

# LEIAUTES DERIVATIVOS COM CCP

## CONTEÚDO

1	ATUALIZAÇÃO DE VERSÃO .....	3
2	REGISTRO DE CONTRATO DE SWAP COM CCP .....	4
3	REGISTRO DE CONTRATO DE OPÇÃO CCP .....	6
4	REGISTRO DE CONTRATO DE TERMO CCP .....	8
5	ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE TERMO COM CCP .....	10
6	ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE SWAP .....	11
7	ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE OPÇÕES COM CCP .....	12
8	REGISTRO DE CONTRATO DE BROKER-CCP .....	14
9	CONCILIAÇÃO DE POSIÇÃO DERIVATIVOS G015_199.....	15
10	MOVIMENTAÇÃO DE DERIVATIVOS MOVBALCÃO .....	23
11	CONCILIAÇÃO DE POSIÇÃO DE DERIVATIVOS COM CCP – NEGBALCÃO .....	30
12	CONCILIAÇÃO DE TARIFAÇÃO.....	35
13	ARQUIVO DE TARIFAÇÃO TARBALCÃO .....	36
14	ARQUIVO DE CANCELAMENTO DE REGISTRO DE SCCP E TCCP .....	38
15	ARQUIVO DE CANCELAMENTO DE REGISTRO DE OPCCP .....	39
16	CESSÃO E TRANSFERÊNCIA CCP .....	40
17	DMOVTRANSF .....	42
18	TABELA 01 DE DOMÍNIO DERIVATIVOS (TXT).....	43

## 1 ATUALIZAÇÃO DE VERSÃO

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
09/10/2023	09/10/2023	Registro de Opção com CCP	Inclusão do campo "Parâmetros em %", conforme comunicado 041/2023-VPC
24/04/2023	05/10/2023	Registro de Opção com CCP	Inclusão do domínio 06-WMR X PTAX VENDA no campo "Boletim".
24/04/2023	28/07/2023	DMOVTRANSF	Inclusão do layout referente ao arquivo DMOVTRANSF
24/04/2023	24/04/2023	Conciliação de Posição Derivativos G015_199	Inclusão da linha "Tipo 3" no arquivo "Conciliação de Posição Derivativos G015_199" para disponibilizar dados calculados pelo Risco, como o valor do Delta das Opções Flex Com CCP, conforme divulgado no comunicado 002/2023-VPC.
10/10/2022	11/04/2023	Antecipação com CCP	Atualização do nome dos campos: De "Parte Registradora" para "Titular" e "Contraparte Registradora" para "Lançador" Inclusão de informações nos campos de "Valor a antecipar" e "Percentual a antecipar" para realizar o <i>matching</i> das operações a mercado.
10/10/2022	14/03/2023	Antecipação de contrato de Opções com CCP	Mudança dos campos da coluna "Obrigatório" da "Parte Registradora" e "Contraparte Registradora" de "Sim" para "Não"
10/10/2022	14/03/2023	Antecipação de contrato de Opções com CCP	Mudança dos campos da coluna "Obrigatório" da "Parte Registradora" e "Contraparte Registradora" de "Sim" para "Não"
10/10/2022	17/11/2022	Movimentação de Derivativos MovBalcão	Inclusão de informações sobre quando o arquivo é gerado pelo sistema.
10/10/2022	10/10/2022	Arquivo de Cessão e Transferência CCP	Inclusão do layout novo do Arquivo de Cessão e Transferência CCP
13/12/2021	13/12/2021	Derivativos CCP – - <u>Conciliação de Posição Derivativos G015_199</u> - <u>Conciliação de Posição de Derivativos com CCP – Negbalcão</u> - <u>Movimentação de Derivativos Negbalcão</u>	Ampliação do Código de Conta do Investidor na Plataforma Cadastro (SINCAD), conforme divulgado no comunicado 051/2021-VPC
26/07/2021	26/07/2021	Derivativos CCP - Registro de Contrato de Opção CCP	Inclusão do Tipo de Indicador – BDR para Opções Flex, conforme divulgado no comunicado 031/2021-VPC
28/09/2020	28/09/2020	Derivativos CCP - <u>Conciliação de Posição Derivativos G015_199</u>	Inclusão do campo Monitoramento de Barreira, conforme divulgado no comunicado 024/2020– VPC.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
23/09/2019	10/10/2019	Layouts – Derivativos com CCP	Inclusão dos layouts de derivativos com CCP

Registro - Swap CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo: 285 Posições
<b>2 REGISTRO DE CONTRATO DE SWAP COM CCP</b>	
Descrição: Este arquivo permite ao participante realizar o registro do contrato de swap com CCP.	

## Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	Sim	SCCP
02	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	Código da Operação	9(04)	7 - 10	Sim	Código identificador da operação de Registro – 0001
04	Participante que gerou o arquivo	X(20)	11 - 30	Sim	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
05	Data	9(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD

## Registro – Dados iniciais

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	Sim	SCCP
02	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	Código operação	9(04)	7 - 10	Sim	Código identificador da operação Registro – 0001
04	Meu Número	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	Parte Registradora	9(08)	21 - 28	Sim	Código do registrador da parte
06	Conta Parte	9(08)	29 - 36	Sim	Código da parte na operação
07	Código do PR	9(10)	37 - 46	Sim	Código do Participante Registrador da Parte da operação
08	Conta SINCAD Parte	9(10)	47 - 56	Sim	Conta SINCAD da Parte
09	Taxa Operacional Parte	9(2)	57 - 58	Não	Percentual=00; Valor=01; vazio=02
10	Valor - Taxa Operacional Parte	9(13)v9(4)	59 - 75	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
11	Garantia	X(1)	76 - 76	Sim	S=Sem; C=Com

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
12	Conta Repasse Parte	X(8)	77 - 84	Não	Código da conta de Repasse da parte (se aplicável)
13	Contraparte Registradora	9(08)	85 - 92	Sim	Código do Registrador da contraparte
14	Conta Contraparte	9(08)	93 - 100	Não	Código da contraparte na operação
15	Código do PR	9(10)	101 - 110	Sim	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação
16	Conta SINCAD ContraParte	9(10)	111 - 120	Não	Conta SINCAD da Parte
17	Taxa Operacional Contraparte	9 (2)	121 - 122	Não	Percentual=00; Valor=01; vazio=02
18	Valor - Taxa Operacional ContraParte	9(13)v9(4)	123 - 139	Não	Valor da Taxa Operacional da Contraparte
19	Garantia	X(1)	140 - 140	Sim	S=Sem; C=Com
20	Conta Repasse Contraparte	X(8)	141 - 148	Não	Código da conta de Repasse da Contraparte (se aplicável)
21	Data início	9(08)	149 - 156	Sim	Data de início do contrato. Formato: AAAAMMDD
22	Data vencimento	9(08)	157 - 164	Sim	Data de vencimento do contrato. Formato: AAAAMMDD
23	Valor base	9(14)v9(02)	165 - 180	Sim	Valor base do contrato
24	Nº de Controle do PR	X(32)	181 - 212	Não	Nº de Controle do PR
25	Percentual	9(03)v9(02)	213 - 217	Sim	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato da Parte
26	Curva	X(03)	218 - 220	Sim	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos
27	Sinal Taxa	9(02)	221 - 222	Não	"+" ou "-" da Parte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-").
28	Juros(%aa)	9(03)v9(04)	223 - 229	Não	Taxa de juros atualizada da Parte
29	Percentual	9(03)v9(02)	230 - 234	Sim	Percentual que incide sobre o índice/parâmetro de atualização do contrato da ContraParte
30	Curva	X(03))	235 - 237	Sim	Índice que atualiza o valor base. Verifique arquivo AAAAMMDD_IndexadoresSWAP.txt em Arquivos Públicos no Modulo Transf. de Arquivos
31	Sinal Taxa	9(02)	238 - 239	Não	"+" ou "-" da ContraParte. Possíveis valores: 00 ("+") e 01 ("-")
32	Juros(%aa)	9(03)v9(04)	240 - 246	Não	Taxa de juros atualizada da ContraParte
33	Cupom Limpo	9(06)v9(07)	247 - 259	Não	Cotação Cupom Limpo Moeda Parte
34	Data de Cotação	9(02)	260 - 261	Não	Possíveis valores: 01 (D-1)
35	Cupom Limpo	9(06)v9(07)	262 - 274	Não	Cotação Cupom Limpo Moeda Contraparte

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
36	Data de Cotação	9(02)	275 - 276	Não	Possíveis valores: 01 (D-1)
37	Trade	9(09)	277 - 285	Não	Informação da Trade. Campo Usado para Usuário B3.

(fim)

Registro - Opção CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
<b>3 REGISTRO DE CONTRATO DE OPÇÃO CCP</b>	450 Posições
Descrição: Este arquivo permite ao participante realizar o registro do contrato de opção flexível com CCP.	

## Header

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

## Registro

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

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
13	Contraparte Registradora	9(08)	85 - 92	Sim	Código do registrador da contraparte.
14	Contraparte	9(8)	93 - 100	Comando simples - Sim Duplo Comando - Não	Código da contraparte na operação
15	Código do PR	9(10)	101 - 110	Sim	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação
16	Conta SINCAD Contraparte	9(10)	111 - 120	Comando simples - Sim Duplo Comando - Não	Conta no SINCAD da Contraparte
17	Taxa Operacional Contraparte	9(2)	121 - 122	Não	Percentual=00 ; Valor=01
18	Valor - Taxa Operacional Contraparte	9(13)v9(4)	123 - 139	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
19	Conta Repasse Contraparte	9(08)	140 - 147	Não	Código da conta de Repasse da Contraparte
20	Data de Início	9(08)	148 - 155	Sim	Data de início da Opção. Deve ser dia útil Formato: AAAAMMDD
21	Data de Vencimento	9(08)	156 - 163	Sim	Data do vencimento da opção. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Formato: AAAAMMDD
22	Data de Liquidação	9(08)	164 - 171	Sim	Data de Liquidação da opção. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Deve ser obrigatoriamente D+1 da "Data de Vencimento". Formato: AAAAMMDD.
23	Quantidade	9(15)v9(2)	172 - 188	Sim	Quantidade base do contrato
24	Nº de Controle do PR	X(32)	189 - 220	Não	Número de Controle do PR
25	Tipo Contrato	X(06)	221 - 226	Sim	Domínio: COMPRA – Contrato de Opção de Call / VENDA – Contrato de Opção de Put
26	Variável	X(10)	227 - 236	Sim	Código de referência externa
27	Tipo de Indicador	9(02)	237 - 238	Sim	01 - ETF; 02 - ACOES; 03 - PARIDADE; 04 – INDICES; 05 – BDR
28	Preço Exercício	9(15),9(7)	239 - 260	Sim	Campo tipo numérico com 22 caracteres
29	Data de Liquidação do Exercício	9(01)	261 - 261	Sim	Domínio: 1 – "D+1"
30	Tipo Opção	9(02)	262 - 263	Sim	Domínio: 01- Européia
31	Tipo Preço	9(02)	264 - 265	Sim	Domínio: 01- Último; 02 – Médio
32	Nº Dias de Apuração	9(04)	266 - 269	Sim	Númerico
33	Data Fixing	9(01)	270 - 270	Sim	Domínio: 0 – "D0"; 1 – "D-1"; 2 - "D-2"
34	Boletim	9(02)	271 - 272	Sim	Domínio: 01 - PTAX Venda; 02 - Fechamento; 03 - Liquidação; 04 - 2005; 05 – 2009; 06-WMR X PTAX VENDA.

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
35	Proteção contra Proventos	9(02)	273 - 274	Somente ação – Sim	Domínio: <b>01 – SIM</b>
36	Limitador	9(15),9(7)	275 - 296	Não	Campo Numérico
37	Prêmio Unitário	9(15),9(7)	297 - 318	Sim	Campo Numérico
38	Data de Pagamento de Prêmio	9(08)	319 - 326	Sim	Campo tipo data AAAAMMDD
39	ID - Knock In and Down	9(15)v9(7)	327 - 348	Não	Valor da barreira ID
40	IU - Knock In and Up	9(15)v9(7)	349 - 370	Não	Valor da barreira IU
41	OD - Knock Out and Down	9(15)v9(7)	371 - 392	Não	Valor da barreira OD
42	OU - Knock Out and Up	9(15)v9(7)	393 - 414	Não	Valor da barreira OU
43	Tipo de Rebate	9(02)	415 – 416	Não	Domínio: <b>01 – “Valor” 02 – “Percentual”</b>
44	Monitoramento de Barreira	X(01)	417 - 417	Não	<b>C – Contínuo; D – Discreto</b>
45	Rebate Unitário	9(15)v9(7)	418 - 439	Não	Valor do Rebate
46	Data de Liquidação do Rebate	9(02)	440 - 441	Não	Domínio: <b>01- D+1</b>
47	Trade	9(09)	442 - 450	Sim	Campo usado para usuário B3. Participante preencher com “ ” (espaço)
48	Código Confirmação Lançamento Pendente	X(15)	451-465	Não	Código de controle atribuído pelo participante
49	Parâmetros em %	X(01)	466-466	Sim	“ ” – Vazio; S – Sim

(fim)

Registro -Termo CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
<b>4 REGISTRO DE CONTRATO DE TERMO CCP</b>	251 Posições
Descrição: Este arquivo permite ao participante realizar o registro do contrato de termo com CCP.	

## Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	Sim	TCCP
02	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	Código da Operação	9(04)	7 - 10x'	Sim	Código identificador da operação de Registro – 0001
04	Entidade que gerou o Arquivo	X(20)	11 - 30	Não	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
05	Data	9(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
06	Filler	X(10)	39-41	Sim	00001 - Versão de Layout.

## Registro

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	X(05)	1 - 5	Sim	TCCP
02	ID Tipo de Linha	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	Código da Operação	9(04)	7 - 10	Sim	0001
04	Meu número	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	Parte Registradora	9(08)	21 - 28	Sim	Código do registrador da parte
06	Parte	9(08)	29 - 36	Sim	Código da Instituição lançadora da operação
07	Código do PR	9(10)	37 - 46	Sim	Código do Participante Registrador da Parte da operação
08	Conta SINCAD Parte	9(10)	47 - 56	Sim	Conta no SINCAD da Parte
09	Papel (Posição do participante)	9(01)	57 - 57	Sim	Posição do participante: <b>0 – Comprador 1 – Vendedor</b>
10	Taxa Operacional Parte	X(1)	58 - 58	Não	Taxa Operacional: <b>V – Valor P – Percentual</b>
11	Valor - Taxa Operacional Parte	9(13)v9(4)	59 - 75	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
12	Conta Repasse Parte	9(08)	76 - 83	Não	Código do Vínculo de Repasse da Parte
13	Contraparte Registradora	9(08)	84 - 91	Sim	Código do registrador da contraparte
14	Contraparte	9(8)	92 - 99	Não	Código da contraparte na operação
15	Código do PR	9(10)	100 - 109	Sim	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação
16	Conta SINCAD Contraparte	9(10)	110 - 119	Não	Conta no SINCAD da Contraparte
17	Taxa Operacional Contraparte	X(1)	120 - 120	Não	Taxa Operacional: <b>V – Valor P – Percentual</b>
18	Valor - Taxa Operacional Contraparte	9(13)v9(4)	121 - 137	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
19	Conta Repasse Contraparte	9(08)	138 - 145	Não	Código do Vínculo de Repasse da Contraparte
20	Data de Operação	9(08)	146 - 153	Sim	Data em que o Participante contratou a operação. Pode ser informada com data do dia útil anterior à data do sistema, quando a contraparte na operação é um de seus clientes, tipo conta10. Formato: AAAAMMDD
21	Data de Vencimento	9(08)	154 - 161	Sim	Data útil da apuração do resultado. Livremente pactuada entre os Participantes. Formato: AAAAMMDD
22	Valor Base	9(14)V9(02)	162 - 177	Sim	Valor do contrato expresso em quantidade de moeda de referência. Preencher com ZEROS os espaços vazios.
23	Nº de Controle do PR	X(32)	178 - 209	Não	Número de Controle do PR
24	Moeda de Referência	9(03)	210 - 212	Sim	Código da moeda negociada pelos Participantes, utilizada para apuração de saldo do contrato. Consulte o arquivo público: <a href="#">Transf. Arquivo -&gt; Arquivo -&gt; Arquivos Públicos = IndexadoresCCP.txt</a>
25	Moeda Cotada	9(03)	213 - 215	Sim	Código da moeda Cotada

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
26	Taxa a Termo (R\$/Moeda)	9(10)V9(08)	216 - 233	Não	Valor da taxa de câmbio contratada entre comprador e vendedor. É utilizada na apuração do resultado.
27	Fonte de Informação - Moeda Base	9(02)	234 - 235	Sim	Indica a fonte a ser utilizada para cotação da moeda. <b>12 – BACEN</b>
28	Boletim - Moeda Base	9(01)	236 - 236	Sim	Boletim que será usado para cotação da moeda base. <b>3 - PTAX800 de Fechamento</b>
29	Fonte de Informação - Moeda Cotada	9(02)	237 - 238	Não	Indica a fonte a ser utilizada para cotação da moeda cotada. <b>12 – BACEN</b>
30	Boletim - Moeda Cotada	9(01)	239 - 239	Não	Boletim que será usado para cotação da moeda cotada. <b>3 - PTAX800 de Fechamento</b>
31	Tipo de Apuração	X(01)	240 - 240	Sim	Tipo da Apuração. <b>U - ÚNICO.</b>
32	Data Fixing	9(01)	241 - 241	Sim	Data Fixing <b>1 – D-1</b>
33	Data de Liquidação	9(01)	242 - 242	Sim	Data de Liquidação <b>0 – D0</b>
34	Trade	9(09)	243 - 251	Não	Informação da Trade. Campo usado para usuário B3.

(fim)

Antecipação - Termo CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
<b>5 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE TERMO COM CCP</b>	124 Posições
Descrição: Arquivo a ser utilizado para registro de operação de antecipação de contratos de Termo com CCP.	

## Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	Id do sistema	X(05)	1 - 5	Sim	TCCP
02	Id tipo linha	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	Código operação	9(04)	7 -10	Sim	0014
04	Participante	X(20)	11 - 30	Sim	Nome Simplificado ou conta própria CCP do Participante que gerou o arquivo
05	Data	X(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
06	Controle de Versão	X(05)	39 - 43	Sim	00001

## Registro – Dados Iniciais

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	X(5)	1 - 5	Sim	TCCP
02	ID Tipo de Linha	X(1)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
03	Código operação	X(4)	7 - 10	Sim	Código identificador da operação. <b>Operação 0014</b>
04	Meu Número	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	Conta Registradora Comprador	9(8)	21 - 28	Sim	Código do registrador do Comprador
06	Conta Registradora Vendedor	9(8)	29 - 36	Sim	Código do registrador do Vendedor
07	Código do Contrato	9(11)	37 - 47	Sim	Código identificador do instrumento financeiro a ser antecipado.
08	Valor Base a Antecipar	9(17)V9(02)	48 - 66	N	Valor a ser antecipado.
09	Percentual a Antecipar	9(3)V9(04)	67 - 73	N	Percentual a ser antecipado
10	Taxa Operacional	9(02)	74 - 75	<b>N</b>	<b>Percentual=00 ; Valor=01; vazio=02</b>
11	Valor	9(17)V9(04)	76 - 96	N	Valor da Taxa Operacional
12	Data Antecipação	9(08)	97 - 104	Sim	Data da antecipação do Contrato. Formato: AAAAMMDD
13	Valor Financeiro a Antecipar (BR)	9(17)V9(02)	105 - 123	Sim	Valor a ser antecipado em Reais.
14	Visão Comprador	X(1)	124 - 124	Sim	<b>D - Débito ; C – Crédito</b>

(fim)

Antecipação – SWAP com CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
<b>6 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE SWAP</b>	131 Posições
Descrição: Arquivo a ser utilizado para registro de operação de antecipação de contratos de Swap com CCP.	

## Header

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	Id do sistema	X(05)	1 - 5	Sim	SCCP
02	Id tipo linha	9(01)	6 - 6	Sim	Linha de Header = 0
03	Código operação	9(04)	7 -10	Sim	0014
04	Participante	X(20)	11 - 30	Sim	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
05	Data	X(08)	31 - 38	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

## Registro – Dados Iniciais

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	X(5)	1 - 5	Sim	SCCP
02	ID Tipo de Linha	X(1)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	Código operação	X(4)	7 - 10	Sim	Código identificador da operação. Operação 0014
04	Código do Contrato	9(11)	11 - 21	Sim	Código identificador do instrumento financeiro a ser antecipado.
05	Papel	9(2)	22 - 23	Sim	Possíveis valores: 00 (Ponta 1) e 01 (Ponta 2)
06	Meu Número	9(10)	24 - 33	Sim	Código de controle atribuído pelo Participante
07	Fator para Antecipação (Ponta1)	9(10)V9(08)	34 - 51	Sim	Fator para Antecipação (Ponta 1)
08	Fator para Antecipação (Ponta2)	9(10)V9(08)	52 - 69	Sim	Fator para Antecipação (Ponta 2)
09	Data Antecipação	9(08)	70 - 77	Sim	Data da antecipação do Contrato. Formato: AAAAMMDD
10	Valor Para Antecipação	9(17)V9(02)	78 - 96	Não	Valor a ser antecipado.
11	Percentual Antecipado	9(4)V9(06)	97 - 106	Não	Percentual a ser antecipado
12	Taxa Operacional	9(02)	107 - 108	Não	Percentual=00 ; Valor=01
13	Valor	9(17)V9(04)	109 - 129	Não	Valor da Taxa Operacional
14	Filler	X(2)	130 - 131	Não	Filler

(fim)

Antecipação - Opções com CCP	
Nome do Arquivo	Tamanho do Arquivo
<b>7 ANTECIPAÇÃO DE CONTRATO DE OPÇÕES COM CCP</b>	127 Posições
Descrição: Arquivo a ser utilizado para registro de operação de antecipação de contratos de Opções com CCP.	

## Header

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

## Registro – Dados Iniciais

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
01	Id do sistema	X(5)	1 - 5	Sim	OPCCP

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
02	Id tipo linha	X(1)	6 - 6	Sim	Linha de Dados = 1
03	Código operação	X(4)	7 - 10	Sim	0036
04	Meu Número	9(10)	11 - 20	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
05	Titular	9(08)	21 - 28	Não	Código da Conta do Titular
06	Lançador	9(08)	29 - 36	Não	Código da Conta do Lançador
07	Contrato	X (9)	37 - 45	Sim	Código do Contrato.
08	Valor a Antecipar	9(17)V9(02)	46 - 64	Sim, caso queira preencher Valor.	Valor base a Antecipar. Formato IIIIIIIIIIIIDD 17 inteiros e 2 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)  Deve ser utilizado o campo "Valor a antecipar" OU "Percentual a antecipar" para o lançamento da antecipação. Para contratos a mercado, é necessário que ambas as partes lancem como "Valor" ou "Percentual" para que ocorra o <i>matching</i> da operação.
09	Percentual a Antecipar	9(04)V9(06)	65 - 74	Sim, caso queira preencher %	Percentual do Valor base a Antecipar. Formato IIIIDDDDDD 4 inteiros e 6 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)  Deve ser utilizado o campo "Valor a antecipar" OU "Percentual a antecipar" para o lançamento da antecipação. Para contratos a mercado, é necessário que ambas as partes lancem como "Valor" ou "Percentual" para que ocorra o <i>matching</i> da operação.
10	Taxa Operacional Parte	9(2)	75 - 76	Não	Percentual=00 ; Valor=01; vazio=02
11	Valor - Taxa Operacional	9(17)v9(4)	77 - 97	Não	Valor da Taxa Operacional da Parte
12	Data da antecipação	X(8)	98 - 105	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
13	Prêmio Unitário	9(15)V9(07)	106 - 127	Sim	Valor Financeiro da operação. Formato IIIIIIIIIIIIDD 15 inteiros e 7 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)

## Footer

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

(fim)

## BROKER - SWAP com CCP

Nome do Arquivo

**8 REGISTRO DE CONTRATO DE BROKER-CCP**

Descrição: Esse arquivo possibilita a Inclusão de contratos de Broker para SWAP com CCP.

**Header**

Seq	Campo	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	Sim	SCCP 00643
02	Separador	Sim	Ponto e vírgula (;)
03	Tipo Linha	Sim	0
04	Separador	Sim	Ponto e vírgula (;)
05	Código do PR	Sim	Código do PR
06	Separador	Sim	Ponto e vírgula (;)
07	Participante que gerou o arquivo	Sim	Código da Conta NoMe (formatada)
08	Separador	Sim	Ponto e vírgula (;)
09	Conta Sincad	Sim	Conta sincad do participante que gerou o arquivo
10	Separador	Sim	Ponto e vírgula (;)
11	Data	Sim	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

**Dados Iniciais**

Seq	Campo	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	Sim	SCCP 00643
02	Separador	Sim	Ponto e vírgula (;)
03	Tipo Linha	Sim	1
04	Separador	Sim	Ponto e vírgula (;)
05	Meu Número	Sim	Código de controle atribuído pelo participante
06	Separador	Sim	Ponto e vírgula (;)
07	Quantidade de Contratos	Sim	Quantidade de Contratos

**Contratos**

Seq	Campo	Obrigatório	Conteúdo
01	ID do Sistema	Sim	SCCP 00643
02	Separador	Sim	Ponto e vírgula (;)
03	Tipo Linha	Sim	2
04	Separador	Sim	Ponto e vírgula (;)
05	Código do Contrato	Sim	Código do Contrato (um contrato por linha informada no campo "Quantidade de Contratos")

(fim)

Arquivo de conciliação - G015_199	
Nome do Arquivo	
<b>9 CONCILIAÇÃO DE POSIÇÃO DERIVATIVOS G015_199</b>	
Descrição: Esse arquivo possibilita a conciliação de posição em aberto dos Derivativos com CCP.	

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
Seq	Campos	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
01	Identificação da transação	N	15		1	15	Seqüência de ident. da transação
02	Complemento da transação	N	3		16	18	Seqüência de complementação
03	Tipo de registro	N	2		19	20	1 - Dados do negócio
04	Situação do registro	N	2		21	22	
05	Membro de Compensação	N	6		23	28	
06	Código da Participante	N	6		29	34	
07	Código do cliente	N	9		35	43	
08	Número do contrato	N	9		44	52	
09	Código do contrato	A	5		53	57	
10	Tipo do contrato	A	1		58	58	
11	Data da operação	N	8		59	66	AAAAMMDD
12	Data-base	N	8		67	74	AAAAMMDD
13	Data de vencimento	N	8		75	82	AAAAMMDD
14	Código da variável	A	15		83	97	
15	Código do tipo da variável	A	2		98	99	
16	Código do período da variável	A	4		100	103	
17	Código da operação	A	6		104	109	
18	Indicador de garantia	A	1		110	110	S (sem) C (com)
19	Tipo da Taxa Operacional	A	1		111	111	P (percentual) V (valor)
20	Valor da Taxa Operacional	N	17	4	112	128	

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
21	Taxa Operacional calculada	N	15	2	129	143	
22	Valor dos emolumentos	N	15	2	144	158	
23	Valor do Fundo de Garantia	N	15	2	159	173	
24	Tamanho-base	N	17	2	174	190	
25	Fator de atualização total	A	22		191	212	
26	Fator de atualização do índice	A	22		213	234	
27	Fator de atualização dos juros	A	22		235	256	
28	Tamanho-base atual	N	17	2	257	273	
29	Sinal do diferencial das curvas/valor de liquidação	A	1		274	274	+ / -
30	Diferencial das curvas/valor de liquidação	N	17	2	275	291	
31	Percentual de liq. antec.	N	10	7	292	301	
32	Tipo da Taxa Operacional - liquidação	A	1		302	302	P (percentual) V (valor)
33	Valor da Taxa Operacional - liquidação	N	17	4	303	319	
34	Taxa Operacional calculada - liquidação	N	15	2	320	334	
35	Fator de atualização total por dias úteis	A	22		335	356	
36	Fator de atualização do índice por dias úteis	A	22		357	378	
37	Fator de atualização dos juros por dias úteis	A	22		379	400	
38	Tamanho-base atualizado por dias úteis	N	17	2	401	417	
39	Sinal diferencial curvas/valor liq. por dias úteis	A	1		418	418	+ / -
40	Diferencial curvas/valor liquidação por dias úteis	N	17	2	419	435	

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
41	Sinal dos juros	A	1		436	436	+ / -
42	Juros	N	13	7	437	449	
43	Percentual da taxa da variável	N	11	7	450	460	
44	Período da taxa da variável	A	1		461	461	D (diário) P (período)
45	Período do limite de variação	A	1		462	462	D (diário) P (período)
46	Limite de variação inferior	N	13	7	463	475	
47	Limite de variação superior	N	13	7	476	488	
48	Número do negócio em pregão	N	7		489	495	
49	Data início de valorização - contrato de carteira	N	8		496	503	AAAAMMDD
50	Data fim de valorização - contrato de carteira	N	8		504	511	AAAAMMDD
51	Indicador de carteira de ações	A	1		512	512	S (sim)
52	Tipo da liquidação programada	A	1		513	513	1, 2, 3, 4 ou 5
53	Indicador de data automática da programada	A	1		514	514	S (sim)
54	Percentual do limite de liquidação programada 4	N	10	7	515	524	
55	Variável de desistência	A	5		525	529	
56	Valor-base ajustado	N	17	2	530	546	
57	Data-base ajustada	N	8		547	554	AAAAMMDD
58	Fator de atualização ajustado	A	22		555	576	
59	Valor atual ajustado	N	17	2	577	593	
60	Sinal do valor de liquidação ajustado	A	1		594	594	+ / -

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
61	Valor de liquidação ajustado	N	17	2	595	611	
62	Numero do broker	N	9		612	620	
63	Data do broker	N	8		621	628	AAAAMMDD
64	Sinal da cotação da variável	A	1		629	629	+ / -
65	Cotação da variável	N	3		630	632	0 / 1
66	Preço de exercício (*)	N	22	7	633	654	
67	Tipo da operação (*)	A	1		655	655	C (compra) V (venda)
68	Prêmio (*)	N	22	7	656	677	
69	Data de pagamento do prêmio (*)	N	8		678	685	AAAAMMDD
70	Tipo da opção (*)	A	1		686	686	A (americana) E (européia)
71	Tipo de exercício (*)	A	1		687	687	A (autom.) S (solicit.comprador)
72	Liquidação de exercício em D+0 (*)	A	1		688	688	S (D+0) N (D+1)
73	Tipo de rebate (*)	A	1		689	689	V (valor) P (percentual)
74	Valor do rebate (*)	N	22	7	690	711	
75	Rebate em D+0 (*)	A	1		712	712	S (D+0) N (D+1)
76	Sinal do valor de liquidação do rebate (*)	A	1		713	713	+ / -
77	Valor de liquidação do rebate (*)	N	17	2	714	730	
78	Valor da taxa de registro	N	17	2	731	747	
79	Desconto do Sócio Efetivo sobre taxa de registro	N	17	2	748	764	
80	Desconto do Sócio Efetivo sobre Taxa Operac. Básica	N	17	2	765	781	

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
81	Valor da Taxa Operacional Básica	N	17	2	782	798	
82	Valor da cotação	N	13	7	799	811	
83	Indicador de barreiras (*)	N	1		812	812	1 (possui barreira) 0 (não)
84	Dados da contraparte						
85	Sinal da cotação da variável	A	1		813	813	+ / -
86	Cotação da variável cp	N	3		814	816	0 / 1
87	Código da Participante	N	6		817	822	
88	Código do cliente	N	9		823	831	
89	Código da variável	A	15		832	846	
90	Código do tipo da variável	A	2		847	848	
91	Código do período	A	4		849	852	
92	Indicador de garantia	A	1		853	853	S (sem) C (com)
93	Sinal dos juros	A	1		854	854	+ / -
94	Juros	N	13	7	855	867	
95	Percentual da taxa da variável	N	11	7	868	878	
96	Período da taxa da variável	A	1		879	879	D (diário) P (período)
97	Nome do cliente	A	60		880	939	
98	Tamanho-base atual	N	17	2	940	956	
99	Data início de valorização	N	8		957	964	AAAAMMDD
100	Data fim de valorização	N	8		965	972	AAAAMMDD
101	Indicador de carteira de ações	A	1		973	973	S(sim)
102	Fator de atualização total por dias úteis	A	22		974	995	

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
103	Fator de atualização do índice por dias úteis	A	22		996	1017	
104	Fator de atualização dos juros por dias úteis	A	22		1018	1039	
105	Tamanho-base atualizado por dias úteis	N	17	2	1040	1056	
106	Sinal diferencial curvas/valor liq. por dias úteis	A	1		1057	1057	+ / -
107	Diferencial curvas/valor Liqui. por dias úteis	N	17	2	1058	1074	
108	Valor da cotação	N	13	7	1075	1087	
109	Dados complementares						
110	Tipo de preço de exercício de liquidação (*)	A	1		1088	1088	
111	Numero de dias de apuração de preço (*)	N	7		1089	1095	
112	Indicador de bloqueio de exercício (*)	A	1		1096	1096	S (exercício bloqueado)
Registro Tipo 02 - Dados da Barreira							
113	Identificação da transação	N	15		1	15	Seqüência de ident. da transação
114	Complemento da transação	N	3		16	18	Seqüência de complementação
115	Tipo de Registro	N	2		19	20	2 - Dados da Barreira
116	Número do Contrato	N	9		21	29	
117	Código da Barreira	A	5		30	34	
118	Preço da Barreira	N	22	7	35	56	
121	Data de Acionamento da Barreira	N	8		57	64	AAAAMMDD
122	Monitoramento de Barreira	A	1		65	65	Se aplica para Barreiras KI (IO,IU) e KO (OD,OU)

Registro Tipo 01 - Dados Do Negócio							
							D – Discreta C – Contínua

Seq	Campos	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
123	Periodicidade de verificação das barreiras	A	1		66	66	Opções: E - Européia; A- Americana
124	Data início de verificação das barreiras	A	8		67	74	Formato: AAAAMMDD
125	Data fim de verificação das barreiras	A	8		75	82	Formato: AAAAMMDD

(continua)

Registro Tipo 03 - Dados do Risco							
Seq	Campos	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
126	Identificação da transação	N	15		1	15	Sequência do código identificador da transação
127	Complemento da transação	N	3		16	18	Sequência do código complementação
128	Tipo de Registro	N	2		19	20	Identifica o tipo de linha. Conteúdo: "3" = Dados do Risco
129	Número do Contrato	N	9		21	29	Código do contrato
130	Delta	N	14	7	30	43	Valor do Delta do contrato, calculado pelo MINICORE. Disponível apenas para contratos de Opções Flex Com CCP.
131	MtM	N	22	7	44	65	Campo reservado para implementação futura do valor do MtM do contrato. Será populado como "0" para todos os contratos (Termo,

							Swap e Opções Com CCP)
--	--	--	--	--	--	--	------------------------

(fim)

Arquivo de conciliação de movimentação - Movbalcão							
Nome do Arquivo							
<b>10 MOVIMENTAÇÃO DE DERIVATIVOS MOVBALCÃO</b>							
Descrição: Esse arquivo possibilita a conciliação da movimentação de Derivativos com CCP. Este arquivo é gerado somente quando ocorre operação de Anulação de Antecipação, Anulação de Registro, Exclusão, Antecipação, ou Transferência.							

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

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

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
32	Data de pagamento do prêmio	N	8		297	304	AAAAMMDD
33	Tipo da opção	A	1		305	305	A (americana) E (européia)
34	Limite da variação inferior	N	13	7	306	318	
35	Limite da variação superior	N	13	7	319	331	
36	Número do negócio em pregão	N	7		332	338	
37	Liquidação de exercício	A	1		339	339	S (liquid. D+0) N (liquid. D+1)
38	Tipo de exercício	A	1		340	340	A (autom.)/S (solicit.comprador)
39	Tamanho-base atualizado du	N	17	2	341	357	
40	Fator de atualização du (dias úteis)	A	22		358	379	
41	Fator de atual. - índice du (dias úteis)	A	22		380	401	
42	Fator de atual. - juros du (dias úteis)	A	22		402	423	
43	Valor de liquidação du (dias úteis)	N	17	2	424	440	
44	Sinal do valor de liquidação du (dias úteis)	A	1		441	441	
45	Tipo de rebate	A	1		442	442	V (valor)/P (percentual)
46	Valor do rebate (*)	N	22	7	443	464	

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
47	Rebate em D+0	A	1		465	465	S (D+0)/N (D+1)
48	Sinal da cotação da variável	A	1		466	466	+ / -
49	Cotação da variável	N	3		467	469	0 / 1
50	Tipo da liquidação progr.	A	1		470	470	1, 2, 3 ou 4
51	Percentual do limite de liquidação programada 4	N	10	7	471	480	
52	Variável de desistência	A	5		481	485	
53	Data início da valorização	N	8		486	493	AAAAMMDD
54	Data fim da valorização	N	8		494	501	AAAAMMDD
55	Numero do broker	N	9		502	510	
56	Data do broker	N	8		511	518	AAAAMMDD
57	Valor da cotação	N	13	7	519	531	
58	Dados da contraparte						
59	Sinal da cotação da variável	A	1		532	532	+ / -
60	Cotação da variável	N	3		533	535	0 / 1
61	Código da Corretora	N	6		536	541	
62	Código da variável	A	5		542	556	
63	Código opção da variável	A	2		557	558	Tabela 2.

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
64	Código do período da variável	A	4		559	562	
65	Indicador de garantia	A	1		563	563	S (sem) C (com)
66	Sinal dos juros	A	1		564	564	+ / -
67	Juros	N	13	7	565	577	
68	Percentual da taxa da variável	N	11	7	578	588	
69	Período da taxa da variável	A	1		589	589	
70	Limite da variação inferior	N	13	7	590	602	
71	Limite da variação superior	N	13	7	603	615	
72	Nome do cliente contraparte	A	60		616	675	
73	Data início da valorização	N	8		676	683	AAAAMMDD Data Início Contrato
74	Data fim da valorização	N	8		684	691	AAAAMMDD Data Vencimento
75	Tamanho-base atualizado cp	N	17	2	692	708	
76	Fator de atualização cp	A	22		709	730	
77	Fator de atual. - índice cp	A	22		731	752	
78	Fator de atual. - juros cp	A	22		753	774	
79	Valor de liquidação cp	N	17	2	775	791	

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
80	Sinal do valor de liquidação cp	A	1		792	792	
81	Valor-base atual do cp (dias úteis)	N	17	2	793	809	
82	Fator de atualização do cp (dias úteis)	A	22		810	831	
83	Fator de atual. - índice do cp (dias úteis)	A	22		832	853	
84	Fator de atual. - juros do cp (dias úteis)	A	22		854	875	
85	Valor de liquidação do cp (dias úteis)	N	17	2	876	892	
86	Sinal do valor de liquidação do cp (dias úteis)	A	1		893	893	+ / -
87	Valor da cotação cp	N	13	7	894	906	
88	Dados complementares						
89	Tipo de preço de exercício de liquidação	A	1		907	907	
90	Numero de dias de apuração de preço	N	7		908	914	
91	Indicador de bloqueio de exercício	A	1		915	915	S (exercício bloqueado)
Registro Tipo 03 - Dados da Barreira							
Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação

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

Registro Tipo 01 - Dados da Operação							
110	Data de Operação	N	8		127	134	AAAAMMDD
Registro Tipo 05 - Anulação de Registro/ Anulação de Liq. Antecipada (D+0)							
Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
111	Tipo de Registro	N	1		1	1	5 - anulação (intradiária)
112	Número do Contrato	N	9		2	10	
113	Justificativa	A	100		11	110	Justificativa informada pelo Participante.
Registro Tipo 06 - Cancelamento (D+n)							
Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
114	Tipo de Registro	N	1		1	1	6 - anulação (intradiária)
115	Número do Contrato	N	9		2	10	
116	Justificativa	A	100		11	110	Justificativa informada pelo Participante.

(fim)

Conciliação de Posição – NegBalcão	
Nome do Arquivo	
<b>11 CONCILIAÇÃO DE POSIÇÃO DE DERIVATIVOS COM CCP – NEGBALCÃO</b>	
Descrição: Esse arquivo possibilita a conciliação dos Derivativos com CCP (situação: “em aberto” ou “aprovados”)	

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
01	Identificação da transação	N	15		1	15	Fixo: "1"- Dados do Negócio
02	Tipo de registro	N	2		16	17	
03	Membro de Compensação	N	6		18	23	
04	Código da Corretora Parte	N	6		24	29	

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
05	Código do cliente Parte	N	9		30	38	
06	Número do contrato	N	9		39	47	
07	Código do contrato	A	5		48	52	Tabela 1
08	Tipo do contrato	A	1		53	53	
09	Data do Registro	N	8		54	61	
10	Data da operação	N	8		62	69	
11	Data base	N	8		70	77	
12	Data de vencimento	N	8		78	85	
13	Código da variável Parte	A	15		86	100	
14	Código opção da variável Parte	A	2		101	102	
15	Indicador de garantia	A	1		103	103	
16	Tipo da Taxa Operacional	A	1		104	104	
17	Valor da Taxa Operacional	N	17	4	105	121	
18	Taxa Operacional calculada	N	15	2	122	136	
19	Tamanho-base	N	17	2	137	153	
20	Fator de atualização	A	22		154	175	
21	Fator de atualização do índice	A	22		176	197	
22	Fator de atualização dos juros	A	22		198	219	
23	Tamanho-base atualizado	N	17	2	220	236	
24	Sinal do diferencial das curvas/valor de liquidação	A	1		237	237	

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
25	Diferencial das curvas/valor de liquidação	N	17	2	238	254	
26	Sinal dos juros	A	1		255	255	
27	Juros	N	13	7	256	268	
28	Percentual da taxa da variável	N	11	7	269	279	
29	Fixing Vencimento	N	2		280	281	Tabela 1
30	Tipo de Exercício	A	1		282	282	
31	Sinal	A	1		283	283	*Válido somente para percentual (-) Menor que o spot (+) Maior que o spot
32	Preço de exercício	N	22	7	284	305	*Se percentual, informar em fator.
33	Tipo da operação	A	1		306	306	C (Compra) ou V (Venda)
34	Sinal Pagamento Prêmio	A	1		307	307	
35	Prêmio	N	22	7	308	329	
36	Data de pagamento do prêmio	N	8		330	337	
37	Tipo da opção	A	1		338	338	
38	Liquidação de exercício D+0	A	1		339	339	
39	Tipo de rebate	A	1		340	340	
40	Valor do rebate	N	22	7	341	362	
41	Rebate em D+0	A	1		363	363	
42	Valor da cotação	N	13	7	364	376	
43	Numero do broker	N	9		377	385	
44	Data do broker	N	8		386	393	
45	Indicador de barreiras	N	1		394	394	

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
46	<b>Código da Corretora Contraparte</b>	N	6		395	400	
47	<b>Código do cliente Contraparte</b>	N	9		401	409	
48	<b>Código da variável Contraparte</b>	A	15		410	424	
49	<b>Código do tipo da variável Contraparte</b>	A	2		425	426	
50	<b>Indicador de garantia</b>	A	1		427	427	
51	<b>Sinal dos juros</b>	A	1		428	428	
52	<b>Juros</b>	N	13	7	429	441	
53	<b>Percentual da taxa da variável</b>	N	11	7	442	452	
54	<b>Nome do cliente</b>	A	60		453	512	
55	<b>Tamanho-base atualizado</b>	N	17	2	513	529	
56	<b>Valor da cotação</b>	N	13	7	530	542	
57	<b>Tipo de preço de exercício de liquidação</b>	A	1		543	543	
58	<b>Número de dias de apuração de preço</b>	N	7		544	550	
59	<b>Tipo Mercadoria</b>	A	3		551	553	
60	<b>Unidade Negociação Mercadoria</b>	A	3		554	556	
61	<b>Mês Vencimento Mercadoria</b>	N	2		557	558	
62	<b>Ano Vencimento Mercadoria</b>	N	4		559	562	
63	<b>Valor do Limitador Inferior</b>	N	13	6	563	575	
64	<b>Valor do Limtador Superior</b>	N	13	6	576	588	
65	<b>Tipo Atualização</b>	A	1		589	589	

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
66	Valor/Percentual de Atualização	N	13	6	590	602	
67	Fixing Início	N	2		603	604	Tabela 1
68	Tipo de Apuração	A	1		605	605	U - ÚLTIMO A - Asiático
69	Fonte Informação Variável Base	A	5		606	610	
70	Boletim Variável Base	A	15		611	625	
71	Câmbio Cruzado	A	1		626	626	
72	Fonte Informação Moeda Cotada	A	5		627	631	
73	Boletim Moeda Cotada	A	15		632	646	
74	Data De Liquidação	N	1		647	647	0 - D+0 1 - D+1
75	Indicação de Proventos	A	1		648	648	S - Sim *Aplicável apenas para FCA e FPA
Registro Tipo 02 - Dados da Barreira							
Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
76	Identificação da Transação	N	15		1	15	
77	Tipo de Registro	N	2		16	17	2 - Dados da Barreira
78	Número do Contrato	N	9		18	26	
79	Código da Barreira	A	5		27	31	Tabela 1
80	Tipo da Barreira	A	1		32	32	V = Valor P = Percentual
81	Sinal	A	1		33	33	*Válido somente para percentual (-) Menor que o spot (+) Maior que o spot
82	Preço da Barreira	N	22	7	34	55	*Se percentual, informar em fator.
83	Monitoramento de Barreira	A	1		56	56	Para discreta = "D"; Para Contínua = "C"

Registro Tipo 01 – Dados da Operação							
							*Somente Barreiras KI(IO,IU) e KO(OD,OU) possuem este atributo.
84	Periodicidade de verificação das barreiras	A	1		57	57	E - Européia; A- Americana Até nova comunicação, este campo não terá conteúdo
85	Data início de verificação das barreiras	A	8		58	65	Formato: AAAAMMDD Até nova comunicação, este campo não terá conteúdo
86	Data fim de verificação das barreiras	A	8		66	73	Formato: AAAAMMDD Até nova comunicação, este campo não terá conteúdo
Registro Tipo 03 - Dados Média Asiática							
Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
87	Identificação da transação	N	6		1	6	
88	Tipo de registro	N	2		7	8	3 - Dados Média Asiática
89	Número do contrato	N	9		9	17	
90	Data Início Apuração	N	8		18	25	
91	Data Fim Apuração	N	8		26	33	
92	Data Discreta	N	8		34	41	
93	Peso Data Discreta	N	7	4	42	48	

(fim)

Arquivo de Tarifação – TarAnalítico	
Nome do Arquivo	
<b>12 CONCILIAÇÃO DE TARIFAÇÃO</b>	
Descrição: Esse arquivo demonstra o detalhamento analítico da Tarifação aplicada, no D+1 da data referência da operação.	

Seq	Campo	Formato	Conteúdo	Conteúdo
01	Nº Operação	X	Número da Operação Ibalção	
02	Conta Cliente	N	Conta do Cliente	
03	CPF/CNPJ		CPF/CNPJ	
04	Produto	X	82 = Termo 83 = Swap 84 = Opções	

Seq	Campo	Formato	Conteúdo	Conteúdo
05	Contrato	X	0 - Sem 1 - Com	
06	Funcionalidade	X	Bullet	
07	Brokeragem	N	8 inteiros e 2 decimais	
08	Garantia	X	0 - Sem 1 - Com	
09	Nome da tarifa	X	Taxa de Registro Taxa de Permanência Taxa de Liquidação Antecipada Taxa de Cancelamento D+1 a D+3 Taxa de Cancelamento D+4 a V-1 Taxa de Correção D+0 Taxa de Correção D+1 a D+3 Taxa de Correção D+4 a V-1 Taxa de Transferência - Origem Taxa de Cessão de Direito - Cedente Taxa de Cessão de Direito - Cessionário Taxa de Transferência - Destino	
10	Valor Aplicado em BRL	N	Valor Base para Cobrança	
11	Valor Cobrado	N	Valor cobrado	

(fim)

**Arquivo de Tarifação - TarBalcão**

Nome do Arquivo

**13 ARQUIVO DE TARIFAÇÃO TARBALCÃO**

Descrição: Esse arquivo demonstra os valores de cobranças das tarifas referentes aos Derivativos com CCP.

Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
01	Data do Pregão	N	8		1	8	Aaaammdd
02	Código da Mercadoria	A	5		9	13	
03	Funcionalidade	X	10		14	23	
04	Tipo de Mercado	N	1		24	24	1= Swap 2= Opção de Call; 3= Opção de Put; 4= Termo;
05	Taxa de Registro Com Garantia (Percentual)	N	10	7	25	34	
06	Taxa de Registro Sem Garantia (Percentual)	N	10	7	35	44	
07	CAP Taxa de Registro Com Garantia	N	10	02	45	54	
08	CAP Taxa de Registro Sem Garantia	N	10	2	55	64	
09	FLOOR Taxa de Registro Com Garantia	N	10	2	65	74	

Seq	Campo	Formato	Tamanho	Decimal	Início	Fim	Observação
10	FLOOR Taxa de Registro Sem Garantia	N	10	2	75	84	
11	Taxa de Liquidação Antecipada COM Garantia	N	10	2	85	94	
12	Taxa de Liquidação Antecipada SEM Garantia	N	10	7	95	104	
13	Taxa de Permanência COM Garantia (Percentual)	N	10	7	105	114	
14	Taxa de Permanência SEM Garantia (Percentual)	N	10	7	115	124	
15	CAP Taxa de Permanência Com Garantia	N	10	2	125	134	
16	CAP Taxa de Permanência Sem Garantia	N	10	2	135	144	
17	FLOOR Taxa de Permanência Com Garantia	N	10	2	145	154	
18	FLOOR Taxa de Permanência Sem Garantia	N	10	2	155	164	
19	Taxa de Transferência de Titularidade - Cedente	N	10	2	165	174	
20	Taxa de Transferência de Titularidade Cessionário Com Garantia (Percentual)	N	10	7	175	184	
21	Taxa de Transferência de Titularidade Cessionário Sem Garantia (Percentual)	N	10	7	185	194	
22	Desconto Registro Brokerage (Percentual)	N	10	7	195	204	
23	Desconto Permanência Brokerage (Percentual)	N	10	7	205	214	
24	Taxa de Correção D1 a D3 (Percentual)	N	10	7	215	224	
25	Taxa de Cancelamento entre D1 a D3	N	10	2	225	234	
26	Taxa de Correção D+3	N	10	2	235	244	
27	Taxa de Cancelamento D+3	N	10	2	245	254	

Arquivo de Cancelamento de Registro de SCCP e TCCP	
Nome do Arquivo	
<b>14 ARQUIVO DE CANCELAMENTO DE REGISTRO DE SCCP E TCCP</b>	
Descrição: Esse Arquivo será utilizado para realizar o cancelamento de registro de Swap e Termo CCP	

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
1	Id do sistema	X(05)	1-5	CCP
2	Id tipo linha	9(01)	6-6	Linha de Header = 0
3	Código operação	X(04)	7-10	Código da operação: 0101 – Cancelamento de Registro
4	Nome Simplificado do Participante	X(20)	11-30	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
5	Data	9(08)	31-38	Ano, mês e dia da Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
6	Versão do Layout	9(05)	39-43	00001

## Registro – Dados Iniciais

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
1	Id do Sistema	X(05)	1-5	CCP
2	Id tipo linha	9(01)	6-6	Linha de Dados = 1
3	Código operação	X(04)	7-10	0101
4	Meu Número	9(10)	11 - 20	Código de controle atribuído pelo participante no momento de Registro. Obrigatório
5	Código do Contrato IF	9(11)	21-31	Código identificador do instrumento financeiro a ser cancelado. Obrigatório
6	Código do PR (Parte)	9(10)	32-41	Código do Participante Registrador da Parte da operação. Obrigatório
7	Código do PR (Contraparte)	9(10)	42-51	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação. Obrigatório

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
8	Data	9(08)	52-59	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

Arquivo de Cancelamento de Registro de OPCCP				
Nome do Arquivo				
<b>15 ARQUIVO DE CANCELAMENTO DE REGISTRO DE OPCCP</b>				
Descrição: Esse Arquivo será utilizado para realizar o cancelamento de registro de Opções CCP				

**Header (Registro):**

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
1	Id do sistema	X(05)	1-5	OPCCP
2	Id tipo linha	9(01)	6-6	Linha de Header = 0
3	Código operação	X(04)	7-10	Código da operação: 0102 – Cancelamento de Registro
4	Nome Simplificado do Participante	X(20)	11-30	Nome Simplificado do Participante que gerou o arquivo
5	Data	9(08)	31-38	Ano, mês e dia da Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
6	Versão do Layout	9(05)	39-43	00001

**Registro – Dados Iniciais:**

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
1	Id do sistema	X(05)	1-5	OPCCP
2	Id tipo linha	9(01)	6-6	Linha de Dados = 1
3	Código operação	X(04)	7-10	0102
4	Meu Número	9(10)	11 - 20	Código de controle atribuído pelo participante no momento de Registro. Obrigatório
5		9(11)	21-31	Código identificador do instrumento financeiro a ser

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
	<b>Código do Contrato</b>			cancelado. Obrigatório
6	<b>Código do PR</b>	9(10)	32-41	Código do Participante Registrador da Parte da operação. Obrigatório
7	<b>Código do PR</b>	9(10)	42-51	Código do Participante Registrador da Contraparte da operação. Obrigatório
8	<b>Data</b>	9(08)	52-59	Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

**Footer:**

Seq.	Campo	Formato	Posição	Descrição
1	<b>Id do sistema</b>	X(05)	1-5	OPCCP
2	<b>Id tipo linha</b>	9(01)	6-6	Linha de Footer = 9
3	<b>Quantidade de Registros</b>	9(10)	7-16	Número total de linhas do arquivo.
4	<b>Filler</b>			Reservado para futuras implementações

(fim)

<b>Arquivo de Cessão e Transferência CCP</b>	
Nome do Arquivo	
<b>16 CESSÃO E TRANSFERÊNCIA CCP</b>	
Descrição: Este arquivo permite ao Participante a cessão e a transferência de contratos CCP (Termo, Swap e Opção)	

**Header (Registro):**

Seq.	Campo	Descrição
1	<b>Id do sistema</b>	CCP___0000
2	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
3	<b>Id tipo linha</b>	Linha de Header = 0
4	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
5	<b>Data</b>	Ano, mês e dia da Data da operação. Formato: AAAAMMDD.
6	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
7	<b>Versão do Layout</b>	0001

## Registro – Dados Iniciais

Seq.	Campo	Descrição
1	<b>Id do sistema</b>	CCP____0000
2	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
3	<b>Id tipo linha</b>	Linha de Dados = 1
4	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
5	<b>Código operação</b>	0020 – Cessão 0642 – Transferência Obrigatório
6	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
7	<b>Código do Contrato</b>	Código identificador do instrumento financeiro. Obrigatório
8	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
9	<b>Meu Número</b>	Código de controle atribuído pelo participante. Obrigatório
10	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
11	<b>Conta Registradora Cedente</b>	Código B3 do Registrador cedente do contrato. Obrigatório
12	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
13	<b>Conta Cedente</b>	Código B3 do Participante cedente. Obrigatório
14	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
15	<b>Código PR Cedente</b>	Código do Participante Registrador do Cedente. Obrigatório
16	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
17	<b>Conta SINCAD Cedente</b>	Conta SINCAD do Cedente. Para Transferência entre Contas é obrigatório. Para Transferência entre Participantes ou Contas Registradoras distintas (mercado) não deve ser preenchido pelo Adquirente
18	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
19	<b>Conta Registradora Adquirente</b>	Código B3 do Registrador adquirente do contrato. Obrigatório
20	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
21	<b>Conta Adquirente</b>	Código B3 do Participante adquirente. Obrigatório
22	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
23	<b>Código PR Adquirente</b>	Código do Participante Registrador do Adquirente. Obrigatório
24	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
25	<b>Conta SINCAD Adquirente</b>	Conta SINCAD do Adquirente. Para Transferência entre Contas é obrigatório. Para Transferência entre Participantes ou Contas Registradoras distintas (mercado) não deve ser preenchido pelo Cedente
26	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
27	<b>Valor do Prêmio</b>	Valor do Prêmio da operação. Obrigatório para Cessão. Preencher o valor com duas casas decimais
28	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
29	<b>Controle B3</b>	Campo reservado para uso da B3.

Seq.	Campo	Descrição
		Não deve ser preenchido
30	<b>Separador</b>	Ponto e vírgula (;)
31	<b>Titular do Prêmio</b>	C – Cedente A – Adquirente

Arquivo de Retorno DMOVTRANSF	
Nome do Arquivo	
<b>17 DMOVTRANSF</b>	
Descrição: Arquivo de Retorno dos registros por Transferências de Arquivo.	

**Header (Registro):**

Seq.	Campo	Descrição
01	Número da Linha Original	Número da Linha do Arquivo Original
02	Separador	Ponto e vírgula (;)
03	Código IF	Código do Certificado de Operação Estruturada
04	Separador	Ponto e vírgula (;)
05	Código da Operação	Código identificador da operação.
06	Separador	Ponto e vírgula(;) )
07	Descrição da Mensagem	Mensagem do Resultado do Processamento
08	Separador	Ponto e vírgula (;)
09	Texto da Linha Original	Texto da Linha do Arquivo Original

18 TABELA 01 DE DOMÍNIO DERIVATIVOS (TXT).

	Codigo do contrato		Tipo de contrato		Liquidação de Exercício	Variável	Preço	Fonte	Boletim	Data Fixing	Top de Opção	Barreiras	
	Compra	Venda	Compra	Venda	Com Garantia					Com Garantia		Permitidas	Preço de Verificação
	Opções Flexíveis	OFC	OFV	2	3	N (T+1)	DOL - (Dolar)	T1 - PTAX VENDA	BCB	PTAX Venda	001 (T-1)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up PB - Limitador"
FCB		FPB	2	3	N (T+1)	IBX - (IBRX50)	2 - PF	BVMF	Preço Fechamento	0 (T-0) 001 (T1)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up PB - Limitador"	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
							3 - PL		Preço Liquidação				
FCI		FPI	2	3	N (T+1)	IBOV - (IBOVESPA)	02 - PF	BVMF	Preço Fechamento	0 (T-0) 001 (T1)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up PB - Limitador"	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
							03 - PL		Preço Liquidação				
FCS		FPS	2	3	N (T+1)	IDI - (ÍNDICE CDI)	5	CETIP	2009	0 (T-0) 001 (T1)	E - Europeia	IU - Knock in and Up OU - Knock Out and Up PB - Limitador"	2009
FCS		FPS	2	3	N (T+1)	ISE - (ÍNDICE SELIC)	4	BCB	2005	0 (T-0) 001 (T1)	E - Europeia	IU - Knock in and Up OU - Knock Out and Up PB - Limitador"	2005
FBC		FBP	2	3	N (T+1)	BOV - (BOVA11)	2 - PF	BVMF	Preço Fechamento	0 (T-0) 001 (T1) 002 (T2)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
FFC		FFP	2	3	N (T+1)	FIND - (FIND11)	2 - PF	BVMF	Preço Fechamento	0 (T-0) 001 (T1) 002 (T2)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
FGC		FGP	2	3	N (T+1)	GOV - (GOV11)	2 - PF	BVMF	Preço Fechamento	0 (T-0) 001 (T1) 002 (T2)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up	UP - Preço Max DOWN - Preço Min
FIC	FIP	2	3	N (T+1)	ISUS - (ISUS11)	2 - PF	BVMF	Preço Fechamento	0 (T-0) 001 (T1) 002 (T2)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up	UP - Preço Max DOWN - Preço Min	
FCA	FPA	2	3	N (T+1)	Consultar Tabela Auxiliar - Opção Flexível	PF - PREÇO DE FECHAMENTO PM - PREÇO DE LIQUIDAÇÃO	BVMF	PF - PREÇO DE FECHAMENTO PM PREÇO MEDIO	0 (T-0) 001 (T1) 002 (T2)	E - Europeia	"ID - Knock in and Down IU - Knock in and Up OD - Knock Out and Up OU - Knock Out And Up PB - Limitador"	UP - Preço Max DOWN - Preço Min	

	Contrato		Variavel		Preço de Referencia	
	Codigo	Tipo de Contrato	Variável 1	Variável 2	Variável 1	Variável 2
Swap	SCE	1	DOL (DOLAR)	REU (EUR)	T1 - (Ptax de Venda)	T1 - (Ptax de Venda)
	SCJ	1	DOL (DOLAR)	TJL (TJLP)	T1 - (Ptax de Venda)	N/A
	SCL	1	DOL (DOLAR)	IAP (IPCA)	T1 - (Ptax de Venda)	N/A
	SCM	1	DOL (DOLAR)	IGM (IGPM)	T1 - (Ptax de Venda)	N/A
	SCP	1	DOL (DOLAR)	PRE (PRE)	T1 - (Ptax de Venda)	N/A
	SCY	1	DOL (DOLAR)	JPY (IENE)	T1 - (Ptax de Venda)	T1 - (Ptax de Venda)
	SDC	1	DI1 (CDI)	DOL (DOLAR)	N/A	T1 - (Ptax de Venda)
	SDE	1	DI1 (CDI)	REU (EUR)	N/A	T1 - (Ptax de Venda)
	SDJ	1	DI1 (CDI)	TJL (TJLP)	N/A	N/A
	SDL	1	DI1 (CDI)	IAP (IPCA)	N/A	N/A
	SDM	1	DI1 (CDI)	IGM (IGPM)	N/A	N/A
	SDP	1	DI1 (CDI)	PRE (PRE)	N/A	N/A
	SDT	1	DI1 (CDI)	TR (TR)	N/A	N/A
	SDY	1	DI1 (CDI)	IEN (IENE)	N/A	T1 - (Ptax de Venda)
	SEP	1	PRE (PRE)	REU (EUR)	N/A	T1 - (Ptax de Venda)
	SJP	1	PRE (PRE)	TJL (TJLP)	N/A	N/A
	SLE	1	REU (EUR)	IAP (IPCA)	T1 - (Ptax de Venda)	N/A
	SLP	1	IAP (IPCA)	PRE (PRE)	N/A	N/A
	SMP	1	IGM (IGPM)	PRE (PRE)	N/A	N/A
	SRP	1	IBX (IBRX-50)	PRE (PRE)	PF - (Preço Fechamento)	N/A
SNP	1	IBV (IBOVESPA)	PRE (PRE)	PF - (Preço Fechamento)	N/A	
SDN	1	IBV (IBOVESPA)	DI1 (CDI)	PF - (Preço Fechamento)	N/A	