 Características de Contratos de Opção ..... 49
4.3 Características de Contratos de Termo com CCP ..... 54
4.4 Manutenção de Operações Pendentes ..... 55
4.5 Consulta lançamentos de Opção Flexível com CCP ..... 56
4.6 Consultas e relatórios ..... 59
4.7 Consulta de Operações ..... 62
4.8 Consulta de Arquivos e Relatórios ..... 64
4.9 Consulta – Histórico de Ajuste de Proventos de Ações e BDRs com CCP ..... 66
5 VARIÁVEIS ACEITA POR TIPO DE CONTRATO. ..... 67
5.1 Tabela Auxiliares – Swap, Termo e Opções ..... 67
6 TARIFAÇÃO ..... 67

# 1 ATUALIZAÇÕES DA VERSÃO

| Versão | Atualização em | Atualização |
|---|---|---|
| 1.0 | 06/11/2019 | Alteração na descrição do campo “Monitoramento de Barreiras” do tópico **‘Registro de Contrato de Opções’** |
| 1.0 | 01/11/2019 | Alteração na descrição do campo “Monitoramento de Barreiras” do tópico **‘Registro de Contrato de Opções’** |
| 1.0 | 25/09/2019 | Alteração nos campos “Preço do Exercício” e “Limitador” do tópico **‘Registro de Contrato de Opções’** |
| 1.0 | 26/04/2019 | Adequação do Manual para a plataforma NoMe. |
| 2.0 | 30/03/2019 | Inclusão das funcionalidades de anulação de registro via arquivo, atualização de campos e filtros na tela de característica de contrato de opções e a disponibilização da função de cadastro do investidor CCP. |
| 2.1 | 12/06/2020 | Inclusão de informações sobre Antecipação de SWAP. |
| 2.2 | 28/09/2020 | - Em Consultas: inclusão da funcionalidade de consulta de Histórico de Ajustes por Proventos com os campos de quantidades de antecipação antes e pós pagamento de proventos, conforme divulgado no comunicado 019/2020-VPC.<br>- Inclusão sobre o processo de solicitação de exclusão de contratos<br>- Referência ao arquivo NegBalcao que contém o estoque de contratos em aberto ajustados por provento data geração do arquivo.<br>- Em Registro de Operações por Arquivo: incluída referência ao arquivo “Indexadores CCP” e link para acesso aos dados da Tarifação de Mercado de Balcão. |
| 2.3 | 26/10/2020 | - Em Registro: início do intervalo de verificação das barreiras Knock In e Knock Out a partir de D+1 da data de registro do contrato. |
| 2.4 | 07/12/2020 | - Em Registro,<br>- Habilitação do registro de Opções Flexíveis de Índices e ETFs com monitoramento Discreto.<br><br>- Em Exclusão do Contrato e na Consulta – Histórico de Ajuste de Proventos de Ações CCP: inclusão da documentação de funcionalidade já disponível ao mercado. |
| 2.5 | 09/04/2021 | Adequação das informações de “Cessão de Direito” para todos os produtos de Derivativos com CCP. |
| 2.6 | 28/06/2021 | - Em Consulta OTC,<br>Inclusão do campo “Tipo Indicador” na consulta retornada em tela e arquivo exportado no malote, conforme mencionado no comunicado 010/2021-VPC |
| 2.7 | 28/06/2021 | - Em Brokeragem,<br>Disponibilização de Registro de Broker de Swap com CCP via tela, conforme mencionado no comunicado 018/2021-VPC. |
| 2.8 | 26/07/2021 | - Opções Flexíveis de BDR<br>- Em Registro:<br>Inclusão de BDRs para registro de opções flexíveis no combo “Tipo Indicador”, conforme mencionado no comunicado 031/2021-VPC. |
| 2.9 | 20/09/2021 | - Consulta OTC<br>Inclusão de opções de filtro para a consulta por Tipo Indicador e Variável, conforme mencionado no comunicado 049/2021-VPC |
| 2.9 | 20/09/2021 | - Consultas e Relatório – Negbalcao<br>Disponibilização do arquivo negbalcao com os contratos em abertos antes da aplicação dos proventos, conforme mencionado no comunicado 049/2021-VPC |
| 3.0 | 20/09/2021 | - Transferência de Conta e Posição<br>Inclusão de funcionalidade que permite a transferência de posição via sistema, conforme mencionado no comunicado 049/2021-VPC |
| 3.1 | 20/09/2021 | - Exclusão de Contrato<br>Inclusão de funcionalidade que permite a exclusão de contratos via sistema, conforme mencionado no comunicado 049/2021-VPC |
| 3.2 | 28/09/2021 | Atualização de termos obsoletos do manual em aderência aos OC 005-2021 PRE, OC 022-2021 PRE, OC 109-2020 PRE quando se aplicar. |
| 3.3 | 13/12/2021 | Registro de Contrato de Opções |

| | | |
|---|---|---|
| | | Inclusão de novo campo opcional para auxiliar na identificação do lançamento das partes, conforme mencionado no comunicado 051/2021-VPC |
| 3.4 | 06/06/2022 | - Consulta Características de Contratos de Opção<br>Inclusão de novos campos na tela de Relação: “Data da Antecipação”, “Fator Limitador”, “Fator Barreira KI” e “Fator Barreira KO”.<br>- Exclusão de Contrato<br>Inclusão de passo para a aprovação/aceite da B3 após solicitação de exclusão do contrato pelo Participante. |
| 3.5 | 16/11/2022 | - Especificação de quando o arquivo MovBalcão é gerado pelo sistema |
| 3.6 | 11/04/2023 | - Adição de comentário na seção 3.6 Antecipação sobre o *matching* necessitar da mesma forma de lançamento<br>- Adição da regra de Pontas na seção 3.2 de Registro de Contratos de SWAP |
| 3.7 | 19/06/2023 | - Correção de ordem de contas no primeiro exemplo do registro de SWAP sobre P1 e P2 |
| 3.8 | 09/10/2023 | - Inclusão do campo “Parâmetros em %”, de preenchimento opcional conforme comunicado externo 041/2023-VPC. |
| 3.9 | 05/02/2024 | Inclusão dos campos: “variável”, “boletim” e “proteção contra proventos” na consulta de contrato de opções, conforme divulgado no comunicado externo 062/2023-VPC. |
| 4.0 | 22/04/2024 | - Inclusão dos campos “Prêmio Unitário” e “Rebate Unitário” para o cálculo quando “Parâmetros em %” for preenchido com “SIM”, conforme divulgado no Comunicado Externo 010/2024-VPC. |
| 4.1 | 22/07/2024 | - Ajuste em “Antecipação” identificando os prazos para lançamento, a saber D+2 da data de registro até D-1 da data fixing. |
| 4.2 | 21/01/2025 | Ajuste no direcionamento relacionado a funcionalidade de Anulação de Registro.<br>*(“CCP > Contrato de Opções > Lançamentos > Cancelamento de Operação”)* |
| 4.3 | 26/05/2025 | Inclusão da possibilidade de liquidar o Prêmio da Opção em D+2 (anteriormente era D+1 somente) |

## 2 INTRODUÇÃO

O Subsistema de Registro tem como objetivo o gerenciamento de operações de balcão e visa modernizar, aperfeiçoar e expandir o serviço de Registro de operações de balcão, oferecendo qualidade e agilidade aos Clientes, bem como ferramentas completas de análise para atividades de *back office*. Suas ferramentas e funcionalidades permitem aos usuários:

• Registrar operações de Derivativos de Balcão com CCP;

- Swap
- Termo
- Opção

• Realizar consultas unificadas das operações realizadas no dia e consulta de posições em aberto, auxiliando no gerenciamento e no controle da posição de seus clientes;

• Comandar operações de Registro; Antecipação parcial e/ou total; Anulação de Registro; Anulação de Antecipação; diretamente pelo sistema ou;

• Os eventos de Transferência de Conta, Cessão de Direito e Transferência de Posição só serão realizados mediante solicitação junto a B3, que é responsável pelas devidas análises e execução deste tipo de operação.

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

- Manual de Normas de Derivativos de Balcão; e

- Caderno de Fórmulas – Derivativos de balcão com CCP.

**Requisito Técnico:**

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

## 2.1 Ações dos botões das telas

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

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

# 3 LANÇAMENTOS

## 3.1 Cadastro

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

Para atuar como Participante de Registro, a instituição deverá solicitar seu Direito de Acesso ao Subsistema de Registro exclusivamente para registro de Derivativos com CCP, ao departamento de Cadastro da B3 apresentando a documentação necessária, disponível no site www.b3.com.br.

O Participante de Registro deverá cadastrar as contas de seus clientes na plataforma NoMe e na plataforma SINCAD. O cadastro em ambas as plataformas é necessário para que o sistema crie uma correlação entre os clientes.

Na plataforma NoMe devem ser considerados dois processos distintos de cadastro:

1) **Comitentes** – Devem ser cadastrados no *Menu Identificação de Comitentes (SIC),* conforme Manual de Operações "SIC - Identificação de Comitentes".

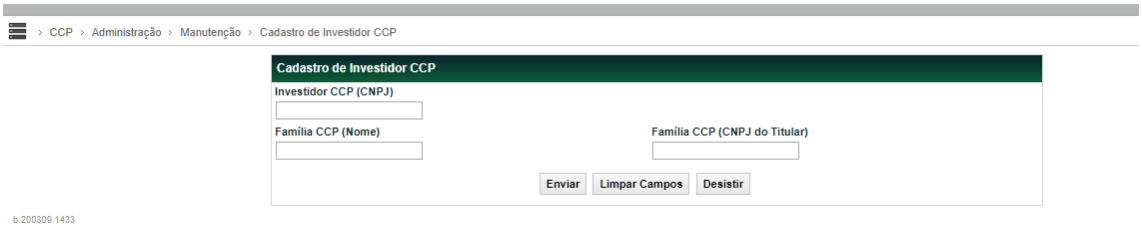
   São comitentes: Pessoa Física, Investidor não Residente (INR) e Pessoa Jurídica não financeira.

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

2) **Investidor CCP** – Devem ser cadastrados no *Menu CCP > Administração > Manutenção > Cadastro de investidor CCP.*

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

**Tela Cadastro de Investidor CCP.**




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

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

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

Está função também está disponível por arquivo, o leiaute do arquivo está disponível no site da B3, em http://www.b3.com.br/pt_br/regulacao/estrutura-normativa/manuais-de-operacoes/manuais-operacionais/Leiautes - Derivativos com CCP Para essa verificação, é preciso acessar a plataforma NoMe no menu lateral, CCP, Administração, Consultas e Consulta de Contas/Comitentes *Cetip* x Contas Sincad, preencher os dados do PR e cliente e clicar em Pesquisar.

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

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

## 3.2 Registro de Contrato de SWAP

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

### Visão Geral

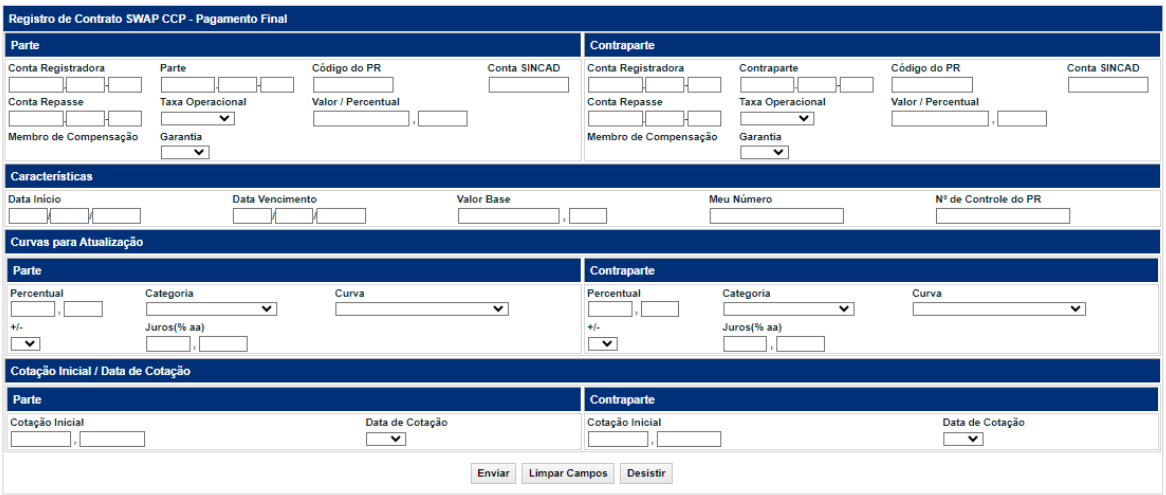
Através desta função, é possível registrar um contrato de Swap com CCP.

Para a definição de Ponta 1 e Ponta 2, é feito uma soma entre o radical da Conta Registradora com o tipo da Conta Registradora onde:

- A menor conta entre elas se torna a P1.
- Quando as duas contas são iguais, o sistema utilizará como P1 a ponta que for lançada no lado da Parte e como P2 a do lado Contraparte.
- Exemplo: Conta 1 = 05000.00-1 vs 04000.00-2
    - A P1 será: 04000.00-2
    - A P2 será: 05000.00-1
- Exemplo: Conta 1 = 05000.00-1 vs 05000.10-4
    - A P1 será a conta que fizer o primeiro lançamento

- A P2 será a conta que fizer o segundo lançamento

### Tela Registro de Contrato – Swap




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

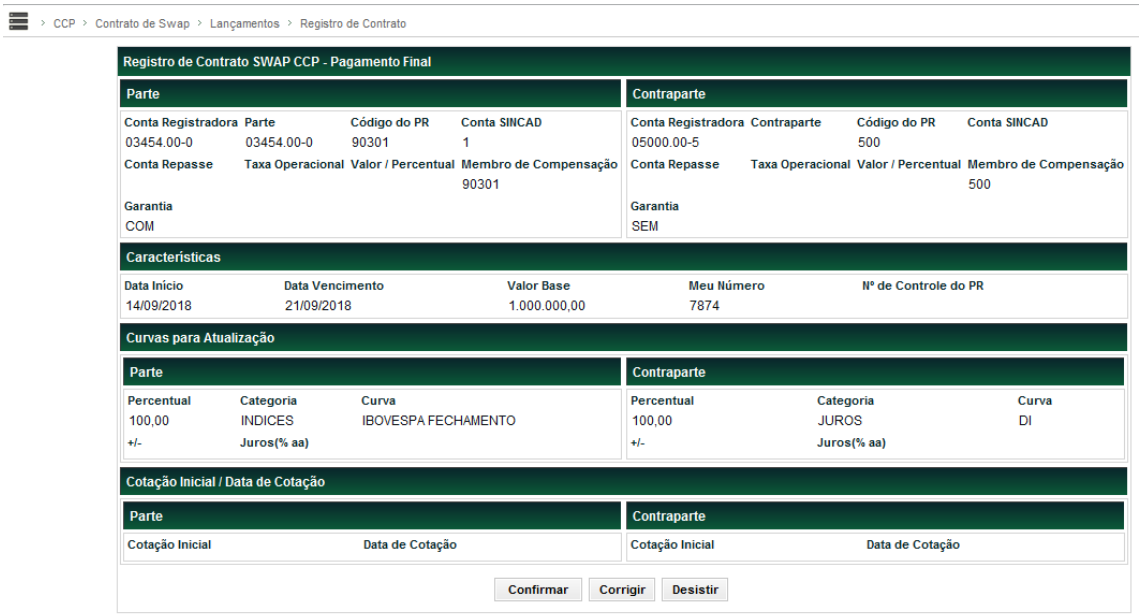
| Campo | Descrição |
|---|---|
| Conta Registradora - Parte | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta Registradora do Participante da Parte do contrato. |
| Parte | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta do cliente da parte do contrato. |
| Campo | Descrição |
| Código do PR – Parte | Campo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

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

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

| | |
|---|---|
| | Valor percentual do parâmetro com que o participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva.<br>Informado com até 3 (três) inteiros e 2 (dois) decimais. |
| Categoria | Campo de preenchimento obrigatório<br>Campo tipo “domínio” com as opções: INDICES, INDICES DE PREÇOS, JUROS e TAXAS DE CAMBIO. |
| Curva | Campo de preenchimento obrigatório<br>Campo deve ser preenchido com a escolha da curva do contrato, conforme parâmetros estabelecidos na Tabela Auxiliar – Swap com CCP. |
| +/- | Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. |
| Juros (%aa) | Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.<br>Preencher em conjunto com **Sinal**. Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais. |
| **Curvas para atualização – Contraparte** | |
| Percentual | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Valor percentual do parâmetro com que o participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva.<br>Informado com até 3 (três) inteiros e 2 (dois) decimais. |
| Categoria | Campo de preenchimento obrigatório<br>Campo tipo “domínio” com as opções: INDICES, INDICES DE PREÇOS, JUROS e TAXAS DE CAMBIO. |
| Curva | Campo de preenchimento obrigatório<br>Campo deve ser preenchido com a escolha da curva do contrato conforme parâmetros estabelecidos na Tabela Auxiliar – Swap com CCP. |
| +/- | Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. |
| Juros (%aa) | Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.<br>Preencher em conjunto com Sinal.<br>Informado com até 3 (três) inteiros e 4 (quatro) decimais. |
| **Cotação Inicial / Data da Cotação - Parte** | |
| Cotação Inicial | Campo de preenchimento opcional.<br>Permitido apenas para “TAXAS DE CAMBIO”.<br>Informado com até 6 (seis) inteiros e 7 (sete) decimais. |
| Data da Cotação | Campo de preenchimento obrigatório para “TAXAS DE CAMBIO”.<br>Campo tipo “domínio” com a opção: “D-1”. |
| **Cotação Inicial / Data da Cotação - Contraparte** | |
| Cotação Inicial | Campo de preenchimento opcional.<br>Permitido apenas para “TAXAS DE CAMBIO”.<br>Informado com até 6 (seis) inteiros e 7 (sete) decimais. |
| Data da Cotação | Campo de preenchimento obrigatório para “TAXAS DE CAMBIO”.<br>Campo tipo “domínio” com a opção: “D-1”. |

## Tela de Confirmação




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

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

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

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

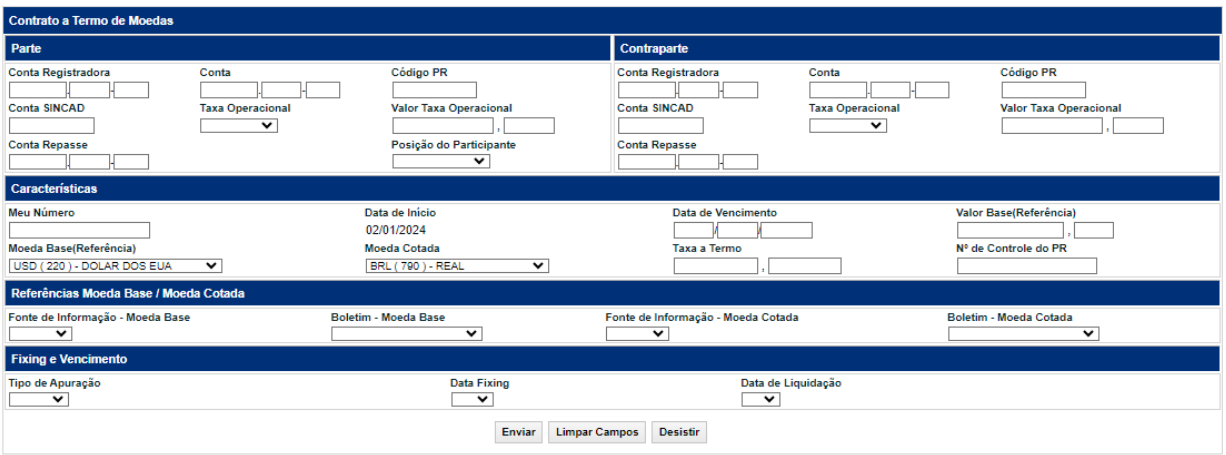
### 3.3 Registro de Contrato de Termo de Moedas

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

#### Visão Geral

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

**Tela Registro de Contrato – Termo de Moedas**




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

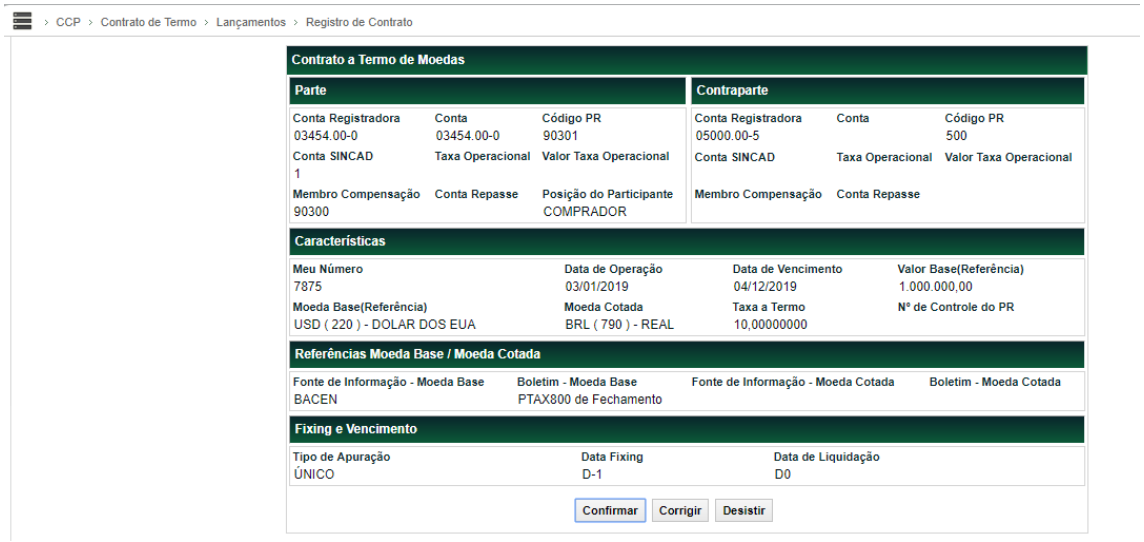
| Campo | Descrição |
|---|---|
| Conta Registradora - Parte | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Código da Conta Registradora que identifica o membro que está acessando o sistema e, consequentemente, registrando o contrato. |
| Conta - Parte | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta do cliente da parte do contrato. |

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

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

| **CARACTERÍSTICAS – *Características básicas do contrato*** | |
|---|---|
| Meu Número | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Número atribuído à operação de registro do contrato de Termo com CCP.<br>Número interno de cada Participante de Registro, identificando o lançamento. |
| Data Início | Campo não editável.<br>Vem preenchido com a data do dia do Registro, conforme parâmetros definidos na Tabela Auxiliar – Termo com CCP. |
| Data Vencimento | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Data na qual o contrato de Termo com CCP vence. Deve ser maior que data início e em dia útil (considerando calendário da clearing da B3). |
| Valor Base (Referência) | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Valor base de referência a partir do qual os parâmetros definidos para o contrato ou para a correção das operações a termo irão incidir.<br>Com 14 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais. |
| Moeda Base (Referência) | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Campo tipo domínio com as opções: DOLAR, EURO e IENE |
| Moeda Cotada | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Campo tipo domínio com a opção: REAL |
| Taxa a Termo | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Taxa acordada entre as partes que será utilizada para o cálculo do valor de liquidação no vencimento. Com 14 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais. |
| Nº de Controle do PR | Campo de preenchimento Opcional<br>Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato. |
| **Referências Moeda Base / Moeda Cotada** | |
| Fonte de Informação – Moeda Base | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Indica a fonte a ser utilizada para cotação da moeda. |
| Boletim – Moeda Base | Campo de preenchimento obrigatório<br>Boletim que será usado para cotação da moeda base.<br>Campo tipo “domínio” com a opção: BACEN. |
| **Fixing e Vencimento** | |
| Tipo de Apuração | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Campo tipo “domínio” com a opção: Único. |
| Data Fixing | Campo de preenchimento obrigatório<br>Campo tipo “domínio” com a opção: D-1 |
| Data de Liquidação | Campo de preenchimento obrigatório<br>Essa data deve ser em D0, dia do vencimento. |

**Tela de Confirmação**




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

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

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

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

## 3.4 Registro de Contrato de Opções

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

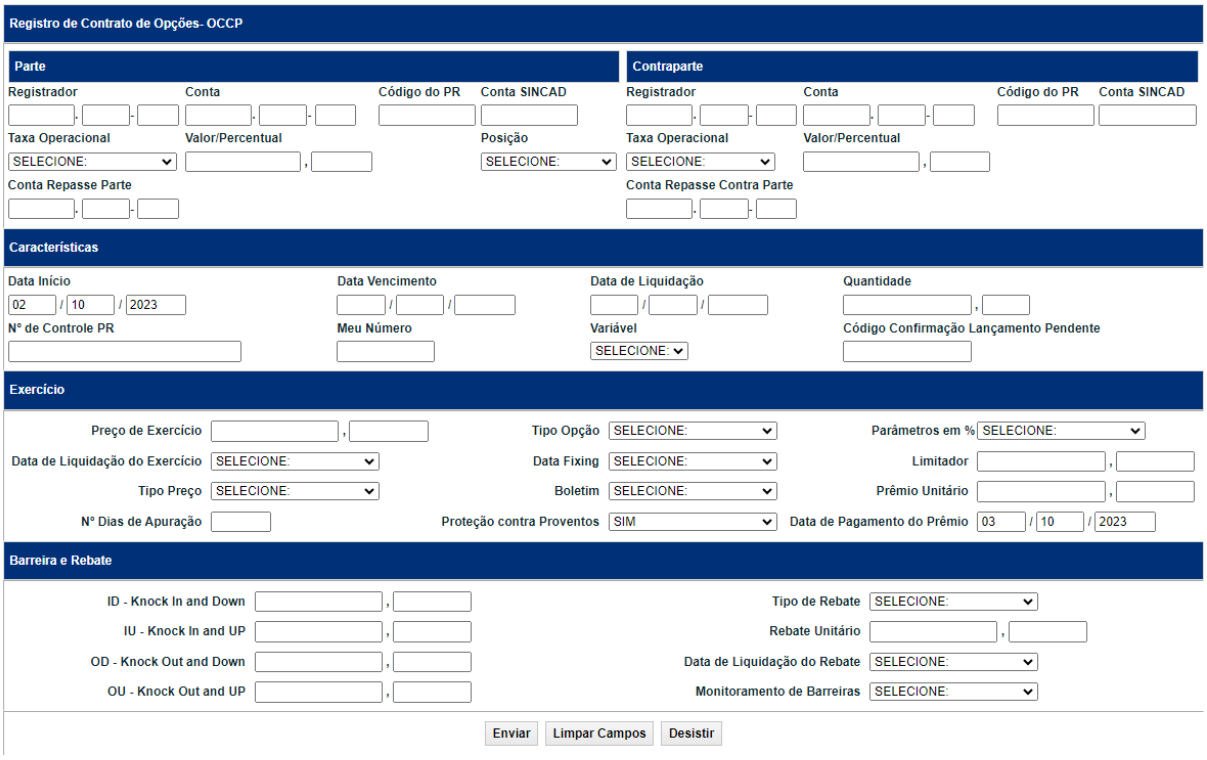
### Visão Geral

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

## Tela Registro de Contrato – Opções

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

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



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

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

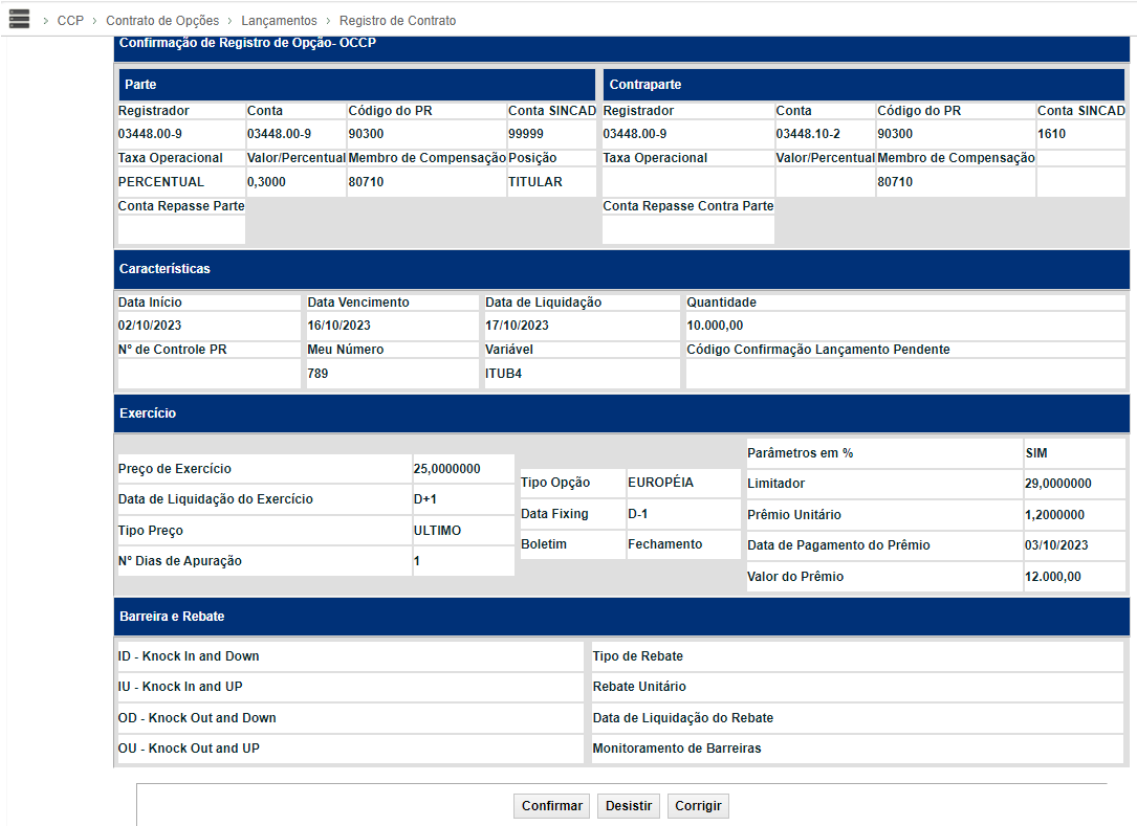
| | |
|---|---|
| Taxa Operacional | Campo Opcional<br>Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação, se aplicável.<br>Valor meramente informativo.<br>Opções:<br>Percentual (será aplicado sobre o valor base remanescente); ou<br>Valor. |
| Valor / Percentual | Campo de preenchimento opcional.<br>Preencher com as opções "valor" ou "percentual" caso tenha sido cobrada uma taxa operacional no Registro do contrato<br>Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais. |
| Conta Repasse – Contraparte | Campo de preenchimento opcional (preenchimento só será obrigatório quando a conta tiver vínculo de repasse).<br>Conta Registradora da conta de repasse do cliente final (cessionário da operação) da contraparte que na outra ponta do contrato, se houver |
| **CARACTERÍSTICAS** | |
| Data Início | Campo não editável.<br>Vem preenchido com a data do dia do Registro. |
| Data Vencimento | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Data na qual o contrato de Opção com CCP vence. Deve ser maior que data início e em dia útil (seguindo o calendário da clearing). |
| Data de Liquidação | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Essa data deve ser 1 dia útil (considerando o calendário da clearing) após a data do vencimento. |
| Quantidade | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Preencher com a quantidade de opções negociadas<br>Com 15 (quinze) inteiros e 2 (duas) casas decimais. |
| Nº de Controle do PR | Campo de preenchimento opcional<br>Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato. |
| Meu Número | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Número atribuído à operação de registro do contrato de Opção com CCP.<br>Número interno de cada Participante, identificando o lançamento. |
| Variável | Indica os tipos de Variáveis relacionadas ao "Tipo Indicador" selecionado na primeira tela de registro. Combo box<br>As variáveis permitidas para Registro estão mencionadas na Tabela Auxiliar – Opção com CCP no site da B3. |
| Código Confirmação Lançamento Pendente | Campo de preenchimento opcional.<br>Código atribuído pelo Participante para identificação do Registro, sendo, esse código visível pela contraparte do contrato. |
| **Exercício** | |
| Preço de Exercício | Campo de preenchimento obrigatório. Valor do strike do ativo subjacente.<br>Informado com até 15 (quinze) inteiros e 7 (sete) decimais. |
| Data de Liquidação do Exercício | Campo de preenchimento obrigatório<br>Essa data deve ser 1 dia útil (considerando o calendário da Clearing) após a data do vencimento. |
| Tipo Preço | Campo de preenchimento obrigatório<br>Indica o tipo de preço da Opção Flexível com CCP, conforme especificação da Tabela Auxiliar- Opção Flexível com CCP disponível no site da B3.<br>Opções: Último / Médio |
| Nº Dias de Apuração | Caso o tipo preço seja "médio", este campo indica o número de verificações de preço para apuração no vencimento ou Antecipação, a contar da Data de Fixing. |

| | |
|---|---|
| Tipo Opção | Campo de preenchimento obrigatório<br>Indica o tipo de Opção Flexível com CCP, conforme especificação da Tabela Auxiliar – Opção Flexível com CCP.<br>Opção: Europeia para derivativos com CCP. |
| Data Fixing | Data de observação do preço da Variável, conforme especificação da Tabela Auxiliar – Opção Flexível com CCP disponível no site da B3 |
| Boletim | Campo de preenchimento obrigatório<br>Boletim/horário do veículo oficial no qual serão publicados os valores da Variável selecionada. |
| Proteção contra Proventos | Indica proteção contra proventos<br>Campo aplicável para Opção Flexível de Ação e de BDR com CCP.<br>*Default* "SIM" |
| Parâmetros em % | Campo com os domínios: "vazio e "SIM", de preenchimento opcional<br>Deverá ser utilizado no caso de registro com os parâmetros: "Preço de Exercício", "Limitador", "Barreiras", "Prêmio Unitário" e "Rebate Unitário" em formato percentual<br>*Default*: "vazio" |
| Limitador | Campo de preenchimento opcional<br>Valor do limitador inferior ou superior para o monitoramento das barreiras.<br>Informado com até 15 (quinze) inteiros e 7 (sete) decimais. |
| Prêmio Unitário | Prêmio unitário acordado entre as partes.<br>Informado com 15 (quinze) inteiros e 7 (sete) decimais. |
| Data de Pagamento do Prêmio | Indica a data de Liquidação financeira do Prêmio, nos contratos com garantia a data do pagamento poderá ser D+1 ou D+2 dias úteis (seguindo calendário da clearing) do Registro. |
| **Barreira e Rebate** | |
| ID - Knock In and Down | Campo de preenchimento obrigatório caso o contrato tenha o tipo de barreira indicado |
| IU - Knock In and UP | Campo de preenchimento obrigatório caso o contrato tenha o tipo de barreira indicado |
| OD - Knock Out and Down | Campo de preenchimento obrigatório caso o contrato tenha o tipo de barreira indicado |
| OU - Knock Out and UP | Campo de preenchimento obrigatório caso o contrato tenha o tipo de barreira indicado |
| Tipo de Rebate | Campo de preenchimento opcional.<br>Preencher com as opções "VALOR" ou "PERCENTUAL" caso o contrato possua rebate. |
| Rebate Unitário | Campo de preenchimento obrigatório caso o "Tipo de Rebate" tenha sido preenchido<br>Com 10 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais |
| Data de Liquidação do Rebate | Preenchimento obrigatório<br>Essa data deve ser 1 dia útil (considerando o calendário da Clearing) após a data de vencimento, porém, caso a barreira seja acionada em momento anterior ao vencimento, o rebate será liquidado financeiramente em D+1 da data de acionamento da barreira. |
| Monitoramento de Barreiras | Preenchimento obrigatório caso algum campo das barreiras de Knock In ou Knock Out tenha sido preenchido |

Campo tipo domínio com as opções: DISCRETA ou CONTÍNUA (as duas opções estão disponíveis apenas para as opções flexíveis sob o Tipo Indicador “Ações”,” ETF”, e “Índices” - os demais seguem conforme a tabela auxiliar de Opções Flexíveis).

A verificação de Barreiras de Knock In (KI) e Knock Out (KO) para os contratos de Opções Flexíveis Com CCP ocorre a partir de D+1 da Data de Registro (inclusive) até a Data de Fixing (inclusive).

## Tela de Confirmação



› CCP › Contrato de Opções › Lançamentos › Registro de Contrato

**Confirmação de Registro de Opção- OCCP**

| Parte | | | | Contraparte | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Registrador | Conta | Código do PR | Conta SINCAD | Registrador | Conta | Código do PR | Conta SINCAD |
| 03448.00-9 | 03448.00-9 | 90300 | 99999 | 03448.00-9 | 03448.10-2 | 90300 | 1610 |
| Taxa Operacional | Valor/Percentual | Membro de Compensação | Posição | Taxa Operacional | Valor/Percentual | Membro de Compensação | |
| PERCENTUAL | 0,3000 | 80710 | TITULAR | | | 80710 | |
| Conta Repasse Parte | | | | Conta Repasse Contra Parte | | | |

**Características**

| Data Início | Data Vencimento | Data de Liquidação | Quantidade |
|---|---|---|---|
| 02/10/2023 | 16/10/2023 | 17/10/2023 | 10.000,00 |
| Nº de Controle PR | Meu Número | Variável | Código Confirmação Lançamento Pendente |
| | 789 | ITUB4 | |

**Exercício**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | Parâmetros em % | SIM |
| Preço de Exercício | 25,0000000 | Tipo Opção | EUROPÉIA | Limitador | 29,0000000 |
| Data de Liquidação do Exercício | D+1 | Data Fixing | D-1 | Prêmio Unitário | 1,2000000 |
| Tipo Preço | ULTIMO | Boletim | Fechamento | Data de Pagamento do Prêmio | 03/10/2023 |
| Nº Dias de Apuração | 1 | | | Valor do Prêmio | 12.000,00 |

**Barreira e Rebate**

| | |
|---|---|
| ID - Knock In and Down | Tipo de Rebate |
| IU - Knock In and UP | Rebate Unitário |
| OD - Knock Out and Down | Data de Liquidação do Rebate |
| OU - Knock Out and UP | Monitoramento de Barreiras |

Confirmar | Desistir | Corrigir

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

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

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

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

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

### 3.5 Antecipação

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

Admite-se o lançamento da Antecipação (total ou parcial) de um derivativo de balcão com CCP de D+2 da data de registro até D-1 da data fixing, inclusive.

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

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

Adicionalmente, para o *matching*, é necessário que os dois participantes realizem o lançamento da antecipação com os mesmos dados nos campos “Valor a Antecipar” ou “Percentual a Antecipar”, ou seja, não é possível realizar o *matching* se uma das pontas utilizar valor e a outra percentual.

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

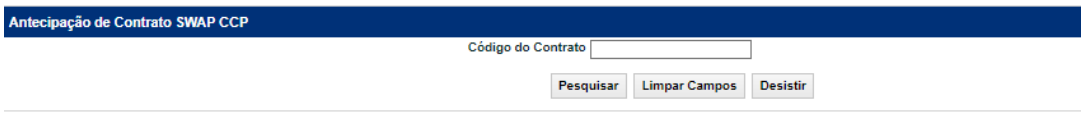
Eventualmente, em casos de erro de preenchimento dos dados de Antecipação, entrar em contato imediatamente com a B3 dentro do horário limite de encerramento do sistema, através da Diretoria de Depositária e Operações de Balcão para análise.

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

#### Antecipação de Swap

**CCP > Contratos de Swap > Lançamentos > Antecipação de Contrato**

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



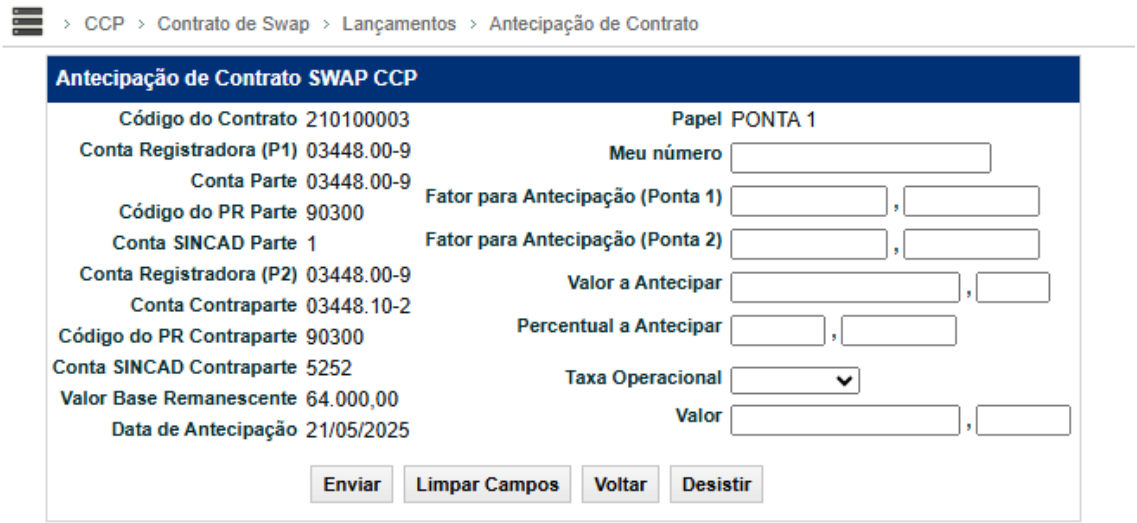

O Participante de Registro deve inserir o código do contrato e clicar no botão pesquisar para acessar o contrato que se deseja antecipar.

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

- **Valor Antecipação total** = **(Valor Base Remanescente * Fator Parte) - (Valor Base Remanescente * Fator Contraparte),** onde:
    - Valor Base Remanescente = valor base original decrescido das amortizações já efetuadas.

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

- **Valor Antecipação parcial** = **(Valor a Antecipar * Fator para Antecipação - Parte) - (Valor a Antecipar * Fator para Antecipação - Contraparte),** onde:
    - Valor a Antecipar = valor informado pelo participante / contraparte que deve ser menor ou igual ao Valor Base Remanescente do contrato; e
    - Fator para Antecipação = fator de atualização do valor base a antecipar.




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

| Campo | Descrição |
|---|---|
| Meu Número | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Número atribuído pelo Participante de Registro, que estiver realizando a operação de Antecipação. |

| | |
|---|---|
| Fator para Antecipação (Ponta1) | Campo de preenchimento obrigatório.<br>**Se Antecipação Total**: fator para atualização do valor base remanescente, compondo o financeiro da ponta do Participante de Registro.<br>Se **Antecipação parcial:** fator para atualização do valor a ser antecipado (informado no campo "Valor para Antecipação"), compondo o financeiro da ponta do Participante de Registro.<br>Informado com 10 (dez) inteiros e 8 (oito) casas decimais. |
| Fator para Antecipação (Ponta2) | Campo de preenchimento obrigatório.<br>**Se Antecipação total:** fator para atualização do valor base remanescente, compondo o financeiro da ponta da Contraparte.<br>**Se Antecipação parcial:** fator para atualização do valor a ser antecipado (informado no campo "Valor para Antecipação"), compondo o financeiro da ponta da Contraparte.<br>Informado com 10 (dez) inteiros e 8 (oito) casas decimais. |
| Valor a Antecipar | Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo "Percentual a antecipar".<br>Valor total ou parcial a antecipar do contrato.<br>Informado com 17 (dezessete) inteiros e 2 (dois) decimais. |
| Percentual a antecipar | Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo "Valor a Antecipar".<br>O Participante de Registro deve informar o percentual da operação que deseja antecipar. Este valor deve ser maior que 0%.<br>Informado com 10 (dez) inteiros e 6 (seis) decimais. |
| Taxa Operacional | Campo Opcional<br>Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação, se aplicável.<br>Valor meramente informativo.<br>Opções:<br>Percentual (será aplicado sobre o valor base remanescente); ou Valor |
| Valor / Percentual | Campo de preenchimento obrigatório se preenchido o campo "Taxa Operacional"<br>Indica o valor/percentual cobrado da operação.<br>Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais. |

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

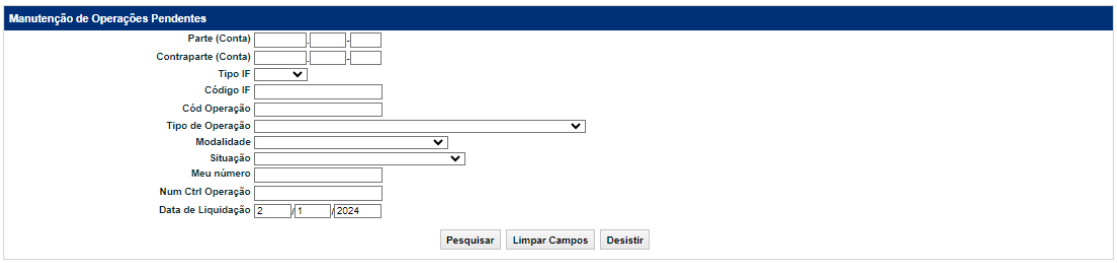
Em operações de Duplo Comando, ao clicar no botão "Confirmar", o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o sistema está aguardando lançamento da contraparte.

### Tela de Antecipação de Contrato – SWAP

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

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

**Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes**

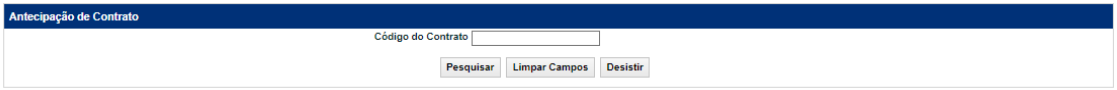



A operação aceita mediante a validação bem-sucedida pelo sistema das informações preenchidas pelo Participante de Registro (aplicável as instruções dos demais derivativos que podem ser antecipados).

## Antecipação Termo

**CCP > Contratos de Termo > Lançamentos > Antecipação de Contrato**

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




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

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

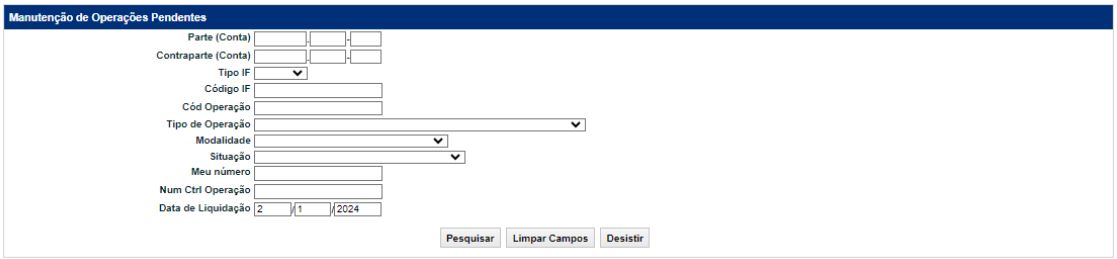
| Campo | Descrição |
|---|---|
| Meu Número | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Número atribuído pelo Participante de Registro, que estiver realizando a operação de antecipação. |
| Valor para Antecipação | Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo "Percentual a Antecipar".<br>Valor total ou parcial a antecipar do contrato.<br>Informado com 17 (dezessete) inteiros e 2 (dois) decimais. |
| Percentual para Antecipação | Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo "Valor a Antecipar".<br>O Participante de Registro deve informar o percentual da operação que deseja antecipar. Este valor deve ser maior que 0%.<br>Informado com 10 (dez) inteiros e 6 (seis) decimais. |
| Valor Financeiro a Antecipar (BRL) | Campo de preenchimento obrigatório.<br>O Participante de Registro deve informar o resultado financeiro da Antecipação que está liquidando (em reais).<br>Informado com 17 (dezessete) inteiros e 2 (dois) decimais. |
| Visão Comprador | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Este campo deve indicar se a parte é credora ou devedora.<br>**Caixa de seleção:**<br>Débito: indicar se a parte da operação for devedora.<br>Crédito: indicar se a parte da operação for credora. |
| Taxa Operacional | Campo Opcional<br>Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação.<br>Valor meramente informativo.<br>Opções:<br>Percentual (aplicado sobre o valor base remanescente); ou<br>Valor |
| Valor / Percentual | Campo de preenchimento obrigatório se preenchido o campo "Taxa Operacional"<br>Indica o valor/percentual cobrado da operação.<br>Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais. |

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

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

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

**Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes**




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

## Antecipação Opção

**CCP > Contratos de Opção > Lançamentos > Antecipação de Contrato**

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

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

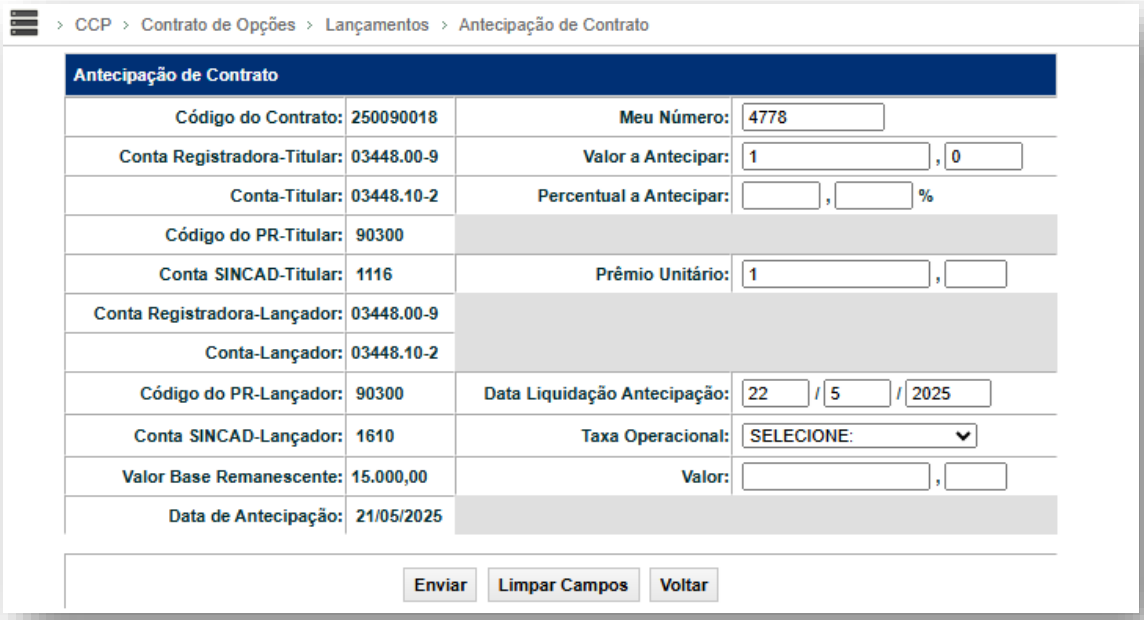
**Opção de Venda (Put) –** a cotação da Variável da Opção Flexível com CCP está abaixo do preço de Exercício.

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

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

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

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




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

| Campo | Descrição |
|---|---|
| Meu Número | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Número atribuído pelo Participante de Registro, que estiver realizando a operação de Antecipação. |
| Valor para Antecipação | Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo “Percentual a Antecipar”.<br>Valor total ou parcial a antecipar do contrato.<br>Preenchido com 10 inteiros e 2 casas decimais. |
| Percentual para Antecipação | Campo de preenchimento obrigatório se não for preenchido o campo “Valor a Antecipar”.<br>O Participante de Registro deve informar o percentual da operação que deseja antecipar. Este valor deve ser maior que 0%.<br>Informado com 10 (dez) inteiros e 6 (seis) decimais. |
| Prêmio Unitário | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Valor do Prêmio unitário de reversão negociado entre as partes.<br>Informado com 15 (quinze) inteiros e 7 (sete) decimais. |
| Valor Prêmio da Antecipação | Valor financeiro do Prêmio calculado pelo sistema. |

| | |
|---|---|
| Taxa Operacional | Campo Opcional<br>Indica a forma de cobrança da taxa operacional da operação.<br>Valor meramente informativo.<br>Opções:<br>Percentual (aplicado sobre o valor base remanescente); ou<br>Valor |
| Valor / Percentual | Campo de preenchimento obrigatório se preenchido o campo "Taxa Operacional"<br>Indica o valor/percentual cobrado da operação.<br>Informado com 13 (treze) inteiros e 4 (quatro) decimais. |

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

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

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

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

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

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

### 3.6 Anulação de Registro

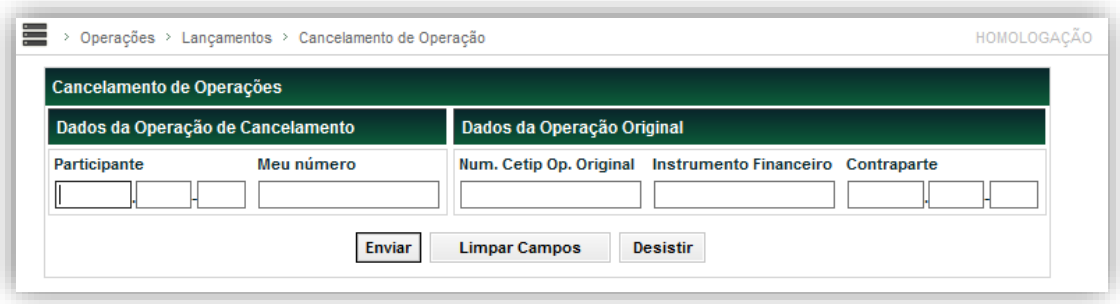
**CCP > Contrato de Opções > Lançamentos > Cancelamento de Operação**

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

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

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

Está função também está disponível por arquivo. O leiaute do arquivo para cancelamento de Swap e Termo é o mesmo, já para Opções Flexíveis temos um modelo único e está disponível no site da B3, em http://www.b3.com.br/pt_br/regulacao/estrutura-normativa/manuais-de-operacoes/manuais-operacionais/Leiautes - Derivativos com CCP




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

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

## 3.7 Cancelamento de Antecipação

**Menu Operações > Lançamentos > Cancelamento de Operação**

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

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

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

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

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

## 3.8 Exclusão de Contrato

**CCP > Operações > Lançamentos > Exclusão de Contrato**

As solicitações de exclusão de contratos de derivativos com CCP podem ser realizadas pelo Participante através do sistema NoMe a partir de D+1 do registro até D-1 da data de apuração (fixing). Deve ser informada justificativa plausível, cabendo a B3 eventuais questionamentos.

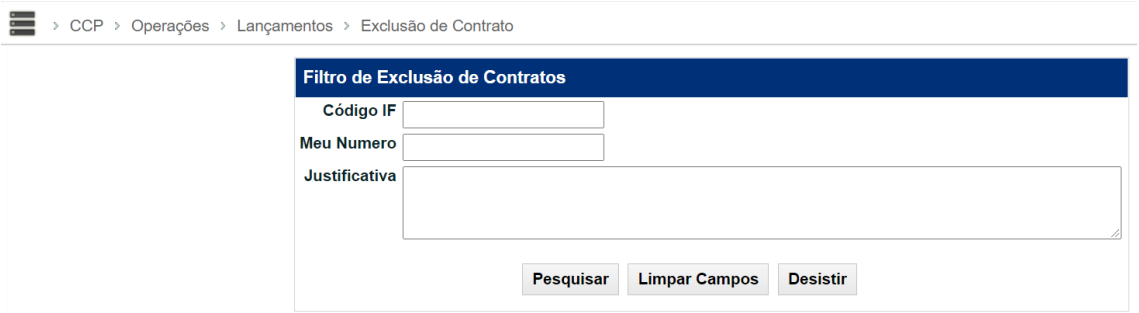
O Participante de Registro deverá realizar a operação de exclusão via sistema. Após o lançamento da solicitação deverá entrar em contato com a área de Operações de Derivativos de Balcão, informando sobre a exclusão bem como sua justificativa.

As solicitações devem ser realizadas até 18hr.

Eventuais solicitações não atendidas pelo fluxo descrito acima deverão ser tratadas junto a B3 e o procedimento será informado caso a caso.

A exclusão do contrato **não** gera estorno de valores financeiro da operação já liquidados até a data da exclusão e está sujeita a tarifação conforme política da B3.

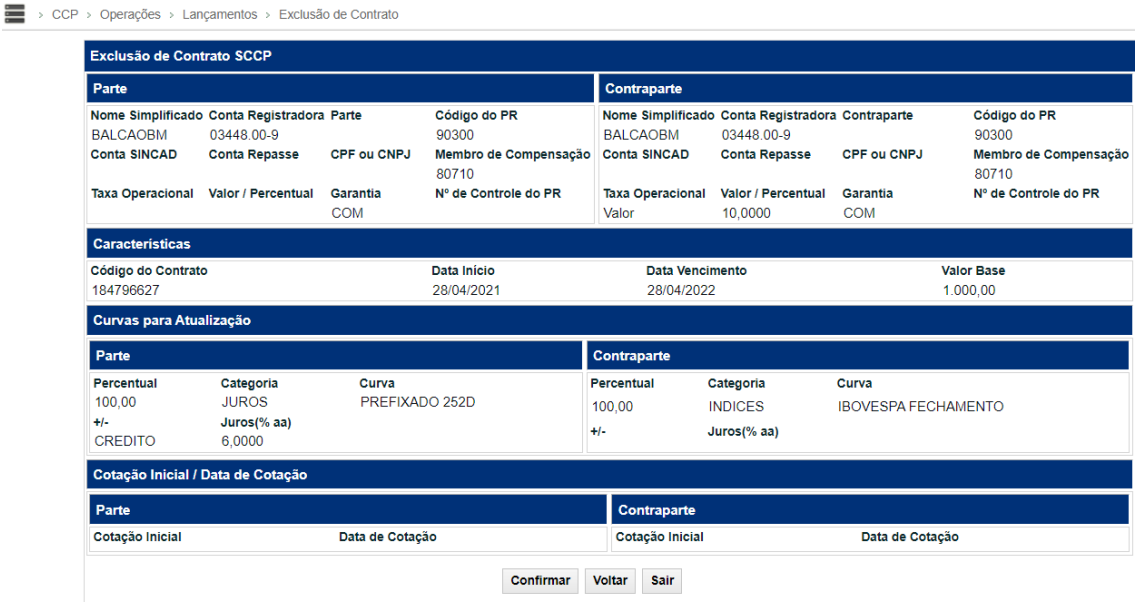
## Tela Exclusão de Contrato




## Descrição dos Campos da Tela Exclusão de Contrato

| Campo | Descrição |
|---|---|
| Código IF | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Indica o código do IF a ser excluído |
| Meu Número | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Número atribuído à operação de exclusão de contratos.<br>Número interno de cada Participante, identificando o lançamento |
| Justificativa | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Indica o motivo informado pelo Participante para a exclusão de um Contrato |

## Tela de Confirmação




Em operações de Comando Simples, ao selecionar o botão Pesquisar, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante da solicitação pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação ou desistência. Após clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que a solicitação está aguardando análise da B3.

Em operações de Duplo Comando, ao clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o sistema está aguardando lançamento da contraparte e o disponibilizará posteriormente para análise da B3.

A confirmação da contraparte pode ser feita de duas maneiras: pela própria tela de solicitação de exclusão ou pela funcionalidade **Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes**. Somente após a confirmação da contraparte que o contrato é disponibilizado para análise da B3.

Caso a operação não seja confirmada até o horário de encerramento, o sistema descartará essa ação ao final do dia.

Após a aprovação da B3 o sistema gera o número de identificação da Operação.

## 3.9 Transferência de Conta e Posição

**Menu CCP > Operações > Lançamentos > Cessão/Transferência de Contratos**

A operação de Transferência de Conta e Posição promove a transferência de uma operação de uma conta de cliente para outra de cliente sob o mesmo Participante de Registro ou a transferência da operação de um Participante de Registro para outro Participante de Registro, mediante prévia análise da B3.

O Participante de Registro deverá realizar a solicitação de transferência via sistema NoMe identificando os dados da operação. Após o lançamento deverá entrar em contato com a Diretoria de Depositária e Operações de Balcão da B3 através do e-mail: op.derivativosbalcao@b3.com.br, informando sobre a transferência bem como sua justificativa.

Fica a critério da B3 analisar pedidos de transferência em caráter de exceção que não sejam sistêmicos (mediante envio de carta com o de acordo dos representantes que possuem outorga perante a instituição).

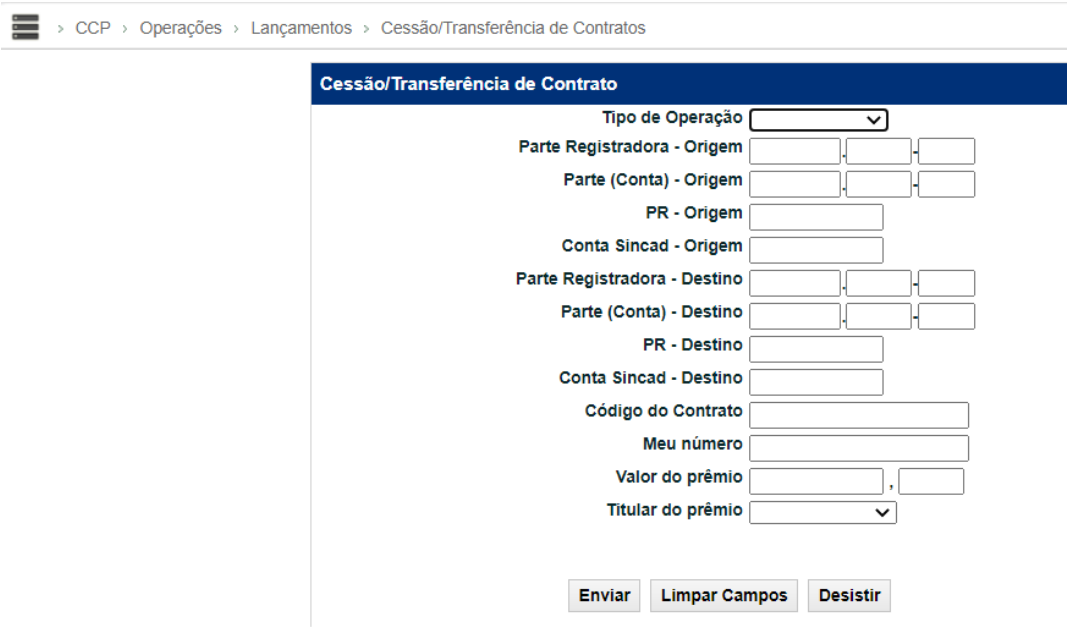
A transferência de posição contratual referente ao Derivativos com CCP está sujeita à análise e critérios das áreas de risco e garantias da B3 conforme Manual de Administração de Risco da Câmara B3.

As solicitações devem ser realizadas **até 12hr** (pedidos recebidos após esse horário estão sujeitos à análise e realização somente no dia útil posterior, sendo necessário uma nova solicitação).

A transferência pode ser feita a partir de D+1 da Data de Negociação até D-1 da Data da Apuração do contrato.

### Visão Geral

Esta função permite ao Participante de Registro solicitar a Transferência um contrato de derivativo com CCP.




### Descrição dos Campos da Tela Transferência de Contrato

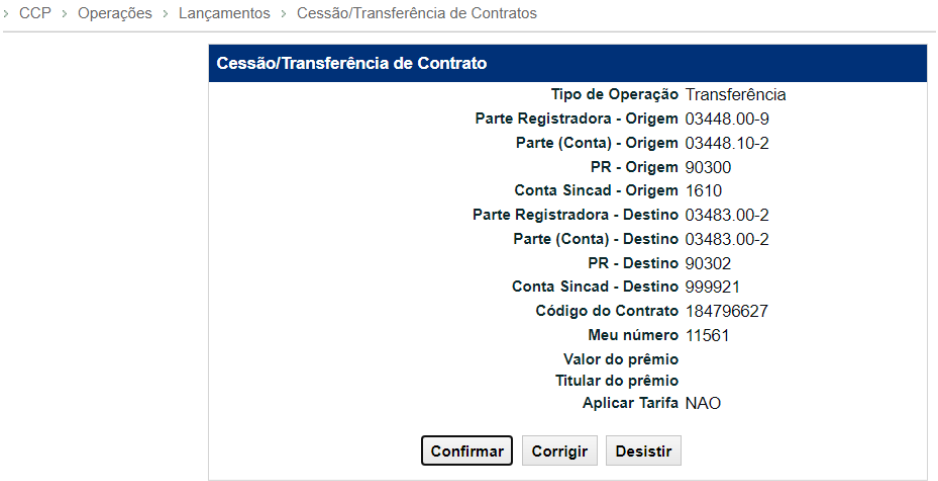
| Campo | Descrição |
|---|---|
| Tipo de Operação | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Campo com as opções Cessão e Transferência |
| Parte Registradora – Origem | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta Registradora do Participante do contrato de Origem |
| Parte (Conta) - Origem | Campo Opcional<br>Conta do cliente do contrato de Origem |
| PR – Origem | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Código de Registro do Participante do contrato de Origem |
| Conta SINCAD – Origem | Campo Opcional<br>Código da conta SINCAD do cliente do contrato de Origem |
| Parte Registradora – Destino | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta Registradora do Participante do contrato de Destino |
| Parte (Conta) – Destino | Campo Opcional<br>Conta do cliente do contrato de Destino |
| PR – Destino | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Código de Registro do Participante do contrato de Destino |
| Conta SINCAD – Destino | Campo Opcional<br>Código da conta SINCAD do cliente do contrato de Destino |
| Código do Contrato | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Informa o Código do contrato que sofrerá a operação |

| | |
|---|---|
| Meu Número | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Número atribuído à operação de exclusão de contratos.<br>Número interno de cada Participante, identificando o lançamento |
| Valor do Prêmio | Campo Opcional<br>Esse campo é exclusivo para solicitações de Cessão de Direito |
| Titular do Prêmio | Campo Opcional<br>Esse campo é exclusivo para solicitações de Cessão de Direito |

Após o preenchimento dos campos obrigatórios da tela, o Participante de Registro deve clicar no botão “Enviar” para seguir com a solicitação, poderá, ainda, limpar os campos preenchidos em tela ou desistir da operação. A operação está sujeita a tarifação conforme política da B3.

Em operações de Comando Simples, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante de Registro pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que a solicitação está aguardando análise da B3.

**Tela de Confirmação**




Em operações de Duplo Comando, ao clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o sistema está aguardando lançamento do Destino e posterior análise da B3.

A confirmação do Participante de Destino pode ser feita de duas maneiras: pela própria tela de solicitação de transferência ou pela funcionalidade: “Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes”.

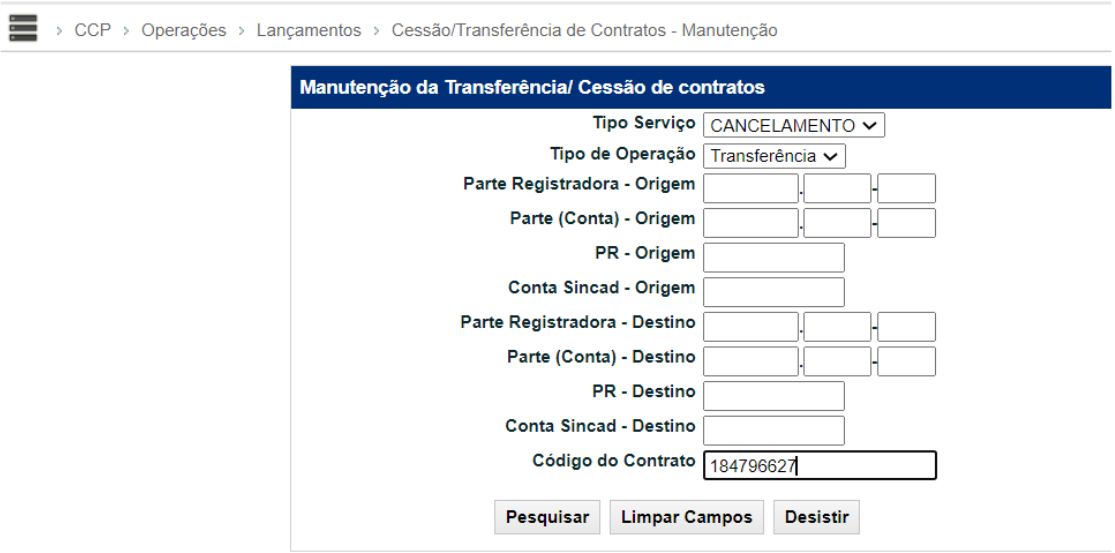
Somente após o confronto automático das informações e aprovação da B3 o sistema gera o número de identificação da Operação. Caso a operação não seja confirmada até o horário de encerramento, o sistema descartará essa ação ao final do dia.

### Cancelamento de Transferência

O cancelamento das solicitações de transferências consiste em cancelar/desistir da operação realizada. O cancelamento poderá ser solicitado pelo Participante de Registro somente na mesma data do Registro da solicitação e poderá ser realizado apenas via tela antes da aprovação da B3.

O Participante poderá realizar a solicitação através do menu: “CCP > Operações > Lançamentos > Cessão/Transferência de Contratos – Manutenção” selecionando a opção CANCELAMENTO no combo box Tipo Serviço.

**Tela de Manutenção – Cessão/Transferência de Contratos**




| Campo | Descrição |
|---|---|
| Tipo Serviço | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Campo com as opções Consulta e Cancelamento |
| Tipo de Operação | Campo de preenchimento obrigatório.<br>O participante deverá informar o tipo da operação: Cessão ou Transferência |
| Parte Registradora – Origem | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta Registradora do Participante do contrato de Origem |
| Parte (Conta) - Origem | Campo Opcional<br>Conta do cliente do contrato de Origem |
| PR – Origem | Campo Opcional<br>Código de Registro do Participante do contrato de Origem |
| Conta SINCAD – Origem | Campo Opcional<br>Código da conta SINCAD do cliente do contrato de Origem |
| Parte Registradora – Destino | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta Registradora do Participante do contrato de Destino |
| Parte (Conta) – Destino | Campo Opcional<br>Conta do cliente do contrato de Destino |
| PR – Destino | Campo Opcional<br>Código de Registro do Participante do contrato de Destino |

| | |
|---|---|
| Conta SINCAD – Destino | Campo Opcional<br>Código da conta SINCAD do cliente do contrato de Destino |
| Código do Contrato | Campo Opcional<br>Informa o Código do contrato que sofrerá a operação |

Ao clicar em “Pesquisar” o Participante poderá consultar todas as operações realizadas por ele na data e que não possuem a aprovação da B3.

O Participante irá visualizar todas as solicitações realizadas no dia e poderá selecionar os contratos que deseja cancelar a operação clicando no botão >>, então ele(s) será(ão) movimentado(s) para a caixa de opções “Contratos Selecionados”, podendo realizar o movimento inverso entre as caixas de seleção clicando no botão <<.

Após clicar em “Confirmar” as solicitações de transferências serão canceladas.

### Consulta de Transferência

O Participante poderá consultar todas as solicitações de transferências realizadas por ele na data. Para isso ocorrer, o Participante de Registro deverá acessar por meio do menu: “CCP > Operações > Lançamentos > Cessão/Transferência de Contratos – Manutenção” selecionando a opção CONSULTA no combo box Tipo Serviço.

## 3.10 Cessão de Direito

**Menu CCP > Operações > Lançamentos > Cessão/Transferência de Contratos**

A cessão de direito representa a transferência de determinada operação de um Participante de Registro para outro Participante de Registro mediante pagamento de valor acordado entre as partes válida para os contratos de Derivativos de Balcão em que envolva troca de financeira entre as partes, mediante análise da B3.

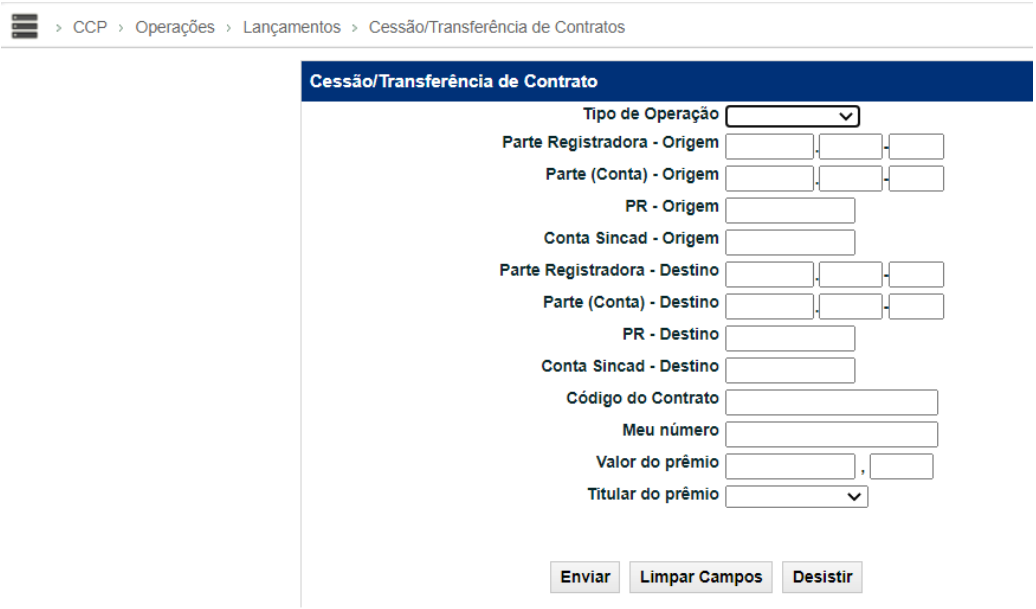
O Participante de Registro deverá realizar a solicitação de cessão de Direito via sistema NoMe identificando os dados da operação. Após o lançamento deverá entrar em contato com a Diretoria de Depositária e Operações de Balcão da B3 através do e-mail: op.derivativosbalcao@b3.com.br, informando sobre a cessão de Direito bem como sua justificativa.

Fica a critério da B3 analisar pedidos de cessão de Direito em caráter de exceção que não sejam sistêmicos (mediante envio de carta com o de acordo dos representantes que possuem outorga perante a instituição).

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

As solicitações devem ser realizadas **até 12hr** (pedidos recebidos após esse horário estão sujeitos à análise e realização somente no dia útil posterior, sendo necessário uma nova solicitação).

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




### Descrição dos Campos da Tela Transferência de Contrato

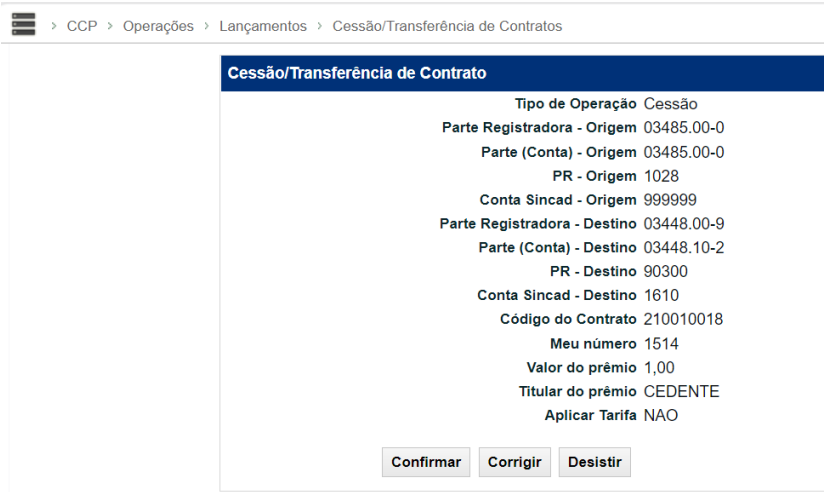
| Campo | Descrição |
|---|---|
| Tipo de Operação | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Campo com as opções Cessão e Transferência |
| Parte Registradora – Origem | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta Registradora do Participante do contrato de Origem |
| Parte (Conta) - Origem | Campo Opcional<br>Conta do cliente do contrato de Origem |
| PR – Origem | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Código de Registro do Participante do contrato de Origem |
| Conta SINCAD – Origem | Campo Opcional<br>Código da conta SINCAD do cliente do contrato de Origem |
| Parte Registradora – Destino | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta Registradora do Participante do contrato de Destino |
| Parte (Conta) – Destino | Campo Opcional<br>Conta do cliente do contrato de Destino |
| PR – Destino | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Código de Registro do Participante do contrato de Destino |
| Conta SINCAD – Destino | Campo Opcional<br>Código da conta SINCAD do cliente do contrato de Destino |

| | |
|---|---|
| Código do Contrato | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Informa o Código do contrato que sofrerá a operação |
| Meu Número | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Número atribuído à operação de exclusão de contratos.<br>Número interno de cada Participante, identificando o lançamento |
| Valor do Prêmio | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Esse campo indica o valor do prêmio a ser pago Adquirente ou Cedente |
| Titular do Prêmio | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Campo indicando quem será o titular do prêmio: Adquirente ou Cedente<br>A parte informada como titular do prêmio terá o valor do prêmio debitado na liquidação do mesmo. Por consequência a outra parte envolvida na Cessão terá o valor do prêmio da cessão creditado na liquidação do mesmo. |

Após o preenchimento dos campos obrigatórios da tela, o Participante de Registro deve clicar no botão “Enviar” para seguir com a solicitação, poderá, ainda, limpar os campos preenchidos em tela ou desistir da operação. A operação está sujeita a tarifação conforme política da B3.

Em operações de Comando Simples, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante de Registro pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que a solicitação está aguardando análise da B3.

**Tela de Confirmação**




Em operações de Duplo Comando, ao clicar no botão Confirmar, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o sistema está aguardando lançamento do Destino e posterior análise da B3.

A confirmação do Participante de Destino pode ser feita de duas maneiras: pela própria tela de solicitação de transferência ou pela funcionalidade: “Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes”.

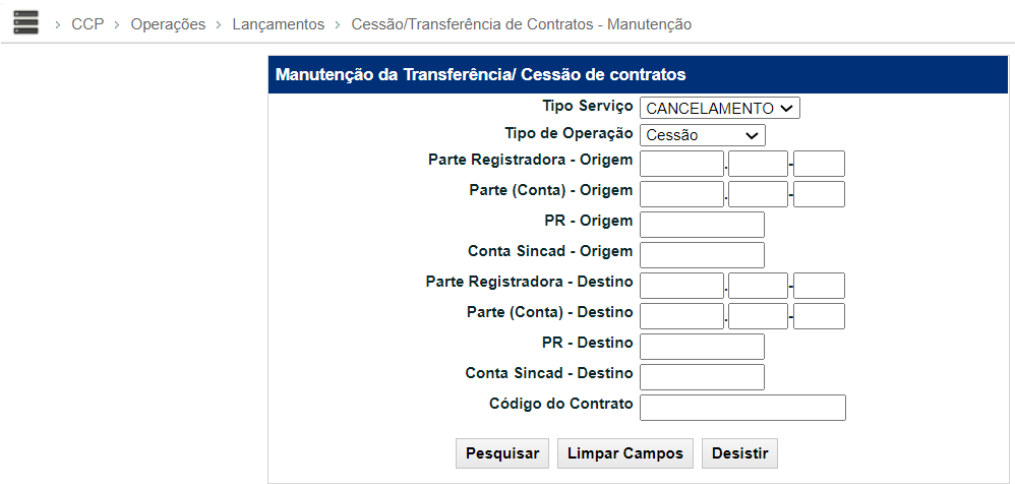
Somente após o confronto automático das informações e aprovação da B3 o sistema gera o número de identificação da Operação. Caso a operação não seja confirmada até o horário de encerramento, o sistema descartará essa ação ao final do dia.

### Cancelamento de Cessão de Direito

O cancelamento das solicitações de cessão consiste em cancelar/desistir da operação realizada. O cancelamento poderá ser solicitado pelo Participante de Registro somente na mesma data do Registro da solicitação e poderá ser realizado apenas via tela antes da aprovação da B3.

O Participante poderá realizar a solicitação através do menu: “CCP > Operações > Lançamentos > Cessão/Transferência de Contratos – Manutenção” selecionando a opção CANCELAMENTO no combo box Tipo Serviço.

**Tela de Manutenção – Cessão/Transferência de Contratos**




| Campo | Descrição |
|---|---|
| Tipo Serviço | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Campo com as opções Consulta e Cancelamento |
| Tipo de Operação | Campo de preenchimento obrigatório.<br>O participante deverá informar o tipo da operação: Cessão ou Transferência |
| Parte Registradora – Origem | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta Registradora do Participante do contrato de Origem |
| Parte (Conta) - Origem | Campo Opcional<br>Conta do cliente do contrato de Origem |
| PR – Origem | Campo Opcional<br>Código de Registro do Participante do contrato de Origem |
| Conta SINCAD – Origem | Campo Opcional<br>Código da conta SINCAD do cliente do contrato de Origem |
| Parte Registradora – Destino | Campo de preenchimento obrigatório.<br>Conta Registradora do Participante do contrato de Destino |

| | |
|---|---|
| Parte (Conta) – Destino | Campo Opcional<br>Conta do cliente do contrato de Destino |
| PR – Destino | Campo Opcional<br>Código de Registro do Participante do contrato de Destino |
| Conta SINCAD – Destino | Campo Opcional<br>Código da conta SINCAD do cliente do contrato de Destino |
| Código do Contrato | Campo Opcional<br>Informa o Código do contrato que sofrerá a operação |

Ao clicar em "Pesquisar" o Participante poderá consultar todas as operações realizadas por ele na data e que não possuem a aprovação da B3.

O Participante irá visualizar todas as solicitações realizadas no dia e poderá selecionar os contratos que deseja cancelar a operação clicando no botão >>, então ele(s) será(ão) movimentado(s) para a caixa de opções "Contratos Selecionados", podendo realizar o movimento inverso entre as caixas de seleção clicando no botão <<.

Após clicar em "Confirmar" as solicitações de transferências serão canceladas.

### Consulta de Cessão de Direito

O Participante poderá consultar todas as solicitações de cessão de direito realizadas por ele na data. Para isso ocorrer, o Participante de Registro deverá acessar por meio do menu: "CCP > Operações > Lançamentos > Cessão/Transferência de Contratos – Manutenção" selecionando a opção CONSULTA no combo box Tipo Serviço.

## 3.11 Brokeragem

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

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

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

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

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

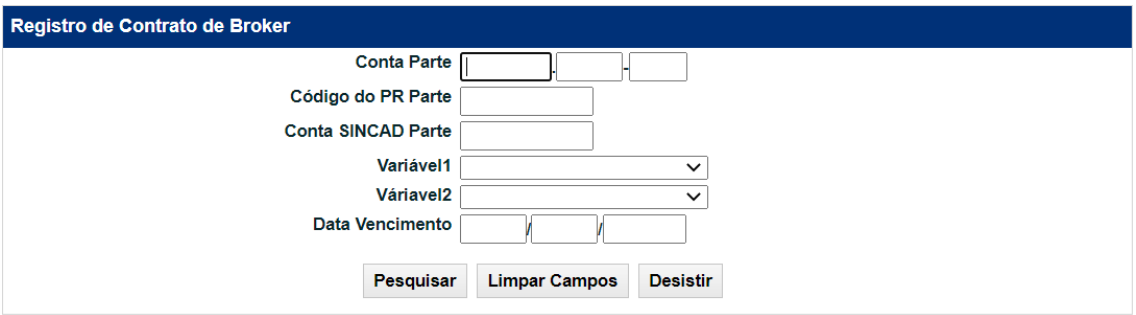
O acesso à função de *brokeragem* será através do arquivo txt (leiaute disponível no site da B3):

### Inclusão de Brokeragem

**CCP > Contrato de Swap > Lançamentos > Registro de Contrato de Broker**

Esta função permite ao Participante selecionar os contratos de derivativos de SWAP com CCP que fazem parte da operação de Brokeragem.

**Tela de filtro**




Após o preenchimento dos campos obrigatórios da tela, o Participante de Registro deve clicar no botão “Pesquisar”.

**Tela de inclusão do Broker**

Para a inclusão do Broker selecionar os contratos que o irão compor, na Variável 1 e Variável 2, conforme informadas no filtro e apresentadas na parte superior desta tela.

Na seção “Variável 1‘”, “marcar” um ou mais contratos da lista “Contratos Disponíveis” e clicar no botão >>, então ele(s) será(ão) movimentado(s) para a caixa de opções “Contratos Selecionados”. Repetir o procedimento para a seção “Variável 2”.

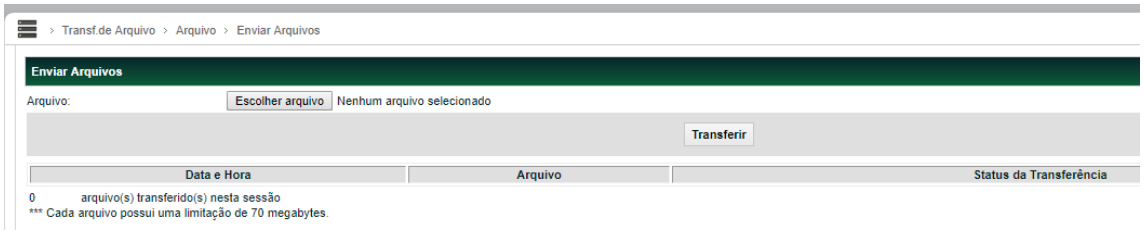
Enquanto o Broker não tiver sido confirmado, para excluir contratos selecionados das variáveis do broker, em “Contratos Selecionados”, “marcar” um ou mais contratos que deseja excluir e clicar no botão <<.

**Por arquivo**

Transferência de Arquivo > Arquivo > Enviar Arquivo

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

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



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

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

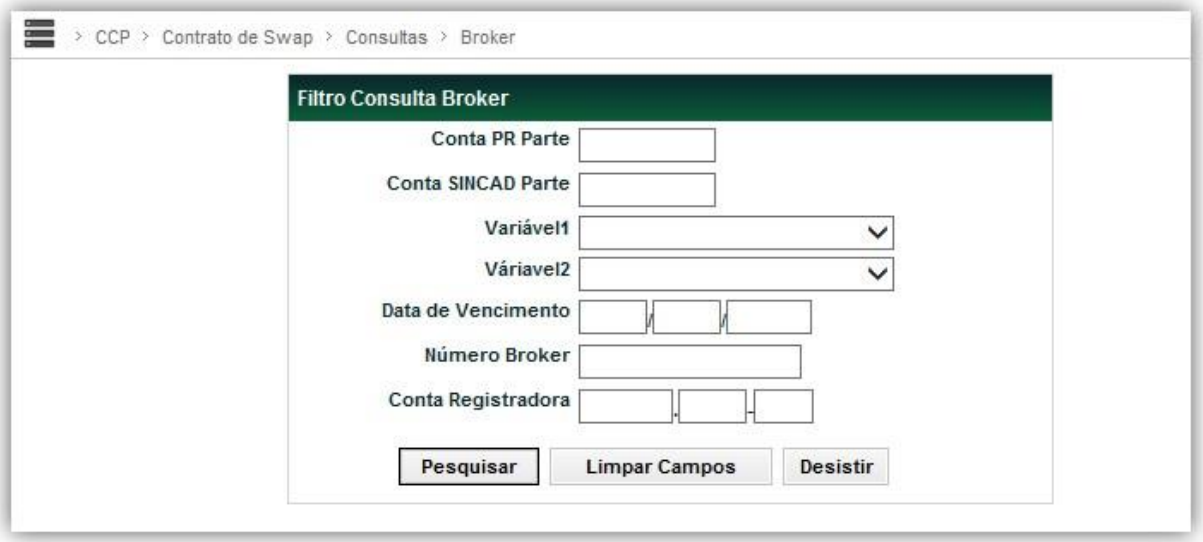
### Anulação de Brokeragem

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

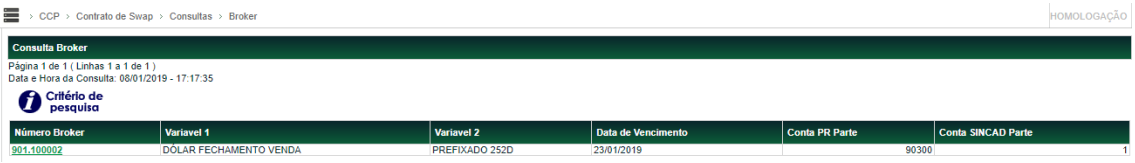
Após o preenchimento da informação o sistema irá realizar a operação solicitada.
Antes de realizar a anulação de um Registro que foi brokerado, é necessário a anulação da brokeragem.

### Consulta de Brokeragem

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




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




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

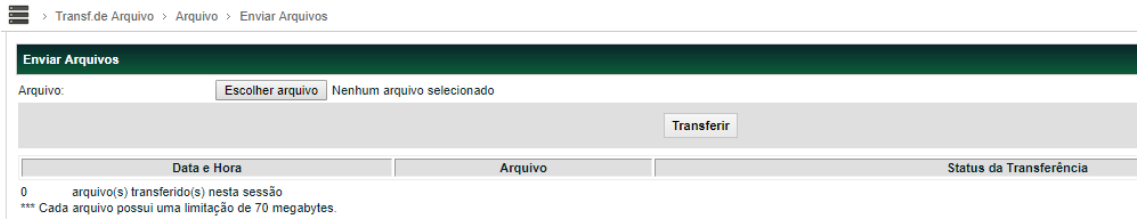
## 3.12 Registro e operações por arquivo

### Enviar arquivo

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

Transferência de Arquivo > Arquivo > Enviar Arquivo

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




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

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

### Solicitação de transferência de arquivo

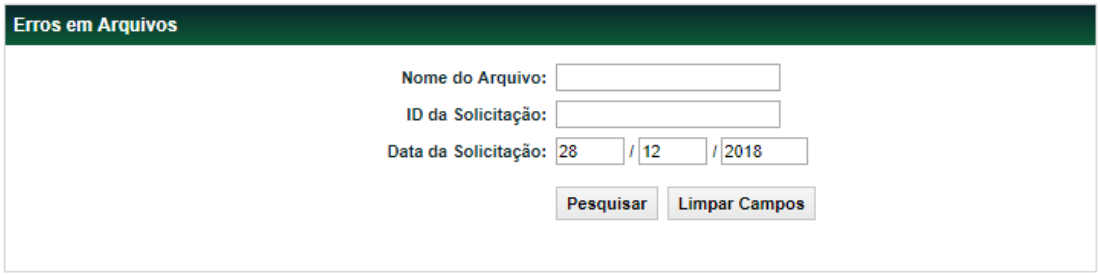
Após fazer o upload do arquivo é possível consultar se essa solicitação foi processada pelo menu Transferência de Arquivo > Arquivo > Solicitações de Transferência.

**Tela de Filtro**

### Erros em Arquivo

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

**Tela de Filtro**




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

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

# 4 CONSULTA

## 4.1 Características de Contratos de Swap

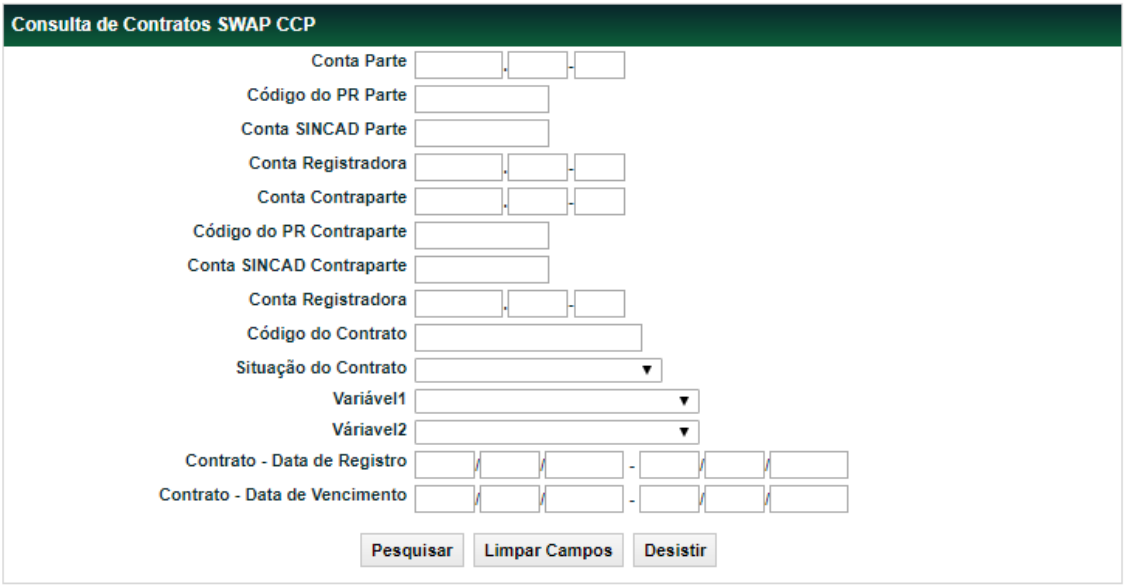
Menu CCP > Contrato de Swap > Consultas > Características de Contrato de Swap

### Visão Geral

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

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

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




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

**Tela de Relação**

Consulta de Contratos SWAP CCP

Página 1 de 7 ( Linhas 1 a 25 de 174 )
Data e Hora da Consulta: 28/12/2018 - 13:32:10

Critério de pesquisa

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

(continua)

| CPF/CNPJ Cliente Parte | Nome Simplificado (Parte) | Garantia Parte | Taxa Operacional | Valor Operacional | Nº de Controle do PR | Ponta | Percentual do indexador | Indexador | Data Atualizacao | PU Inicial | PU Atual | Fator de Juros | Fator de Correção | Valor Juros | Diferença Juros |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | BALCAOBM | COM | | | TESTEFERIADO | P1 | 100,00 | PREFIXADO 252D | 28/12/2018 | | | 1,000756716 | 1,00000000 | 75,67 | 26,43 |

(continua)

| | | | | | CONTRAPARTE | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Valor Amortização | Diferença Amortização | Valor da Curva Atualizado | Diferença da Curva | | Conta Registradora | Contraparte | Código do PR Contraparte | Conta SINCAD Contraparte | CPF/CNPJ Cliente Contraparte | Nome Simplificado (Contraparte) | Garantia Contraparte | Taxa Operacional | Valor Operacional | Nº de Controle do PR | Ponta | Percentual do indexador |
| 0,00 | 0,00 | 100.075,67 | 26,43 | | 03448.00-9 | 03448.10-2 | 90300 | 4 | 44.753.867/0001-93 | BALCAOBM | COM | | | TESTEFERIADO | P2 | 100,00 |

(continua)

| Indexador | Data Atualização | PU Inicial | PU Atual | Fator de Juros | Fator de Correção | Valor Juros | Diferença Juros | Valor Amortização | Diferença Amortização | Valor da Curva Atualizado | Diferença da Curva |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DI | 28/12/2018 | | | 1,000492460 | 1,00000000 | 49,24 | -26,43 | 0,00 | 0,00 | 100.049,24 | -26,43 |

(fim)

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

## Descrição dos Campos da Tela de Relação

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

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

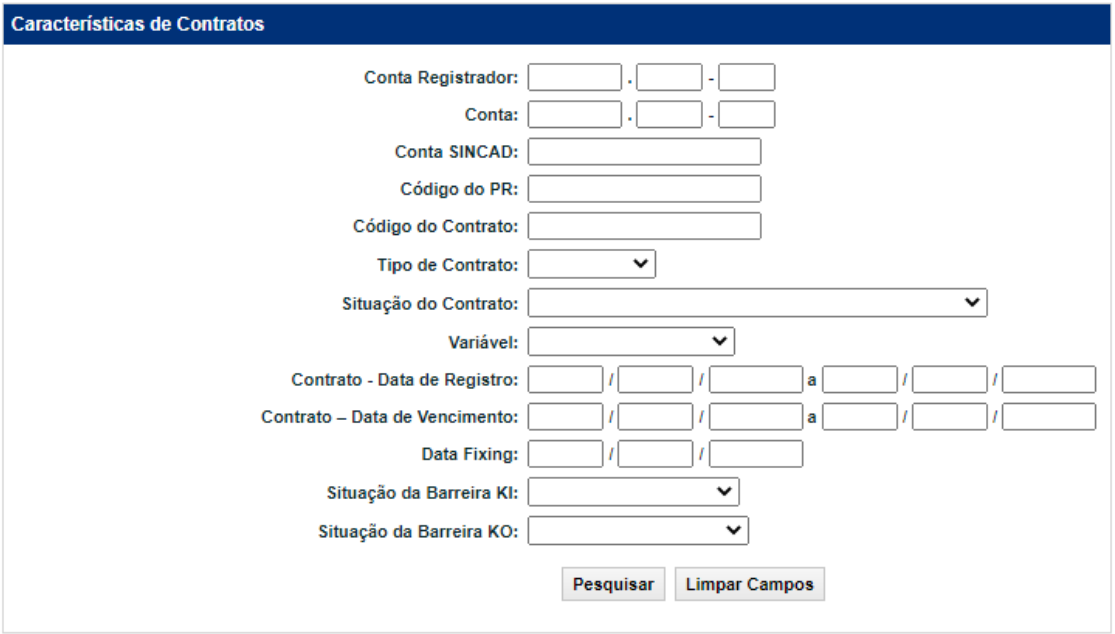
| | |
|---|---|
| Dt Atualização (Contraparte) | Data para a qual a curva se encontra atualizada. |
| PU Inicial (Contraparte) | Preço unitário inicial informado pelo Participante de Registro no Registro do contrato. |
| PU Atual (Contraparte) | Preço unitário atual informado pelo Participante de Registro no período de vigência do contrato. |
| Fator de Juros (Contraparte) | Fator de juros calculado a partir das características informadas no Registro do contrato. |
| Fator de Correção (Contraparte) | Fator de correção calculado a partir das características informadas no Registro do contrato. |
| Valor Juros (Contraparte) | Valor de juros calculado a partir do fator de juros. (valor informativo, sem financeiro) |
| Diferença Juros (Contraparte) | Diferença entre o valor de juros da parte e o valor de juros da contraparte. |
| Valor Amortização (Contraparte) | Valor meramente contábil e informativo, não gera financeiro. Este é gerado pela informação do campo “Diferença de amortização”. |
| Diferença Amortização (Contraparte) | Diferença entre o valor de amortização da parte e o valor de amortização da contraparte. |
| Valor da Curva Atualizado (Contraparte) | Valor da curva Atualizado calculado através da multiplicação do valor base inicial ou remanescente, fator de juros e fator de correção. (Valor informativo, sem financeiro). |
| Diferença da Curva (Contraparte) | Diferença entre o valor da curva atualizado da parte e o valor da curva atualizado da contraparte. (Valor informativo, sem financeiro). |

## 4.2 Características de Contratos de Opção

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

### Visão Geral

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




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

### Tela de Relação

Características de Contratos

Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 1 de 1 )
Data e Hora da Consulta: 10/05/2022 - 10:45:31

Critério de pesquisa

| Instrumento Financeiro | Tipo do Contrato | Tipo da Opção | Lançador (Nome Simplificado) | Lançador (Parte Registradora) | Lançador (Código do PR) | Lançador (Conta SINCAD Parte) | Lançador (CPF/CNPJ Lançador) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 220092622 | COMPRA | FCA | BALCAOBM | 03448.00-9 | 90300 | 1609 | 258.215.235-83 |

1 Exibir página

Obter no formato: Excel

(continua)

| Lançador (Nº de Controle do PR) | Titular (Nome Simplificado) | Titular (Contraparte Registradora) | Titular (Código do PR) | Titular (Conta SINCAD Contraparte) | Titular (CPF/CNPJ Titular) | Titular (Nº de Controle do PR) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| ---- | BALCAOBM | 03448.00-9 | 90300 | 1116 | 014.807.357-36 | ---- |

(continua)

| Data de Registro | Data de Vencimento | Tipo de Preço | Data Fixing | Valor Base/Quantidade | Valor Base/Quantidade Atual | Boletim Opção | Prêmio Unitário | Data de Pagamento do Prêmio | Preço Exercício | Tipo Opção |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 09/05/2022 | 30/05/2022 | ULTIMO | 27/05/2022 | 500,00 | 500,00 | Fechamento | 15,00 | 10/05/2022 | 1.337,00 | EUROPEIA |

(continua)

| Rebate Unitário | N Dias Apuração | Barreira KI | Data Barreira KI | Valor Barreira KI | Situação Barreira KI | Barreira KO | Data Barreira KO | Valor Barreira KO | Situação Barreira KO | Limitador | Monitoramento de |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 150,5555558 | 1,00 | ID - KNOCK IN AND DOWN | ---- | 1.300,00 | KI NÃO ATINGIDO | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | DISCRETO |

(continua)

| Barreira KO | Valor Barreira KO | Situação Barreira KO | Limitador | Monitoramento de Barreiras | Tipo Indicador | Variável | Situação | Data da Antecipação | Fator Limitador | Fator Barreira KI | Fator Barreira KO |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ---- | ---- | ---- | ---- | DISCRETO | AÇÕES | VALE3 | CONTRATO EM ABERTO | ---- | ---- | 0,972326103216156 | ---- |

(fim)

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

**Descrição dos Campos da Tela de Relação**

| Campo | Descrição |
|---|---|
| Instrumento Financeiro | Código do contrato pesquisado. |
| Tipo do Contrato | Tipo de contrato utilizado na operação de Swap com CCP. |
| Tipo de Opção | **Americana:** opções que podem ser exercidas a qualquer tempo até a data de exercício.<br>**Europeia:** opções que só podem ser exercidas na data de exercício.<br>Este tipo de exercício não pode ser informado para contrato com Média Asiática |
| Lançador (Nome Simplificado) | Nome simplificado do Participante de Registro. |
| Lançador (Parte Registradora) | Conta Registradora do Participante de Registro da Parte do contrato. |
| Lançador (Código do PR) | Código do Participante de Registro que está acessando o sistema e, consequentemente, consultando o contrato. |
| Lançador (Conta SINCAD Parte) | Código da Conta SINCAD do cliente de quem está consultando o contrato. |
| Lançador (CPF/CNPJ Lançador) | CPF/CNPJ do Lançador do contrato. |
| Lançador (N de Controle do PR) | Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato. |
| Titular (Nome Simplificado) | Nome simplificado do Participante de Registro. |
| Titular (Contraparte Registradora) | Conta Registradora do Participante de Registro da Contraparte do contrato. |
| Titular (Código do PR) | Código do Participante de Registro que está acessando o sistema e, consequentemente, consultando o contrato. |
| Titular (Conta SINCAD Contraparte) | Código da conta SINCAD do cliente de quem está consultando o contrato. |
| Titular (CPF/CNPJ Titular) | CPF/CNPJ do Titular do contrato. |
| Titular (Nº de Controle do PR) | Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato. |
| Dt. de Registro | Data de Registro do contrato pesquisado. |
| Dt. Vencimento | Data de vencimento do contrato. |
| Tipo de Preço | Indica o tipo de preço da Opção Flexível, conforme especificação da Tabela Auxiliar. Opções: Último Médio |
| Data Fixing | Data de observação do preço da variável, conforme especificação da Tabela Auxiliar. Opções: T-0 T-1 T-2 |
| Valor Base/Quantidade | Quantidade da opção a ser negociada. |
| Valo Base/Quantidade Atual | Quantidade da opção negociada ainda vigente em contrato. |
| Boletim Opção | Boletim utilizado para cotação da Opção |
| Prêmio Unitário | Prêmio unitário acordado entre as partes |
| Date de Pagamento do Prêmio | Indica a data de liquidação financeira do prêmio, nos contratos com garantia a data do pagamento sempre será D+1 do registro |
| Preço Exercício | Preço do ativo subjacente definido entre Titular e Lançador para o exercício da opção. |
| Tipo de Opção | Indica o tipo de Opção Flexível com CCP. |

| | |
|---|---|
| Rebate Unitário | Campo de preenchimento obrigatório somente quando escolhida opção de Registro, no campo Rebate.<br>Define o valor unitário da devolução do prêmio ao titular do contrato, caso não ocorra o disparo do parâmetro do trigger (Knock In), ou ocorra o disparo do parâmetro do trigger (Knock Out), até a data de vencimento do contrato. O valor pode ser maior, igual ou menor que o prêmio pago no registro. |
| N Dias Apuração | Caso o tipo preço seja "médio", este campo indica o número de verificações de preço para apuração no vencimento ou Antecipação, a contar da Data de Fixing. |
| Barreira KI | a condição previamente estabelecida pelas partes da opção para que a operação produza efeitos; in-and-up (IU): quando a taxa, o preço, o valor ou a cotação vigente na data de negociação, está abaixo do valor da barreira;<br>in-and-down (ID): quando a taxa, o preço, o valor ou a cotação, vigente na data de negociação, está acima do valor da barreira; |
| Valor Barreira KI | Indica o valor da barreira Knock In |
| Situação Barreira KI | Status da Barreira (KO Atingido ou Não Atingido). |
| Barreira KO | a condição previamente estabelecida entre as partes da opção, mediante pagamento de prêmio, para que a operação seja rescindida, disponibilizada para Registro, nos seguintes tipos: i. out-and-up (OU): quando a taxa, o preço, o valor ou a cotação, vigente na data de negociação, está abaixo do valor da barreira; ii. out-and-down (OD): quando a taxa, o preço, o valor ou a cotação, vigente na data de negociação, está acima do valor da barreira. |
| Valor Barreira KO | Indica o valor da barreira Knock Out |
| Situação Barreira KO | Status da Barreira (KO Atingido ou Não Atingido). |
| Limitador | limitador de alta – a taxa, o preço ou a cotação, previamente estabelecido(a) pelas partes de opção de compra, a ser utilizado(a) no cálculo do valor de exercício quando a taxa, o preço ou a cotação de referência ("fixing") vigente na ocasião do exercício da opção for superior a ele(a); e b) limitador de baixa - a taxa, o preço ou a cotação, previamente pactuado(a) pelas partes de opção de venda, a ser utilizado(a) no cálculo do valor de exercício quando a taxa, o preço ou a cotação de referência ("fixing") vigente na ocasião do exercício da opção for inferior a ele(a); |
| Monitoramento de Barreiras | Indica o modo como será o monitoramento das barreiras.<br>Apenas para Ações, Índices e ETFs as opções Discreta e Contínua estão disponíveis. |
| Tipo de Indicador | Informar o tipo de indicador: PARIDADE, AÇÕES NACIONAIS, BDR ÍNDICES, ÍNDICES INTERNACIONAIS OU MERCADORIA. |
| Variável | Indica os tipos de Variável relacionados ao "Tipo Indicador" selecionado na primeira tela de registro. Combo box |
| Situação Contrato | Indica a situação em que se encontra o contrato a ser pesquisado.<br>Opções: anulado, aprovado, cancelado, contrato em aberto, contrato exercido, contrato não exercido, knock out sem rebate, liquidado por exercício antecipado, liquidado por rebate e opção vencida. |
| Data da Antecipação | Data da Antecipação do contrato. |
| Fator Limitador | Indica o valor do fator de proporção entre o preço de exercício e o Limitador armazenado no contrato na data de registro |
| Fator Barreira KI | Indica o valor do fator de proporção entre o preço de exercício e a Barreira KI armazenado no contrato na data de registro |

| | |
|---|---|
| Fator Barreira KO | Indica o valor do fator de proporção entre o preço de exercício e a Barreira KO armazenado no contrato na data de registro |

### 4.3 Características de Contratos de Termo com CCP

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

**Visão Geral**

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

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

**Tela de Relação**

Consulta Contratos

Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 11 de 11 )

Data e Hora da Consulta: 02/05/2018 - 11:01:07

Critério de pesquisa

| Código do Contrato | Tipo Inst. Financeiro | Comprador (Nome Simplificado) | Comprador (Conta Registradora) | Comprador (Conta) | Comprador (Código PR) | Comprador (Conta SINCAD) | CPF/CNPJ Comprador | Comprador (Nº de Controle do PR) | Vendedor (Nome Simplificado) | Vendedor (Conta Registradora) | Vendedor (Conta) | Vendedor (Código PR) | Vendedor (Conta SINCAD) | CPF/CNPJ Vendedor | Vendedor (Nº de Controle do PR) | Data de Registro | Data de Vencimento | Saldo (R$) | Situação |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 180500013 | TERMO DE MOEDA CCP | JONATHANBM | 03219.00-1 | 03219.00-1 | 510 | 530 | | EEE | JONATHANBM | 03219.00-1 | 03219.10-4 | 510 | 511 | 987.654.321-00 | EEE | 02/05/2018 | 07/05/2018 | 0,00 | APROVADO |

(continua)

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

(fim)

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

**Descrição dos Campos da Tela Relação**

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

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

## 4.4 Manutenção de Operações Pendentes

Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes

### Visão Geral

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

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

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

**Tela de Relação**

Manutenção de Operações Pendentes
Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 1 de 1 )
Data e Hora da Consulta: 04/01/2019 - 11:18:16
Critério de pesquisa

| Ação | Parte (Conta) | Contraparte (Conta) | Tipo de Instrumento Financeiro | Código IF | Número CETIP | Meu número | Tipo de Operação | Ponta na Operação | Situação | Modalidade | Rentabilidade/Indexador/Taxa Flutuante | % da Taxa Flutuante | Taxa de Juros/Spread |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 03454.00-0 | 05000.00-5 | TCCP | 190100002 | 2019010417673764 | 7875 | REGISTRO | COMPRADOR | PENDENTE DE LANCAMENTO: CONTRAPARTE | SEM MODALIDADE CCP | | | |

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

Operações › Lançamentos › Manutenção de Operações Pendentes
Manutenção de Operação Pendente
Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 1 de 1 )
Data e Hora da Consulta: 04/01/2019 - 11:20:50
Critério de pesquisa

| Ação | Parte (Conta) | Contraparte (Conta) | Tipo de Instrumento Financeiro | Código IF | Número CETIP | Meu número | Tipo de Operação | Ponta na Operação | Situaçã |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 03454.00-0 | 05000.00-5 | TCCP | 190100002 | 2019010417673764 | 7875 | REGISTRO | COMPRADOR | PENDEN |

CANCELAR
DETALHAR
Atualizar Voltar

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

Operações › Lançamentos › Manutenção de Operações Pendentes
Manutenção de Operação Pendente
Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 1 de 1 )
Data e Hora da Consulta: 04/01/2019 - 12:08:36
Critério de pesquisa

| Ação | Parte (Conta) | Contraparte (Conta) | Tipo de Instrumento Financeiro | Código IF | Número CETIP | Meu número | Tipo de Operação | Ponta na Operação | Situaçã |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 05000.00-5 | 03454.00-0 | TCCP | 190100002 | 2019010417673764 | | REGISTRO | VENDEDOR | PENDEN |

CONFIRMAR
DETALHAR
Atualizar Voltar
1 Exibir página

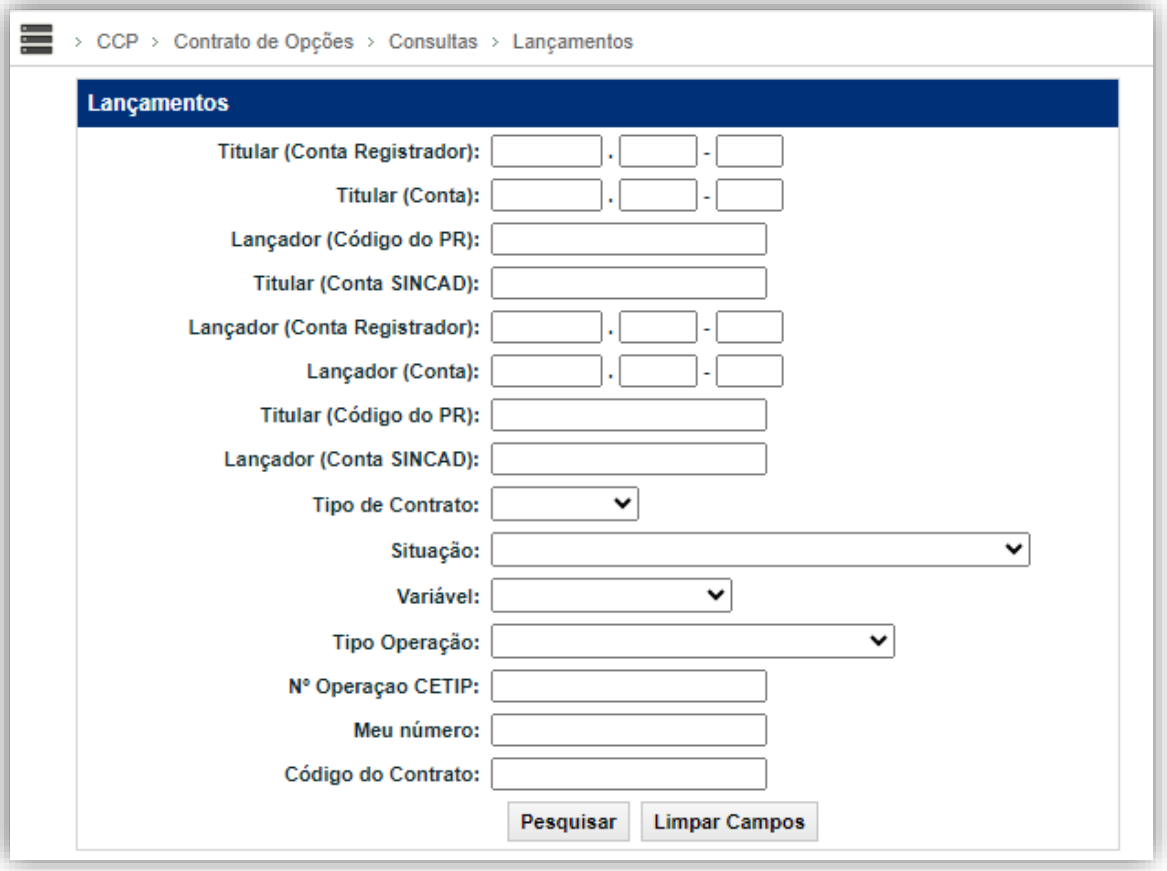
## 4.5 Consulta lançamentos de Opção Flexível com CCP

CCP > Contrato de Opções > Consultas > Lançamentos

### Visão Geral

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

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




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

## Tela de Relação

| Nº Operação CETIP | Conta Registradora-Titular | Conta-Titular | Conta SINCAD-Titular | Código do PR-Titular | CPF/CNPJ-Titular | Membro de Compensação-Titular | Taxa Operacional-Titular | Valor-Titular | Nº Controle do PR-Titular | Conta Repasse-Titular |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 202401020247577 6 | 28860.00-2 | ---- | ---- | 27 | ---- | COMPENSADOR DO TITULAR | ---- | ---- | ---- | ---- |

(continua)

| Contraparte Registradora-Lançador | Conta-Lançador | Conta SINCAD-Lançador | Código do PR-Lançador | CPF/CNPJ-Lançador | Membro de Compensação-Lançador | Taxa Operacional-Lançador | Valor-Lançador | Nº Controle do PR-Lançador | Conta Repasse-Lançador |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 28824.00-0 | 28824.10-3 | 2.464.246 | 3 | 41053392618 | COMPENSADOR DO LANCADOR | ---- | ---- | ---- | ---- |

(continua)

| Tipo Operação | Tipo de Contrato | Código de Contrato | Situação | Modalidade de Liquidação | Meu Número | Tipo Indicador | Data Início | Data Vencimento | Data de Liquidação | Variável | Quantidade | Código Confirmação Lançamento Pendente |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| REGISTRO CONTRATO OPCAO | COMPRA | ---- | PENDENTE DE LANCAMENTO: TITULAR | SEM MODALIDADE CCP | 45347 | ACOES | 02/01/2024 | 31/01/2024 | 01/02/2024 | ABEV3 | 200,00 | ---- |

(continua)

| Preço de Exercício-Venda | Preço de Exercício-Compra | Data Liquidação do Exercício | Tipo Preço | Nº Dias de Apuração | Tipo Opção | Data Fixing | Limitador-Venda | Limitador-Compra | Prêmio Unitário-Venda | Prêmio Unitário-Compra | Data de Pagamento do Prêmio |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ---- | 60,00 | D+1 | U | 1 | EUROPEIA | D-1 | ---- | 130,00 | ---- | 2,00 | 03/01/2024 |

(continua)

| Valor do Prêmio | ID - Knock In and Down | IU - Knock In and UP | OD - Knock Out and Down | OU - Knock Out and UP | Tipo de Rebate | Rebate Unitário | Data de Liquidação do Rebate | Monitoramento de Barreiras | Boletim | Proteção contra Proventos |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 400,00 | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | ---- | Fechamento | SIM |

(fim)

**Descrição dos campos da Tela de Relação**

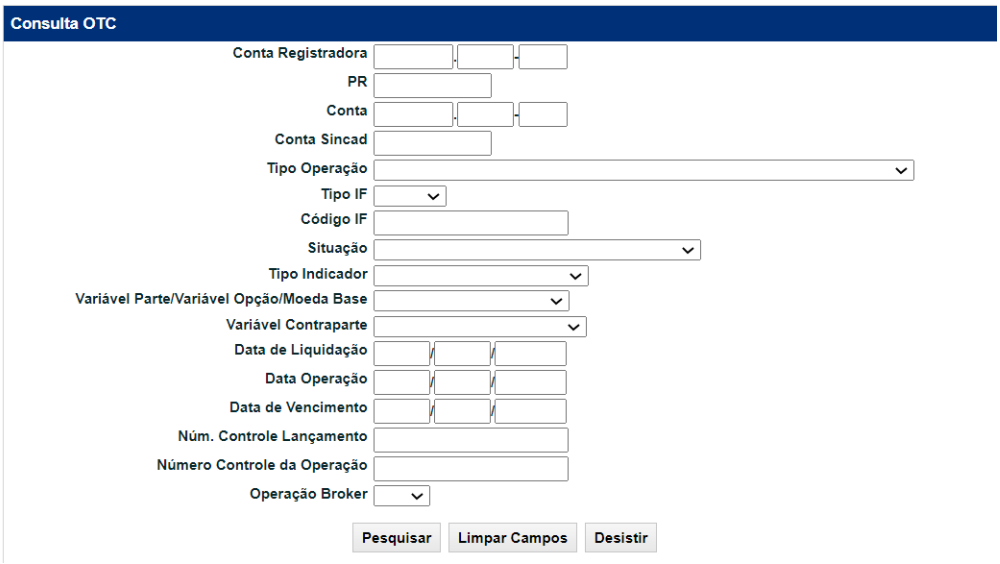
| Campo | Descrição |
|---|---|
| Nº Operação *CETIP* | Número atribuído pelo Participante de Registro para aquele contrato |
| **TITULAR** | |
| Conta Registradora-Titular | Conta do Participante do Titular do contrato. |
| Conta-Titular | Conta de Registro da Titular do contrato. |
| Conta SINCAD-Titular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

## 4.6 Consultas e relatórios

### Consulta OTC

CCP > Consultas e relatórios > Consulta OTC

### Visão Geral

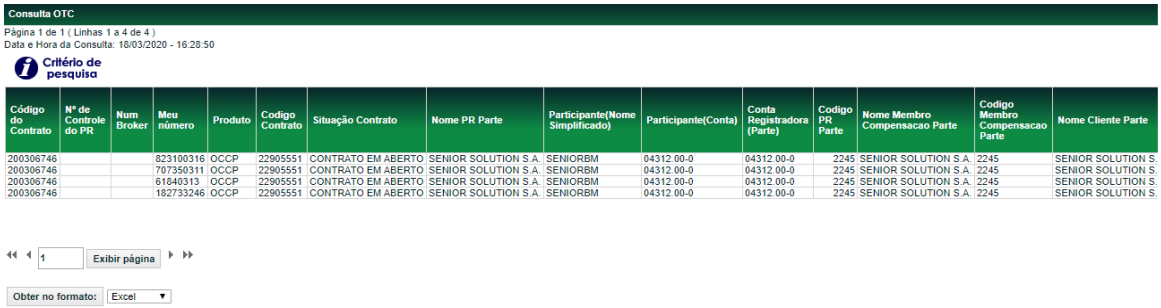



Após a consulta, o sistema trará até 500 resultados das operações encontradas de acordo com os filtros selecionados e oferece a possibilidade de extração de arquivo .csv.

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

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

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




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

### Descrição dos campos da Tela de Relação

| Campo | Descrição |
|---|---|
| Código do Contrato | Código do contrato pesquisado. |
| Nº Controle do PR | Campo de uso livre do Participante para informar um número de controle interno da operação na instituição. |
| Num Broker | Número gerado ao realizar a brokeragem da operação. |
| Meu número | Número interno de identificação do lançamento. Com até 10 dígitos |
| Produto | apresenta o nome do produto pendente de lançamento; |
| Código Contrato | Código referente ao contrato |
| Situação Contrato | Indica a situação em que se encontra o contrato a ser pesquisado.<br>(Pendente de lançamento - Lançador ou Titular). |
| Nome PR Parte | Nome do Participante |
| Participante (Nome Simplificado) | Nome simplificado do Participante de Registro. |
| Participante (Conta) | Conta Registradora do Participante de Registro parte do contrato. |
| Conta Registradora (Parte) | Indica o número da conta própria ou do cliente que é Parte na operação. |
| Código PR Parte | Indica o código no sistema de cadastro B3 do Participante de Registro "Parte" da Operação |
| Nome Membro Compensação Parte | Nome do Membro de Compensação da Parte |
| Código Membro Compensação Parte | Indica o código do Membro de Compensação do Participante de Registro "Parte" da operação, informado no sistema SINCAD. Preenchido default. |
| Nome Cliente Parte | Nome do cliente a ser informado pela Parte |

## Mov-Balcão

**CCP > Consultas e relatórios > Mov-Balcão**

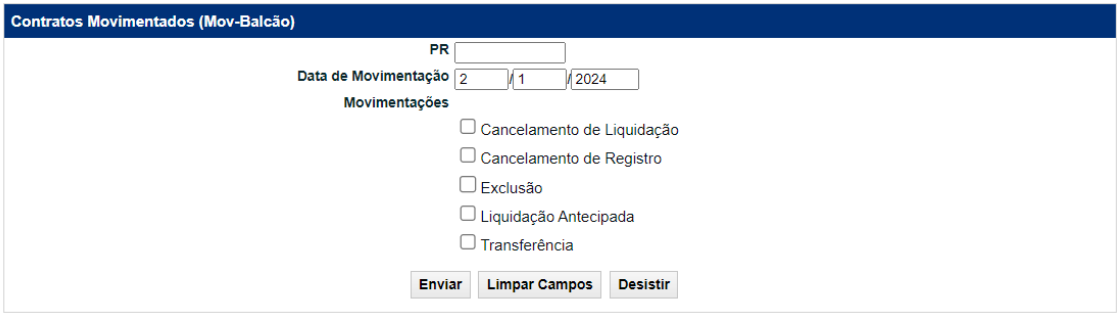
### Visão Geral

O arquivo MovBalcão tem por objetivo disponibilizar as movimentações realizadas pelo Participante de Registro, conforme data solicitada. Por meio dessa tela é possível solicitar o arquivo MovBalcão a qualquer momento, durante o horário de funcionamento do sistema.

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

- Cancelamento de Antecipação;
- Cancelamento de Registro;
- Exclusão;
- Liquidação Antecipada; e
- Transferência.

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



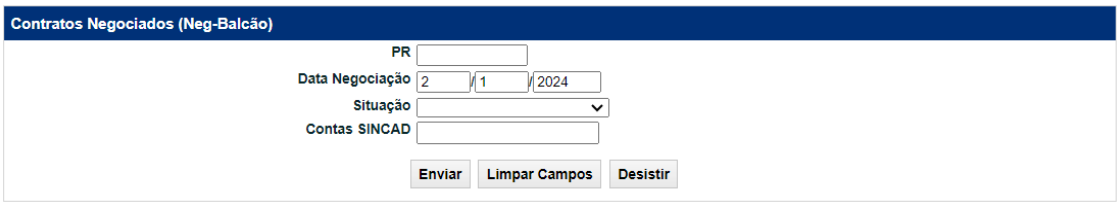

O arquivo será disponibilizado no módulo de *Transf. de Arquivo* > *Arquivo* > *Receber Arquivo.* Quando ocorrer alguma operação dentre as que foram descritas acima, será gerado um arquivo após o fechamento do sistema (no batch noturno) que estará disponível também, no módulo de Transf. de Arquivo com estas operações que foram realizadas no dia para consulta no dia seguinte

## NegBalcão

CCP > Consultas e relatórios > Neg-Balcão

### Visão Geral

O arquivo NegBalcão tem por objetivo disponibilizar a posição atualizada dos contratos do Participante de Registro, conforme data solicitada e tipos de "situação" filtrados na pesquisa.
Por meio dessa tela é possível solicitar o arquivo NegBalcão a qualquer momento, durante o horário de funcionamento do sistema NoMe.
Arquivo no formato "txt." que possibilita a conciliação dos contratos conforme filtro solicitado.




De acordo com o filtro "Situação" aplicado nesta consulta, o sistema gerará um relatório que será disponibilizado no módulo de *Transf. de Arquivo* > *Arquivos* > *Receber Arquivos.*

- Arquivo **"NEGBALCÃO – APROVADOS"**

  Gerado sob demanda. Contempla todos os contratos que foram registrados no dia (Situação "Aprovado"). Caso haja proventos nessa data, os contratos terão os valores já ajustado pelo respectivo provento se aplicar. Mesmo que não tenha provento agendado para data em questão, o dia o arquivo será gerado diariamente, para toda pregão, contendo toda a posição em aberto.

- Arquivo **"NEGBALCAO – CONTRATO EM ABERTO"**

Gerado sob demanda. Contempla todos o estoque de contrato do Participante (Situação "Contrato em Aberto"). Caso haja proventos nessa data, os contratos já terão os valores ajustados pelo respectivo provento que se aplicar. Mesmo que não tenha provento agendado para data em questão, o dia o arquivo será gerado diariamente, para toda pregão, contendo toda a posição em aberto

- Arquivo **"NEGBALCAO – TODOS"**

  Gerado sob demanda. Contempla todas as operações e situações de contratos

Adicionalmente, outros arquivos são gerados automaticamente pelo sistema e disponibilizado no módulo *Transf. de Arquivo* > *Arquivos* > *Receber Arquivos,* conforme detalhado a seguir.

- Arquivo "**NEGBALCAO-APROVADOS-AUTOMATICO"**

  Gerado automaticamente pelo sistema após o fechamento da grade de registro da CCP, contemplando todos os contratos que foram registrados no dia (Situação "Aprovado"). Caso haja proventos nessa data, os contratos terão os valores já ajustado pelo respectivo provento se aplicar. Mesmo que não tenha provento agendado para data em questão, o dia o arquivo será gerado diariamente, para toda pregão, contendo toda a posição em aberto.

- Arquivo**: "NEGBALCAO-CONTRATOS-EM-ABERTO-PROVENTOS".**

  Gerado automaticamente pelo sistema após o fechamento da grade de registro da CCP, contemplando todo o estoque de contrato do Participante (Situação "Contrato em Aberto"). Caso haja proventos nessa data, os contratos já terão os valores ajustados pelo respectivo provento que se aplicar. Mesmo que não tenha provento agendado para data em questão, o dia o arquivo será gerado diariamente, para toda pregão, contendo toda a posição em aberto.

- Arquivo "**NEGBALCAO-CONTRATOS-EM-ABERTO-ANTES-DOS-PROVENTOS"**

  Gerado automaticamente pelo sistema após o fechamento da grade de registro da CCP, contemplando todo o estoque de contrato do Participante (Situação "Contrato em Aberto"). Caso haja proventos nessa data, os contratos **não** terão os valores ajustados.

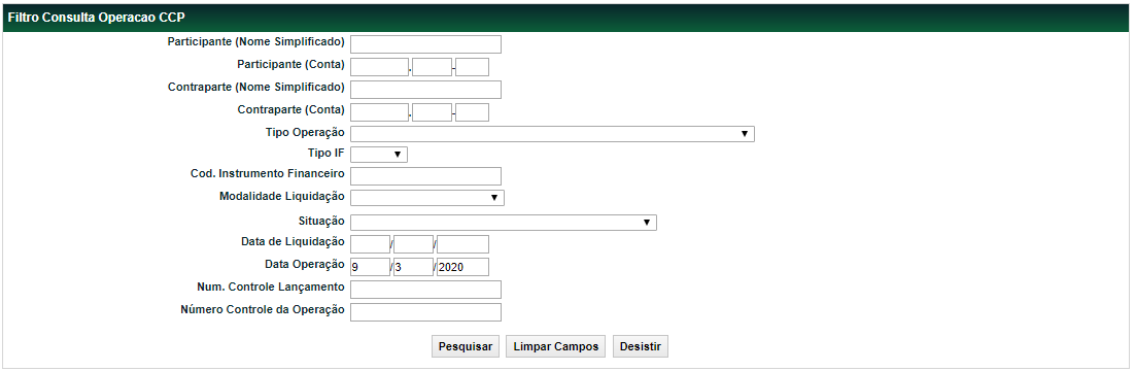
## 4.7 Consulta de Operações

**Operações > Consultas > Consulta Operação CCP**

### Visão Geral

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

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




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

(continua)




(fim)

### Descrição dos campos da Tela de Relação

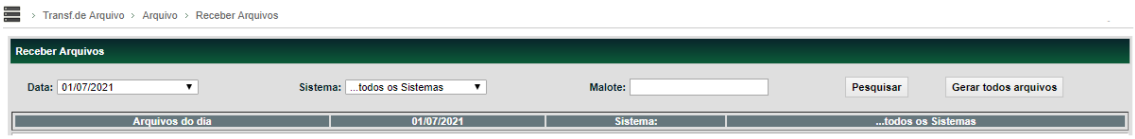
| Campo | Descrição |
|---|---|
| Participante (Nome Simplificado) | Nome simplificado do Participante de Registro. |
| Participante (Conta) | Conta Registradora do Participante de Registro parte do contrato. |
| Participante (PR) | Código do Participante de Registro que está efetuando o lançamento |
| Participante (Sincad) | Indica o código no sistema de cadastro SINCAD do Participante de Registro "Parte" da Operação. |
| Tipo Operação | Tipo de operação pendente (Registro ou Antecipação). |
| Tipo de Operação | Descrição da operação realizada. |
| C/V | Indicação da posição das pontas do contrato (P1 - Comprador/ P2 - Vendedor). |
| Cod. Instrumento Financeiro | Número gerado no momento do Registro pelo sistema. |
| Tipo IF | TCCP (para Termo), SCCP (para Swap) e OCCP (para Opção). |
| Data Emissão | Data na qual o contrato foi emitido. |
| Data Vencimento | Data na qual o contrato vence. |
| Quantidade | Quantidade negociada no contrato. |
| PU | Preço Unitário Inicial do contrato. |
| Valor | Valor base do contrato. |
| Modulo | *CETIP*21 |

| Campo | Descrição |
|---|---|
| Modalidade | Indicação da modalidade CCP. |
| Situação | Indica a situação em que se encontra a operação pesquisada. |
| Num. Controle Lançamento | Número gerado no momento do Registro pelo sistema. |
| Data de Liquidação | Data da Antecipação da operação. |
| Data Operação | Data em que a operação/movimentação foi realizada. |
| Contraparte (Nome Simplificado) | Nome simplificado do Participante de Registro. |
| Contraparte (Conta) | Conta Registradora do Participante de Registro contraparte do contrato. |
| Contraparte (PR) | Código que identifica o Participante de Registro com quem é efetuado o contrato |
| Contraparte (Sincad) | Indica o código no sistema de cadastro SINCAD do Participante de Registro "Contraparte" da Operação. |
| Número Operação Original | Número Operação Original. |
| Data Operação Original | Data Operação Original. |
| PU Op Original | PU Op Original. |
| Qtd Op Original | Qtd Op Original. |
| NuOp | Número da Operação. |
| Número Controle da Operação | Número gerado pelo sistema após a realização da operação. |
| Cód.Proc. | Preenchimento com “N”. |
| Fator Antecipação Parte | Fator para atualização do valor base remanescente, compondo o financeiro da ponta do Participante de Registro. |
| Fator Antecipação Contraparte | Fator para atualização do valor base remanescente, compondo o financeiro da ponta do Participante de Registro. |
| Situação do Contrato | Status do contrato |
| Data Inclusão | Data de inclusão da operação/movimentação. |
| Data Última Atualização | Data de atualização da operação, caso houver. |

## 4.8 Consulta de Arquivos e Relatórios

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

Transf. De Arquivos > Arquivo > Receber Arquivos




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

- **PS_RT_G015_199**

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

- **Neg-Balcão**

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

- **Mov-Balcão**

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

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

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

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

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

- **Relatório de Contratos em Aberto**: Formato PDF

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

- **Notas**

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

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

Transf.de Arquivo > Arquivo > Arquivos Públicos

- TarBalcão

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

- IndexadoresCCP

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

## 4.9 Consulta – Histórico de Ajuste de Proventos de Ações e BDRs com CCP

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

### Visão Geral

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

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

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

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

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

# 5 VARIÁVEIS ACEITA POR TIPO DE CONTRATO.

## 5.1 Tabela Auxiliares – Swap, Termo e Opções

Estão disponíveis no Site da B3 em http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/registro/derivativos-de-balcao/, Com Garantia, selecionar o produto desejado, e o submenu “Características Técnicas”.

# 6 TARIFAÇÃO

### Mercado de Balcão - Derivativos com CCP

As tarifas do Mercado de Balcão segregada por produtos dos Derivativos de Balcão com CCP estão disponíveis no site da B3 em http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/tarifas/