

MANUAL DE OPERAÇÕES
OPC - OPÇÕES FLEXÍVEIS 2.0
SEM CCP
ATIVOS CALCULADOS E VCP
[NOVO MÓDULO - OPC]

Versão: 06/06/2022

Atualização: 06/06/2022

Conteúdo

Atualizações da Versão	3
Introdução às Opções Flexíveis.....	4
Ações dos botões das telas	5
Lançamentos	6
Registro de Contrato	7
Registro de Contrato - VCP.....	16
Antecipação de Contrato.....	33
Atualização de Opções - VCP.....	37
Cancelamento de Operações.....	41
Curvas VCP.....	42
Visão Geral	43
VCP DE AÇÕES NACIONAIS.....	45
VCP DE AÇÕES INTERNACIONAIS	47
VCP DE ÍNDICES NACIONAIS.....	49
VCP DE ÍNDICES INTERNACIONAIS	51
VCP DE COMMODITIES	53
OPÇÕES VCP COM CESTA	54
Consultas	55
Características de Contratos.....	56
Erros em Arquivos.....	61
Lançamentos Pendentes.....	62
Lançamentos	64
Informações Adicionais	66
Metodologia de cálculo de valores financeiros para liquidação	67
Intermediação	68
Tratamento de Proventos.....	69

Atualizações da Versão

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
06/06/2022	06/06/2022	Inclusão de Classe de Ativos Subjacentes com payoff calculado	Ações Internacionais e Índices Internacionais
06/06/2022	06/06/2022	Inclusão de Informações necessárias para registros VCP	Inclusão de “VCP de Commodities” e “Opção VCP com Cesta”
14/03/2022	14/03/2022	Registro de Contrato	Atualização das observações sobre as Informações complementares.
18/10/2021	14/02/2022	VCP Índices internacionais	Atualização das observação tipo de cotação e informações necessárias sobre verificação de barreiras
18/10/2021	14/02/2022	VCP Índices Nacionais	Inclusão de Nova Seção
18/10/2021	14/02/2022	VCP Ações internacionais	Atualização das observação tipo de cotação e informações necessárias sobre verificação de barreiras
18/10/2021	14/02/2022	VCP Ações Nacionais	Atualização das observação tipo de cotação e informações necessárias sobre verificação de barreiras
18/10/2021	17/11/2021	Registro de Contrato	Inclusão de informações sobre valor base em reais do contrato, no campo “Informações Complementares”
18/10/2021	18/10/2021	Manual Novo	Versão inicial do Manual de Operações do módulo de Opções Flexíveis sem CCP que permite o registro de contratos utilizando a Curva VCP

Introdução às Opções Flexíveis

Ações dos botões das telas

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

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

Lançamentos

Registro de Contrato

Menu [Opções Flexíveis](#) > [Lançamentos](#) > [Registro](#)

Visão Geral

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

O registro do contrato é considerado aprovado pelo módulo após o casamento dos lançamentos efetuados pelas partes e após a liquidação financeira do prêmio, se a data de liquidação do prêmio for igual à data de registro do contrato.

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

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

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

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

Tela de Filtro

A imagem mostra a interface de usuário para o registro de um contrato. No topo, há uma barra de navegação com o caminho: > Opções Flexíveis > Lançamentos > Registro. Abaixo, há um formulário com o título "Registro de contrato". O formulário contém os seguintes campos: "Ação" com o valor "INCLUIR" selecionado em um menu suspenso; "Código IF" com um campo de texto vazio; "Classe do Ativo Subjacente" com o valor "ACOES INTERNACIONAIS" selecionado em um menu suspenso; e "Classe do Ativo VCP" com um menu suspenso vazio. Na base do formulário, há três botões: "Confirmar", "Limpar Campos" e "Desistir".

Campo	Descrição
-------	-----------

Campos de preenchimento obrigatório.

Ação	Informar o tipo de ação a ser realizada. Campo tipo domínio com as opções: INCLUIR
Código IF	Código do Instrumento Financeiro. Campo de preenchimento obrigatório apenas quando selecionada a ação "REAPROVEITAR". Para a ação INCLUIR o código não deverá ser preenchido, uma vez que será gerado automaticamente pelo sistema.
Classe do Ativo Subjacente	Informar a classe do ativo subjacente diferente de "VCP". Campo tipo domínio com as opções: VCP, ACOES INTERNACIONAIS e INDICES INTERNACIONAIS Campo de preenchimento obrigatório.
Classe do Ativo VCP	Somente deve ser preenchido este campo quando a Classe do Ativo Subjacente for "VCP".

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

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

Opções Flexíveis > Lançamentos > Registro

Registro de Opção

Instrumento Financeiro: OPC
Classe do Ativo Subjacente: ACOES INTERNACIONAIS

Partes do contrato

Parte (Conta): Posição da Parte: CPF/CNPJ Cliente Parte:
 Contraparte (Conta): CPF/CNPJ Cliente Contraparte:

Características

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

Prêmio

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

Limitador

Limitador:

Provento

Proteção contra Proventos:

Enviar Limpar Campos Voltar Desistir

Descrição dos campos da Tela de Registro

Campo	Descrição
Parte (Conta)	Conta da Parte (Própria 00, ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>). Campo de preenchimento obrigatório.
Posição da Parte	Indica qual a posição da Parte no contrato. Campo tipo domínio com as opções: LANÇADOR e TITULAR Campo de preenchimento obrigatório.

Campo	Descrição
CPF / CNPJ Cliente Parte	CPF ou CNPJ da Parte. Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Parte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC Não é permitido o registro de opção com o Titular e Lançador com o mesmo CPF/CNPJ.
Contraparte (Conta)	Conta da Contraparte (Própria 00, ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>). Campo de preenchimento obrigatório.
CPF / CNPJ Cliente Contraparte	CPF ou CNPJ da Contraparte Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Contraparte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC Não é permitido o registro de opção com o Titular e Lançador com o mesmo CPF/CNPJ.
Características	
Tipo de Opção	Campo tipo domínio com as opções: CALL e PUT Campo de preenchimento obrigatório.
Data Início	Data do registro do contrato no módulo. Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Formato: DD/MM/AAAA. Nos contratos que envolvam Cliente 1 ou 2, a data informada pode ser anterior a Data de Registro em até D-2, inclusive. Campo de preenchimento obrigatório.
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Formato: DD/MM/AAAA Campo de preenchimento obrigatório.
Ativo Subjacente	Indica o ativo-subjacente da opção. Campo tipo domínio com as opções dos ativos subjacentes habilitados para a classe de ativos selecionada. Os ativos disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Ativos_Subjacentes para o Tipo IF = "OPC". Campo de preenchimento obrigatório.
Quantidade	Indica a quantidade do ativo subjacente da opção. Campo tipo numérico com até 14 inteiros e 8 decimais Campo de preenchimento obrigatório

Campo	Descrição
Strike	Indica o valor/percentual do Strike da Opção. Campo tipo numérico com até 10 inteiros e 8 decimais Campo de preenchimento obrigatório.
Strike/Limitador/ Barreiras em Valor ou Percentual?	Indica se os valores informados para o Strike e Limitador estão em valor ou percentual. Campo tipo domínio com as opções: VALOR e PERCENTUAL. Campo de preenchimento obrigatório.
Data Referência para valores em %	Indica a data de referência para verificação da cotação utilizada para calcular o Strike e Limitador do contrato, se forem registrados em percentual Formato: DD/MM/AAAA Campo de preenchimento obrigatório, se informado “Strike/Limitador/Barreiras” = “PERCENTUAL”
Tipo de Exercício	Indica o tipo de exercício selecionado para o contrato. Opções disponíveis atualmente: EUROPEIA: opções que só podem ser exercidas na data de vencimento. Campo de preenchimento obrigatório.
Tipo de Cotação	Informa o tipo de cotação do ativo subjacente. Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt Campo de preenchimento obrigatório
Data de fixing do ativo subjacente	Indica a data que será utilizada verificação da cotação do ativo subjacente no vencimento do contrato. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana. Formato: DD/MM/AAAA Campo de preenchimento obrigatório
Data de fixing da moeda do ativo subjacente	Indica a data que será utilizada verificação da cotação da moeda do ativo subjacente no vencimento do contrato. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana. Formato: DD/MM/AAAA Campo de Campo de preenchimento opcional

Campo	Descrição
Opção Quanto	Campo para informar se a valorização do ativo subjacente será em real ou na moeda do ativo. Se a opção selecionada for NÃO: Será contabilizada a variação da moeda de cotação do ativo subjacente. Se a opção selecionada for SIM: Não será contabilizada a variação da moeda do ativo. Deverá ser utilizada a cotação informada no campo “cotação para opção quanto” para cálculo do ajuste. Para mais informações, consultar o Caderno de Fórmulas – seção Funcionalidades – Opção Quanto Permitido para ativos subjacentes cotados em moeda diferente do real. Campo tipo domínio com as opções: SIM e NÃO Campo de preenchimento obrigatório.
Cotação para opção quanto	Indica o valor da cotação para Opção Quanto Campo tipo numérico com até 10 inteiros e 8 decimais Campo de preenchimento obrigatório, se informado “Opção “Quanto” = SIM”
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento. Não é necessário que o <i>Titular</i> e o <i>Lançador</i> informem o mesmo número. Campo tipo numérico com até 10 dígitos. Campo de preenchimento obrigatório.
Combinação de Operações	Possibilidade de indicar que esse registro está vinculado (de modo informativo) com outro(s) registro(s), evidenciando que tratam-se de operações combinadas. Campo tipo texto com 20 caracteres Campo de preenchimento opcional
Valor Base	Indica o Valor Base do contrato Campo de preenchimento opcional
Prêmio	
Prêmio Unitário	Prêmio unitário da opção. Campo tipo numérico com até 10 inteiros e 8 decimais Não pode ser preenchido em conjunto com o campo “Valor Financeiro Total do Prêmio” Campo de preenchimento opcional.

Campo	Descrição
Valor Financeiro Total do Prêmio	Indica o Valor Financeiro Total do Prêmio para o contrato. Deverá ser preenchido, se houver. Não pode ser preenchido em conjunto com o campo "Prêmio Unitário". Campo de preenchimento opcional
Modalidade de Liquidação do Prêmio	Indica qual a Modalidade se dará a Liquidação Financeira do Prêmio, caso a data de liquidação do prêmio seja igual a D0 do registro. Caso a data de liquidação do prêmio seja diferente a data de registro, o campo só aceita a modalidade SEM MODALIDADE Campo tipo domínio com as opções: SEM MODALIDADE, BRUTA ou BILATERAL, onde: SEM MODALIDADE: Exclusivo para registro de operações com Cliente 1 ou 2 BRUTA ou BILATERAL: Exclusivo para registro de operações com mercado. Campo de preenchimento obrigatório, se informado o "Prêmio Unitário".
Data de liquidação do Prêmio	Indica a data no qual o prêmio informado será liquidado. Caso esse campo não seja preenchido e seja informado o "Prêmio Unitário", o sistema utilizará a data de registro para liquidação do prêmio A data informada deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento. Formato: DD/MM/AAAA Campo de preenchimento opcional.
Conta Liquidante do Prêmio	Conta do Participante responsável pela liquidação do prêmio Campo de preenchimento opcional.
Limitador	
Limitador	Indica o valor/percentual do Limitador da Opção. Quando for informado no campo "Tipo de Opção" o domínio: • "CALL": o valor/percentual do Limitador deve ser maior que o valor do Strike • "PUT": o valor/percentual do Limitador deve ser menor que o valor do Strike Campo tipo numérico com até 14 casas inteiras e 8 casas decimais. Campo de preenchimento opcional.
Provento	

Campo	Descrição
Proteção contra Proventos	Campo informativo para indicar se haverá tratamento de proventos na Opção. Campo tipo domínio com a opção: NÃO Campo de preenchimento obrigatório.

Observação:

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

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

Confirmação de Registro

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Registro

Registro de Opção

Instrumento Financeiro
OPC

Classe do Ativo Subjacente
ACOES INTERNACIONAIS

Partes do contrato

Parte (Conta)
05000.00-5

Posição da Parte
LANÇADOR

CPF/CNPJ Cliente Parte

Contraparte (Conta)
05000.10-8

CPF/CNPJ Cliente Contraparte
012.345.678-90

Características

Tipo de Opção
Call

Data Início
11/05/2022

Data Vencimento
23/05/2022

Ativo Subjacente
MSFT

Quantidade
1.000,00000000

Strike
50,00000000

Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?
VALOR

Data Referência para valores em %

Tipo de Exercício
EUROPEIA

Tipo de Cotação
FECHAMENTO

Data de fixing do ativo subjacente
20/05/2022

Data de fixing da moeda do ativo subjacente
20/05/2022

Opção Quanto
NÃO

Cotação para opção quanto
Meu Número
57882

Combinação de Operações

Valor base

Prêmio

Prêmio Unitário
1,00000000

Valor Financeiro
1.000,00

Total do Prêmio

Modalidade de liquidação do prêmio
SEM MODALIDADE

Data de Liquidação do Prêmio

Conta Liquidante do Prêmio

Limitador

Limitador

Provento

Proteção contra Proventos
NAO

Confirmar

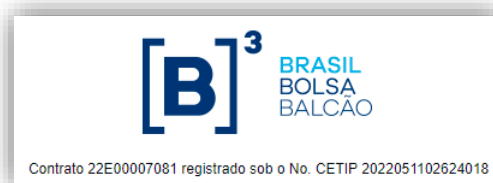
Corrigir

Voltar

Desistir

Nesta tela, são mostrados os campos digitados na Tela de Registro de Opção, não editáveis.

Em caso de confirmação, é enviada mensagem com o número da operação de registro e o código da Opção.



Registro de Contrato - VCP

Menu [Opções Flexíveis](#) > [Lançamentos](#) > [Registro](#)

Visão Geral

Através desta função, o participante pode realizar o registro de um contrato da classe do ativo subjacente = VCP, quando permitido.

O registro do contrato é considerado aprovado pelo módulo após o casamento dos lançamentos efetuados pelas partes e após a liquidação financeira do prêmio, se a data de liquidação do prêmio for igual à data de registro do contrato.

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

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

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

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

Tela de Filtro

A imagem mostra a interface de usuário para o registro de um contrato VCP. No topo, há uma barra de navegação com o caminho: > Opções Flexíveis > Lançamentos > Registro. Abaixo, o título 'Registro de contrato' está em uma barra azul. O formulário contém os seguintes campos: 'Ação' com um menu suspenso selecionando 'INCLUIR'; 'Código IF' com um campo de texto vazio; 'Classe do Ativo Subjacente' com um menu suspenso selecionando 'VCP'; e 'Classe do Ativo VCP' com um menu suspenso selecionando 'COMMODITIES'. Na base do formulário, há três botões: 'Confirmar', 'Limpar Campos' e 'Desistir'.

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Ação	Informar o tipo de ação a ser realizada. Campo tipo domínio com as opções: INCLUIR
Código IF	Código do Instrumento Financeiro. Campo de preenchimento obrigatório apenas quando selecionada a ação "REAPROVEITAR". Para a ação INCLUIR o código não deverá ser preenchido, uma vez que será gerado automaticamente pelo sistema.
Classe do Ativo Subjacente	Informar a classe do ativo subjacente = VCP. Campo tipo domínio com as opções: VCP, Ações Internacionais, Índices Internacionais Campo de preenchimento obrigatório.
Classe do Ativo VCP	Informar a classe do ativo VCP. Campo tipo domínio com as opções: AÇÕES NACIONAIS; AÇÕES INTERNACIONAIS; INDICES INTERNACIONAIS

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

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

Opções Flexíveis
Lançamentos
Registro

Registro de Opção

Instrumento Financeiro

OPC

Classe do Ativo Subjacente

VCP

Classe do Ativo VCP

COMMODITIES

Partes do contrato

Parte (Conta)

Posição da Parte

CPF/CNPJ Cliente Parte

Contraparte (Conta)

CPF/CNPJ Cliente Contraparte

Características

Tipo de Opção

Ativo Subjacente VCP

Data Início

Data Vencimento

Quantidade

Tipo de exercício

Strike

Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?

Data de fixing do ativo subjacente

Opção Quanto

Cotação para opção quanto

Strike/Limitador/Barreiras em Reais

Tipo de Cotação VCP

Fonte de informação (Ativo VCP)

Código do Ativo VCP na Fonte de Informação

Data Referência para valores em %

Moeda do Ativo VCP

Tipo de Cotação (Moeda do Ativo VCP)

Fonte de Informação (Moeda do Ativo VCP)

Data de fixing da moeda do ativo subjacente

Cotação Inicial do Ativo (em reais)

Meu Número

Combinação de Operações

Código da estratégia

Informações Complementares

Prêmio

Prêmio Unitário

Modalidade de liquidação do prêmio

Data de Liquidação do Prêmio

Conta Liquidante do Prêmio

Média Asiática

Média Asiática

Quantidade de Datas de Verificação

Limitador e Barreiras

Limitador

Periodicidade de Verificação das Barreiras

Rebate Unitário

Barreira de KI

Direção Barreira de KI

Tipo de cotação para verificação da barreira de KI

Barreira de KO

Direção Barreira de KO

Tipo de cotação para verificação da barreira de KO

Liquidação do Rebate de KO

Intermediação

Conta Intermediador

Comissão Paga pelo Titular em R\$

Comissão Paga pelo Lançador em R\$

Provento

Proteção contra Proventos

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Descrição dos campos da Tela de Registro

Campo	Descrição
Parte (Conta)	Conta da Parte (Própria 00, ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>). Campo de preenchimento obrigatório.
Posição da Parte	Indica qual a posição da Parte no contrato. Campo tipo domínio com as opções: LANÇADOR e TITULAR Campo de preenchimento obrigatório.
CPF / CNPJ Cliente Parte	CPF ou CNPJ da Parte. Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Parte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC Não é permitido o registro de opção com o Titular e Lançador com o mesmo CPF/CNPJ.
Contraparte (Conta)	Conta da Contraparte (Própria 00, ou Cliente 1 e 2) que está efetuando o lançamento do registro do contrato (<i>Titular</i> ou <i>Lançador</i>). Campo de preenchimento obrigatório.
CPF / CNPJ Cliente Contraparte	CPF ou CNPJ da Contraparte Campo de preenchimento obrigatório e exclusivo se a Contraparte for Cliente 1 ou 2. Este cliente deve estar previamente cadastrado no SIC Não é permitido o registro de opção com o Titular e Lançador com o mesmo CPF/CNPJ.
Características	
Tipo de Opção	Campo tipo domínio com as opções: CALL e PUT Campo de preenchimento obrigatório.
Ativo Subjacente VCP	Indica o ativo-subjacente da opção. Campo tipo domínio com as opções dos ativos subjacentes habilitados para a classe de ativos selecionada. Os ativos disponíveis podem ser consultadas no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_Derivativos_VCP. Campo de preenchimento obrigatório.

Campo	Descrição
Data Início	Data do registro do contrato no módulo. Deve ser dia útil e menor que a Data de Vencimento. Formato: DD/MM/AAAA. Nos contratos que envolvam Cliente 1 ou 2, a data informada pode ser anterior a Data de Registro em até D-2, inclusive. Campo de preenchimento obrigatório.
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dia útil. Formato: DD/MM/AAAA Campo de preenchimento obrigatório.
Quantidade	Indica a quantidade do ativo subjacente da opção. Campo tipo numérico com até 14 inteiros e 8 decimais Campo de preenchimento obrigatório.
Tipo de Exercício	Indica o tipo de exercício selecionado para o contrato. Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt Opções disponíveis atualmente: EUROPEIA: opções que só podem ser exercidas na data de vencimento. Campo de preenchimento obrigatório.
Strike	Indica o valor/percentual do Strike da Opção. Campo tipo numérico com até 10 inteiros e 8 decimais Campo de preenchimento obrigatório.
Strike/Limitador/ Barreiras em Valor ou Percentual?	Indica se os valores informados para o Strike, Limitador e Barreiras estão em valor ou percentual. Campo tipo domínio com as opções: VALOR e PERCENTUAL. Campo de preenchimento obrigatório.
Data de fixing do ativo subjacente	Indica a data que será utilizada verificação da cotação do ativo subjacente no vencimento do contrato. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana. Formato: DD/MM/AAAA Campo de preenchimento obrigatório

Campo	Descrição
Opção Quanto	Campo para informar se a valorização do ativo subjacente será em real ou na moeda do ativo. Se a opção selecionada for <vazio>: Será contabilizada a variação da moeda Se a opção selecionada for Sim: Não será contabilizada a variação da moeda do ativo. Deverá ser utilizada a cotação informada no campo “cotação para opção quanto” para cálculo do ajuste. Para mais informações, consultar o Caderno de Fórmulas – seção Funcionalidades – Opção Quanto Permitido para ativos subjacentes cotados em moeda diferente do real. Campo tipo domínio com as opções: SIM e <vazio> Campo de preenchimento opcional.
Cotação para opção quanto	Indica o valor da cotação para Opção Quanto Campo tipo numérico com até 10 inteiros e 8 decimais Campo de preenchimento obrigatório, se informado “Opção “Quanto” = SIM”
Strike/Limitador/Barreiras em Reais	Indica se os valores informados para o Strike, Limitador e Barreiras estão em reais Permitido para ativos subjacentes cotados em moeda diferente do real. Campo tipo domínio com as opções: SIM e <vazio> Campo de preenchimento opcional
Tipo de Cotação VCP	Informa o tipo de cotação do ativo subjacente VCP. Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt Campo de preenchimento obrigatório
Fonte de informação (Ativo VCP)	Indica a fonte de informação para verificação da cotação do ativo subjacente VCP. Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt Campo de preenchimento obrigatório

Campo	Descrição
Código do Ativo VCP na Fonte de Informação	Informar o código/ticker/nome do ativo subjacente VCP na Fonte de Informação informada anteriormente. Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt Campo de preenchimento opcional
Data Referência para valores em %	Indica a data de referência para verificação da cotação utilizada para calcular o Strike, Limitador e Barreiras do contrato, se forem registrados em percentual Formato: DD/MM/AAAA Campo de preenchimento obrigatório, se informado “Strike/Limitador/Barreiras” = “PERCENTUAL”
Moeda do Ativo VCP	Indica a moeda na qual é cotado o ativo subjacente VCP. Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt Campo de preenchimento opcional
Tipo de Cotação (Moeda do Ativo VCP)	Informar o tipo de cotação da moeda do ativo subjacente VCP, para cálculo da variação cambial, quando houver. Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt . Campo de preenchimento opcional
Fonte de Informação (Moeda do Ativo VCP)	Indica a fonte de informação para verificação da cotação da moeda do ativo subjacente VCP. Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt Campo de preenchimento opcional
Data de fixing da moeda do ativo subjacente	Indica a data que será utilizada verificação da cotação da moeda do ativo subjacente no vencimento do contrato. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana. Formato: DD/MM/AAAA Campo de Campo de preenchimento opcional
Cotação Inicial do Ativo (em Reais)	Deve ser indicado a Cotação Inicial do ativo Subjacente em Reais. Formato numérico com 10 inteiros e 8 decimais Campo de Campo de preenchimento obrigatório

Campo	Descrição
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento. Não é necessário que o <i>Titular</i> e o <i>Lançador</i> informem o mesmo número. Campo tipo numérico com até 10 dígitos. Campo de preenchimento obrigatório.
Combinação de Operações	Possibilidade de indicar que esse registro está vinculado (de modo informativo) com outro(s) registro(s), evidenciando que tratam-se de operações combinadas. Campo tipo texto com 20 caracteres Campo de preenchimento opcional
Código da Estratégia	Indicar o código da Estratégia Caso exista, preenchimento obrigatório
Informações Complementares	Informar os dados adicionais necessários para o registro, de acordo com as instruções da seção: “Curvas VCP” nesse manual. Campo tipo texto com 50 caracteres Campo de preenchimento opcional Este campo não aceita o caractere “,”
Prêmio	
Prêmio Unitário	Prêmio unitário da opção. Campo tipo numérico com até 10 inteiros e 8 decimais Campo de preenchimento opcional.
Modalidade de Liquidação do Prêmio	Indica qual a Modalidade se dará a Liquidação Financeira do Prêmio, caso a data de liquidação do prêmio seja igual a D0 do registro. Caso a data de liquidação do prêmio seja diferente a data de registro, o campo só aceita a modalidade SEM MODALIDADE Campo tipo domínio com as opções: SEM MODALIDADE, BRUTA ou BILATERAL, onde: SEM MODALIDADE: Exclusivo para registro de operações com Cliente 1 ou 2 BRUTA ou BILATERAL: Exclusivo para registro de operações com mercado. Campo de preenchimento obrigatório, se informado o “Prêmio Unitário”.

Campo	Descrição
Data de liquidação do Prêmio	Indica a data no qual o prêmio informado será liquidado. Caso esse campo não seja preenchido e seja informado o “Prêmio Unitário”, o sistema utilizará a data de registro para liquidação do prêmio A data informada deve ser dia útil e menor ou igual a data do vencimento. Formato: DD/MM/AAAA Campo de preenchimento opcional.
Conta Liquidante do Prêmio	Conta do Participante responsável pela liquidação do prêmio Campo de preenchimento opcional.
Média Asiática	
Média Asiática	Indica se o contrato possui média asiática e qual o tipo de média. Campo tipo domínio com as opções: ARITMÉTICA SIMPLES – INFORMAR DATAS; ARITMÉTICA SIMPLES – JANELA DE DATAS; ARITMÉTICA PONDERADA – INFORMAR DATAS, onde: ARITMÉTICA SIMPLES – INFORMAR DATAS: Média aritmética simples, onde o participante irá informar todas as datas de verificação da média. ARITMÉTICA SIMPLES – JANELA DE DATAS: Média aritmética simples, onde o participante irá informar a data inicial e a data final de verificação da média e serão consideradas todas as datas com cotação disponível para o ativo subjacente nesse intervalo. ARITMÉTICA PONDERADA – INFORMAR DATAS: Média aritmética ponderada, onde o participante irá informar todas as datas de verificação da média e seus respectivos pesos. Campo de preenchimento opcional.

Campo	Descrição
Quantidade de Datas de Verificação	Indica a quantidade de datas de verificação da média asiática. Campo tipo numérico, limitado a 1.100 datas. Campo de preenchimento obrigatório, se informado “Média Asiática” = “ARITMÉTICA SIMPLES – INFORMAR DATAS ou ARITMÉTICA PONDERADA – INFORMAR DATAS” O campo não pode ser preenchido, se informado “Média Asiática” = “ARITMÉTICA SIMPLES – JANELA DE DATAS”
Limitador e Barreiras	
Limitador	Indica o valor/percentual do Limitador da Opção. Quando for informado no campo “Tipo de Opção” o domínio: • “CALL”: o valor/percentual do Limitador deve ser maior que o valor do Strike • “PUT”: o valor/percentual do Limitador deve ser menor que o valor do Strike Campo tipo numérico com até 14 casas inteiras e 8 casas decimais. Campo de preenchimento opcional.
Periodicidade de Verificação das Barreiras	Indica o tipo de verificação das barreiras do contrato, Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt Opções atualmente disponíveis: AMERICANA ou EUROPEIA onde: AMERICANA: A verificação da barreira ocorre todos os dias, a partir de D+1 do início do contrato (inclusive) até a data de fixing (inclusive). EUROPEIA: A verificação da barreira apenas no final do contrato, na sua data de fixing (inclusive). Campo de preenchimento obrigatório, caso o contrato possua Barreiras de KI (KNOCK IN) e/ou de KO (KNOCK OUT)
Rebate Unitário	Indica o valor do rebate unitário a ser pago pelo lançador da opção caso o contrato atinja a barreira de KO ou não atinja a barreira de KI. Esse campo só pode ser preenchido caso o contrato possua Barreiras de KI (KNOCK IN) e/ou de KO (KNOCK OUT) Campo de preenchimento opcional.

Campo	Descrição
Barreira de KI	Indica o valor/percentual da Barreira de KI (<i>Knock-In ou Trigger In</i>) da Opção. Campo tipo numérico com 14 interios e 8 decimais. Campo de preenchimento opcional.
Direção Barreira de KI	Indica a direção da verificação da barreira de KI. Campo tipo domínio com as opções: ALTA e BAIXA , onde: ALTA: A cotação do ativo subjacente <u>deve ser maior ou igual</u> a barreira de KI para o atingimento da barreira. BAIXA: A cotação do ativo subjacente <u>deve ser menor ou igual</u> a barreira de KI para o atingimento da barreira. Campo de preenchimento obrigatório se informado o campo "Barreira de KI".
Tipo de cotação para verificação da barreira de KI	Indica o tipo de cotação que será utilizada para verificação da barreira de KI. Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt Campo de preenchimento obrigatório se informado o campo "Barreira de KI".
Barreira de KO	Indica o valor/percentual da Barreira de KO (<i>Knock-Out ou Trigger Out</i>) da Opção. Campo tipo numérico com 14 interios e 8 decimais. Campo de preenchimento opcional.
Direção Barreira de KO	Indica a direção da verificação da barreira de KO. Campo tipo domínio com as opções: ALTA e BAIXA , onde: ALTA: A cotação do ativo subjacente <u>deve ser maior ou igual</u> a barreira de KO para o atingimento da barreira. BAIXA: A cotação do ativo subjacente <u>deve ser menor ou igual</u> a barreira de KO para o atingimento da barreira. Campo de preenchimento obrigatório se informado o campo "Barreira de KO".
Tipo de cotação para verificação da barreira de KO	Indica o tipo de cotação que será utilizada para verificação da barreira de KO. Campo tipo domínio com as opções no arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_DERIVATIVOS_COE.txt Campo de preenchimento obrigatório se informado o campo "Barreira de KO".

Campo	Descrição
Liquidação do Rebate de KO	Indica quando se dará a liquidação do rebate da Barreira de KO, se informado. Campo tipo domínio com as opções: NO ATO ou NO VENCIMENTO, onde: NO ATO: Indica que o rebate será liquidado no D+1 do atingimento da barreira de KO NO VENCIMENTO: Indica que o rebate será liquidado vencimento do contrato. Campo de preenchimento obrigatório se informado o campo “Barreira de KO”.
Intermediação	
Conta Intermediador	Informa a conta do Intermediador, caso exista intermediação na Opção. Campo de preenchimento opcional.
Comissão Paga pelo Titular em R\$	Valor da comissão paga pelo titular, em reais, ao intermediador da Opção. Campo tipo numérico com 11 inteiros e 2 casas decimais. A liquidação da Intermediação só ocorrerá no dia do Registro Campo de preenchimento opcional.
Comissão Paga pelo Lançador em R\$	Valor da comissão paga pelo lançador, em reais, ao intermediador da Opção. Campo tipo numérico com 11 inteiros e 2 casas decimais. A liquidação da Intermediação só ocorrerá no dia do Registro Campo de preenchimento opcional.
Provento	
Proteção contra Proventos	Campo informativo para indicar se haverá tratamento de proventos na Opção. Campo tipo domínio com as opções: SIM - AJUSTADO PELAS PARTES e NÃO Se indicado como SIM - AJUSTADO PELAS PARTES, deverá ser detalhado no campo “Informações Complementares” o tratamento adotado. Campo de preenchimento opcional.
Média Asiática: Aritmética Simples - Informar Datas	

Campo	Descrição
Data de Fixing do Ativo Subjacente	Indica a data que será utilizada para verificação da cotação do ativo subjacente. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana. Formato: DD/MM/AAAA Campo de preenchimento obrigatório
Data de Fixing da Moeda do Ativo Subjacente	Indica a data que será utilizada para verificação da cotação da moeda do ativo subjacente. Deve ocorrer, obrigatoriamente, em dias da semana. Formato: DD/MM/AAAA Campo de preenchimento obrigatório.
Quantidade de Referência	Indica a quantidade de referência para cada data da média asiática. O somatório das Quantidades de Referência por data, deve ser igual ao campo "Quantidade" do item Características. Campo de preenchimento obrigatório.

Observação:

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

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

Confirmação de Registro

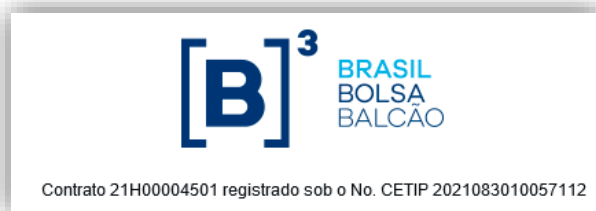
> Opções Flexíveis > Lançamentos > Registro

Registro de Opção				
Instrumento Financeiro OPC		Classe do Ativo Subjacente VCP	Classe do Ativo VCP COMMODITIES	
Partes do contrato				
Parte (Conta) 05000.00-5		Posição da Parte TITULAR	CPF/CNPJ Cliente Parte	
Contraparte (Conta) 05000.10-8			CPF/CNPJ Cliente Contraparte 012.345.678-90	
Características				
Tipo de Opção Call	Ativo Subjacente VCP DEFEITO OPC	Data Início 06/12/2021	Data Vencimento 15/12/2021	
Quantidade 3.700.00000000	Tipo de exercício Europeia	Strike 25.00000000	Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual? VALOR	
Data de fixing do ativo subjacente 14/12/2021	Opção Quanto	Cotação para opção quanto	Strike/Limitador/Barreiras em Reais	
Tipo de Cotação VCP Fechamento	Fonte de informação (Ativo VCP) B3	Código do Ativo VCP na Fonte de Informação TESTE CODIGO	Data Referência para valores em %	
Moeda do Ativo VCP	Tipo de Cotação (Moeda do Ativo VCP)	Fonte de Informação (Moeda do Ativo VCP)	Data de fixing da moeda do ativo subjacente	
Cotação Inicial do Ativo (em reais) 37.44500000	Meu Número 527	Combinação de Operações	Código da estratégia	
Informações Complementares				
Prêmio				
Prêmio Unitário 1.20000000	Valor financeiro total do prêmio 4.440,00	Modalidade de liquidação do prêmio SEM MODALIDADE	Data de Liquidação do Prêmio 06/12/2021	Conta Liquidante do Prêmio
Média Asiática				
Média Asiática	Quantidade de Datas de Verificação			
Limitador e Barreiras				
Limitador	Periodicidade de Verificação das Barreiras	Rebate Unitário	Valor financeiro Total do Rebate	
Barreira de KI	Direção Barreira de KI	Tipo de cotação para verificação da barreira de KI		
Barreira de KO	Direção Barreira de KO	Tipo de cotação para verificação da barreira de KO	Liquidação do Rebate de KO	
Intermediação				
Conta Intermediador	Comissão Paga pelo Titular em R\$	Comissão Paga pelo Lançador em R\$		
Provento				
Proteção contra Proventos				

Confirmar
Corrigir
Desistir

Nesta tela, são mostrados os campos digitados na Tela de Registro de Opção, não editáveis.

Em caso de confirmação, é enviada mensagem com o número da operação de registro e o código da Opção.



Antecipação de Contrato

Menu [Opções Flexíveis > Lançamentos > Antecipação de Contrato](#)

Visão Geral

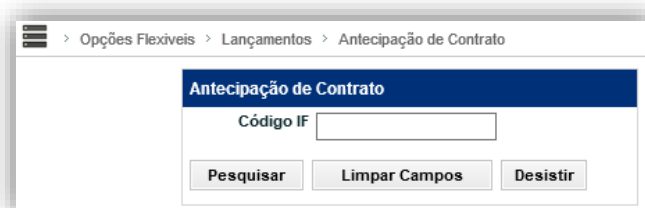
É possível a partir do primeiro dia útil subsequente ao seu registro no Módulo até o dia útil anterior (D-1) ao vencimento da opção.

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

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

O lançamento de antecipação não deve ser realizado com o objetivo de cancelamento do contrato, em função de identificação de registro incorreto, nem ser combinado com o registro de um novo contrato para refletir qualquer alteração das condições originalmente pactuadas. Nestes casos, o participante deve remeter a documentação comprobatória para a avaliação da área operacional da B3.

Ressaltamos que a utilização da função de antecipação com a finalidade de realizar alteração e/ou cancelamento de contrato poderá caracterizar a inadimplência regulamentar do participante, sujeitando-o às penalidades previstas no regulamento da B3.



A interface de usuário para a funcionalidade 'Antecipação de Contrato' é exibida. No topo, há uma barra de navegação com o caminho '> Opções Flexíveis > Lançamentos > Antecipação de Contrato'. Abaixo, o título 'Antecipação de Contrato' está em uma barra azul. O formulário principal contém um campo de entrada rotulado 'Código IF'. Na base do formulário, há três botões: 'Pesquisar', 'Limpar Campos' e 'Desistir'.

Observações:

1) A operação de antecipação pode ser estornada, através da função de Cancelamento de Operações neste módulo.

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

Tela de Inclusão dos Detalhes para Antecipação

> Opções Flexíveis > Lançamentos > Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato

Quantidade a antecipar

Prêmio Unitário da Antecipação (R\$)

Valor Financeiro da Antecipação

Liquidante

Modalidade

Data da antecipação

Pagador do Prêmio

Meu Número

Características de Contrato de Opção

Código IF

21H00004501

Classe do Ativo Subjacente

VCP

Situação do contrato

CONFIRMADO

Partes do contrato

Parte (Conta)

05000.00-5

Parte (Nome simplificado)

RIOBM

CPF/CNPJ Cliente Parte

Posição da Parte

LANÇADOR

Contraparte (Conta)

05000.10-8

Contraparte (Nome simplificado)

RIOBM

CPF/CNPJ Cliente Contraparte

012.345.678-90

Características

Tipo de Opção

Call

Data Registro

30/08/2021

Data Início

30/08/2021

Data Vencimento

30/08/2022

Tipo de exercício

Europeia

Ativo Subjacente VCP

AÇÕES

Tipo de Cotação VCP

Fechamento

Código do Ativo VCP na Fonte de Informação

Bloomberg

Fonte de informação (Ativo VCP)

Quantidade

1.000.00000000

Strike (valor)

10.00000000

Strike (percentual)

Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?

VALOR

Moeda do Ativo VCP

Tipo de Cotação (Moeda do Ativo VCP)

Fonte de Informação (Moeda do Ativo VCP)

Data de fixing da moeda do ativo subjacente

Data de fixing do ativo subjacente

29/08/2022

Cotação para opção quanto

Opção Quanto

Strike/Limitador/Barreiras em Reais

Quantidade Antecipada

Combinação de Operações

Código da estratégia

Valor base

10.000,00

Data Referência para valores em %

Cotação Inicial do Ativo (em reais)

Informações Complementares

Prêmio

Prêmio Unitário

0.70000000

Modalidade de liquidação do prêmio

SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO

Data de Liquidação do Prêmio

30/08/2021

Conta Liquidante do Prêmio

Valor financeiro total do prêmio

700,00

Média Asiática

Média Asiática

Quantidade de Datas de Verificação

Intermediação

Conta Intermediador

Comissão Paga pelo Titular em R\$

Comissão Paga pelo Lançador em R\$

Limitador e Barreiras

Limitador

Limitador (percentual)

Periodicidade de Verificação das Barreiras

Rebate Unitário

Valor financeiro Total do Rebate

Barreira de KI

Barreira KI (percentual)

Direção Barreira de KI

Tipo de cotação para verificação da barreira de KI

Situação Barreira KI

Data de Atingimento de KI

Barreira de KO

Barreira KO (percentual)

Direção Barreira de KO

Tipo de cotação para verificação da barreira de KO

Situação Barreira KO

Data de Atingimento de KO

Liquidação do Rebate de KO

Provento

Proteção contra Proventos

Informações Adicionais

Data da Última Correção

Data do Último Aditamento

Data da Última Antecipação

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

[Versão para Impressão](#)

34

INFORMAÇÃO PÚBLICA – PUBLIC INFORMATION

Descrição dos campos da tela de inclusão de detalhes

Campo	Descrição
Quantidade a antecipar	Quantidade a ser antecipada. Campo tipo numérico com 14 inteiros e 8 casas decimais. Este campo não é exibido quando o contrato a ser antecipado possuir média asiática ponderada. Campo de preenchimento obrigatório.
Prêmio Unitário da Antecipação (R\$)	Valor unitário da antecipação. Campo tipo numérico com 10 inteiros e até 8 (oito) casas decimais. Campo de preenchimento opcional. Se não for informado, será considerado que não há liquidação financeira para a antecipação.
Liquidante	Indica o participante que deve liquidar o prêmio da antecipação. Se não for preenchido, será considerado o Banco Liquidante principal do participante informado no campo "Pagador do Prêmio". Campo de preenchimento opcional.
Modalidade	Indica qual a Modalidade se dará a Liquidação Financeira do valor da antecipação. Campo tipo domínio com as opções: SEM MODALIDADE, BRUTA ou BILATERAL, onde: SEM MODALIDADE: Exclusivo para registro de operações com clientes. BRUTA ou BILATERAL: Exclusivo para registro de operações com mercado. Campo de preenchimento obrigatório, se informado o "Prêmio Unitário da Antecipação".
/Data da Antecipação	Indica a data da antecipação, que deve ser obrigatoriamente igual a data do lançamento no sistema. Campo de preenchimento obrigatório
Pagador do Prêmio	Indica quem será o pagador do valor da antecipação. Campo tipo domínio com as opções: TITULAR e LANÇADOR Campo de preenchimento obrigatório, se informado o "Prêmio Unitário da Antecipação".

Campo	Descrição
Meu número	Número de identificação do lançamento. Não é necessário que o <i>Titular</i> e o <i>Lançador</i> informem o mesmo número. Campo tipo numérico com até 10 dígitos. Campo de preenchimento obrigatório.

Dados Asiáticos – apenas para contratos com VCP
(Os campos abaixo são exibidos quando opção Asiática com média Aritmética ponderada)

Média Asiática - Informar Datas		
Data de Fixing do Ativo Subjacente	Quantidade Remanescente	Quantidade Antecipada
18/08/2020	10.000,00000000	,
20/08/2020	2.000,00000000	,

Data de Fixing do Ativo Subjacente	Campo informativo com a data de fixing do ativo subjacente informada no registro.
Quantidade Remanescente	Campo informativo com a quantidade de referência remanescente para cada data de fixing informada.
Quantidade Antecipada	Quantidade a ser antecipada. Deve ser menor ou igual a Quantidade Remanescente para data indicada. Campo apresentado para cada data de verificação do contrato com média asiática. Campo tipo numérico com 14 inteiros e 8 casas decimais. Campo de preenchimento opcional, mas a soma das quantidades deve ser igual ao campo “Quantidade a antecipar” informada anteriormente.

Após clicar no botão **Enviar** da tela de inclusão de detalhes, é exibida tela para confirmação dos dados preenchidos, acrescida do campo **Valor Financeiro a Antecipar**, calculado com base no **Prêmio Unitário da Antecipação x Quantidade Antecipada**.

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

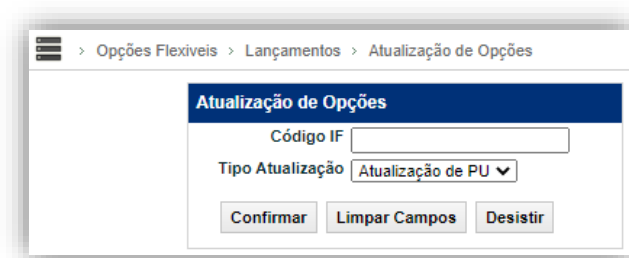
Atualização de Opções - VCP

Menu [Opções Flexíveis](#) > [Lançamentos](#) > [Atualização de Opções](#)

Visão Geral

Função permite a atualização do contrato de Opções registrado com a Classe de Ativo Subjacente igual a VCP, em determinadas situações.

Tela de Atualização de Opções



Descrição dos campos da Tela de Filtro de Atualização de Opções

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Código IF	Código do Contrato. Campo de preenchimento obrigatório
Tipo de Atualização	Indica o tipo de atualização a ser realizada no contrato. Campo tipo domínio com a opção: Atualização de PU . Campo de preenchimento obrigatório

Após clicar no botão **Avançar**, é apresentada tela para Atualização da Opção.

Tela exemplo – Atualização de Opções

Opções Flexíveis > Lançamentos > Atualização de Opções

Atualização de Opções

Dados do Registro

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

Descrição dos campos da Tela de Atualização de Opções

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Meu Número	Número interno de identificação do lançamento. Não é necessário que o <i>Titular</i> e o <i>Lançador</i> informem o mesmo número. Campo tipo numérico com até 10 dígitos. Campo de preenchimento obrigatório.
Data PU	Indica a data de atualização do PU. Formato: DD/MM/AAAA Data PU deve ser posterior a data de início, anterior ou igual a data de vencimento e não deve ser final de semana Campo de preenchimento obrigatório
Valor do PU	Valor do PU do contrato. Campo de preenchimento obrigatório

Campo	Descrição
Motivo	Indica o tipo de atualização de PU a ser realizada. Campo tipo domínio com as opções: MENSAL e VENCIMENTO onde: MENSAL: Deve ser indicada para realizar as atualizações de PU obrigatórias no último dia útil do mês ou lançamentos diários de PU. VENCIMENTO: Deve ser indicada para realizar a atualização de PU no vencimento do contrato, para geração do valor da liquidação financeira. Campo de preenchimento obrigatório

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

Tela de exemplo de Confirmação – Atualização de Opções

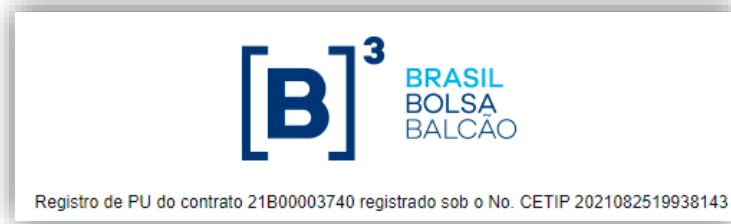
Atualização de Opções	
Dados do Registro	
Parte (Conta)	Contraparte (Conta)
10020.00-1	10020.10-4
Parte (Nome simplificado)	Contraparte (Nome simplificado)
LEMEBM	LEMEBM
CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
	987.654.321-00
Posição da Parte	Código IF
TITULAR	21B00003725
Ativo Subjacente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

Essa tela apresenta as características do contrato mostradas anteriormente.

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

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

Ao ser confirmado o lançamento o sistema irá apresentar o lançamento com o Nº da Operação.



Quando a operação envolve 2 Participante a Atualização de PU é efetuada por duplo comando. Quando operação efetuada com conta cliente do tipo 1 ou 2 do Participante, a Atualização de PU é feita por simples comando.

Cancelamento de Operações

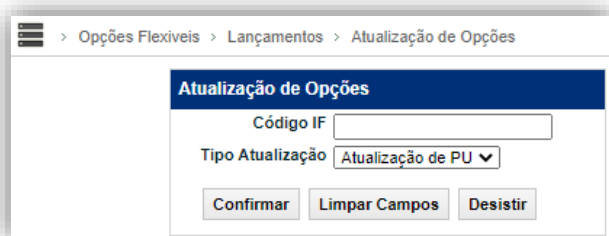
Menu [Operações > Lançamentos > Cancelamento de Operação](#)

Visão Geral

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

Regras gerais:

- Quando a operação estiver com status Finalizado, o cancelamento não é permitido;
- Considerar o horário das modalidades de liquidação;
- As operações sem modalidade financeira podem ser canceladas.



A captura de tela mostra uma interface web com um menu de navegação no topo contendo 'Opções Flexíveis', 'Lançamentos' e 'Atualização de Opções'. O formulário principal, intitulado 'Atualização de Opções', possui um campo de texto para 'Código IF' e um menu suspenso para 'Tipo Atualização' com a opção 'Atualização de PU' selecionada. Na base do formulário, há três botões: 'Confirmar', 'Limpar Campos' e 'Desistir'.

Curvas VCP

Visão Geral

O que são:

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

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

Como funcionam as curvas VCP:

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

Liquidação do Opções VCP:

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

Regras de utilização:

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

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

Informações adicionais obrigatórias

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

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

Curvas VCP disponíveis e cadastro de novas curvas

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

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

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

A seguir estão detalhadas as informações necessárias para cada categoria de curva VCP.

VCP DE AÇÕES NACIONAIS

Informações necessárias

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

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

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

VCP DE AÇÕES INTERNACIONAIS

Informações necessárias

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

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

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

VCP DE ÍNDICES NACIONAIS

Lista de Curvas Disponíveis

Código	Curva VCP	Descrição da Curva
18200	IDI	ÍNDICE IDI

Informações necessárias

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

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

Janela de verificação das barreiras com a Data de Início (inclusive) e a Data Final (inclusive)		
---	--	--

VCP DE ÍNDICES INTERNACIONAIS

Informações necessárias

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

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

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

VCP DE COMMODITIES

Informações necessárias

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

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

OPÇÕES VCP COM CESTA

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

Cestas disponíveis:

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

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

Consultas

Características de Contratos

Menu [Opções Flexíveis](#) > [Consultas](#) > [Características de Contratos](#)

Visão Geral

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

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

Tela de Filtro

> Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos

Características de contrato

Tipo de Opção

Classe do Ativo Subjacente

Classe do ativo subjacente VCP

Código IF

Filtro do Ativo Subjacente >>

Ativo Subjacente

Ativo Subjacente VCP

Moeda do Ativo / Moeda Cotada

Moeda do Ativo VCP

Lançador (Nome Simplificado)

Lançador (Conta) - -

Titular (Nome Simplificado)

Titular (Conta) - -

Data de registro / / - / /

Data de Início / / - / /

Data de Vencimento / / - / /

Situação do Contrato

Tipo de Exercício

Limitador

Barreiras

Média Asiática

Combinação de Operações

Proteção contra Proventos

Tipo de Mercadoria

Data Referência para valores em % / / - / /

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

Tela de Resultado

Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos														
Consulta de Contrato														
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)														
Data e Hora da Consulta: 09/06/2021 - 16:38:14														
Critério de pesquisa														
Código IF	Tipo de Opção	Combinação de operações	Posição da Parte	Parte (Conta)	Parte (Nome simplificado)	CPF/CNPJ Cliente Parte	Contraparte (Conta)	Contraparte (Nome simplificado)	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Data Registro	Data Início	Data Vencimento	Classe do ativo subjacente	Classe do Ativo VCP
21F00000532	CALL		TITULAR	05000.00-5	RIOBM		05000.10-8	RIOBM	012.345.678-90	09/06/2021	09/06/2021	09/06/2022	VCP	COMMODITIES
21F00000532	CALL		LANÇADOR	05000.10-8	RIOBM	012.345.678-90	05000.00-5	RIOBM		09/06/2021	09/06/2021	09/06/2022	VCP	COMMODITIES

(continua)

Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos														
Tipo de Mercadoria	Opção quanto	Cotação para opção quanto	Ativo subjacente / Moeda base	Moeda do ativo / Moeda cotada	Quantidade	Quantidade Antecipada	Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?	Strike (percentual)	Strike (valor)	Valor base	Tipo de Exercício	Situação do contrato	Data Referência para valores em %	Data de fixing do ativo subjacente
	NÃO				1.000.00000000		VALOR		100.00000000	100.000,00	Americana	CONFIRMADO		
	NÃO				1.000.00000000		VALOR		100.00000000	100.000,00	Americana	CONFIRMADO		

(continua)

Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos

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

(continua)

> Opções Flexíveis > Consultas > Características de Contratos

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

(continua)

Modalidade de liquidação do prêmio	Conta Liquidante do Prêmio	Prêmio Unitário	Valor financeiro total do prêmio	Valor financeiro Total do Rebate	Data de Liquidação do Prêmio	Data da Última Correção	Data do Último Aditamento	Data da Última Antecipação	DRRC - Agente de Cálculo Parte	DRRC - Agente de Cálculo ContraParte	Responsável pela Aceleração - Parte	Responsável pela Aceleração - Contraparte	Proteção contra Proventos	Informações Complementares	Código da estratégia	Cotação Inicial do Ativo (em reais)
Bilateral		19.000,00000000	19.000,00		02/02/2022								NAO			

(fim)

Tela de Detalhes do Contrato com VCP

Características de contrato de Opção				
Código IF	Classe do Ativo Subjacente	Classe do Ativo VCP	Situação do contrato	
21F00000532	VCP	COMMODITIES	CONFIRMADO	
Partes do contrato				
Parte (Conta)	Parte (Nome simplificado)	CPF/CNPJ Cliente Parte	Posição da Parte	
05000.10-8	RIOBM	012.345.678-90	LANÇADOR	
Contraparte (Conta)	Contraparte (Nome simplificado)	CPF/CNPJ Cliente Contraparte		
05000.00-5	RIOBM			
Características				
Tipo de Opção	Data Registro	Data Início	Data Vencimento	Tipo de exercício
Call	09/06/2021	09/06/2021	09/06/2022	Americana
Ativo Subjacente VCP	Tipo de Cotação VCP	Código do Ativo VCP na Fonte de Informação	Fonte de informação (Ativo VCP)	
SOJA TIPO 2			B3	
Quantidade	Strike (valor)	Strike (percentual)	Strike/Limitador/Barreiras em Valor ou Percentual?	
1.000,00000000	100,00000000		VALOR	
Moeda do Ativo VCP	Tipo de Cotação (Moeda do Ativo VCP)	Fonte de Informação (Moeda do Ativo VCP)	Data de fixing da moeda do ativo subjacente	
Data de fixing do ativo subjacente	Cotação para opção quanto	Opção Quanto	Strike/Limitador/Barreiras em Reais	
Quantidade Antecipada	Combinação de Operações	Valor base	Data Referência para valores em %	
		100.000,00		
Cotação Inicial do Ativo (em reais)	Informações Complementares			
18,30000000				
Prêmio				
Prêmio Unitário	Modalidade de liquidação do prêmio	Data de Liquidação do Prêmio	Conta Liquidante do Prêmio	
3,00000000	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	11/04/2022		
Valor financeiro total do prêmio				
3.000,00				
Média Asiática				
Média Asiática	Quantidade de Datas de Verificação			
Aritmética Ponderada - Informar Datas	3			
Intermediação				
Conta Intermediador	Comissão Paga pelo Titular em R\$	Comissão Paga pelo Lançador em R\$		
Limitador e Barreiras				
Limitador	Limitador (percentual)	Periodicidade de Verificação das Barreiras	Rebate Unitário	
Valor financeiro Total do Rebate	Barreira de KI	Barreira KI (percentual)	Direção Barreira de KI	
Tipo de cotação para verificação da barreira de KI	Situação Barreira KI	Barreira de KO	Barreira KO (percentual)	
Direção Barreira de KO	Tipo de cotação para verificação da barreira de KO	Situação Barreira KO	Liquidação do Rebate de KO	
Provento				
Proteção contra Proventos				
Informações Adicionais				
Data da Última Correção	Data do Último Aditamento	Data da Última Antecipação		
Média Asiática - Informar Datas				
Data de Fixing do Ativo Subjacente	Data de Fixing da Moeda do Ativo Subjacente	Quantidade de referência	Pesos (%)	
07/07/2021		100,00000000	10,00000000	
14/07/2021		200,00000000	20,00000000	
21/07/2021		700,00000000	70,00000000	
Voltar Sair				
Versão para Impressão				

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

Quadro de situações possíveis

Situação do contrato	Descrição
REGISTRADO	Quando o lançamento do registro do contrato é confirmado, mas o prêmio agendado para D0 está pendente de liquidação financeira.
CONFIRMADO	Após a liquidação financeira do prêmio agendado para D0 do registro. Para contratos com prêmio diferido, o contrato é automaticamente confirmado, não dependendo da liquidação financeira do prêmio.
CANCELADO	Status do contrato após operação de cancelamento estar finalizada. Para contratos com prêmio agendado para D0 em que a liquidação financeira não foi realizada, o contrato é automaticamente cancelado.
EXERCIDO	Situação do contrato na data de vencimento da opção, quando o valor financeiro lançado representa o exercício (Valor Financeiro do Exercício for diferente de "0" (zero)) da opção pelo titular.
NÃO EXERCIDO	Situação do contrato na data de vencimento da opção, quando o valor financeiro lançado representa o não exercício (Valor Financeiro do Exercício for igual a "0" (zero)) da opção pelo titular.
ANTECIPADO TOTAL	Quando houve a antecipação total do contrato.
AGUARDANDO TRIGGER IN	Quando o contrato com barreira aguarda o disparo do trigger para ser efetivado.

Erros em Arquivos

Menu Transf.de Arquivo > Arquivo > Erros em Arquivos

Visão Geral

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

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

A interface de busca para 'Erros em Arquivos' apresenta um cabeçalho com o caminho de navegação: > Transf.de Arquivo > Arquivo > Erros em Arquivos. Abaixo, há um formulário com os seguintes campos: 'Nome do Arquivo:' com um campo de texto; 'ID da Solicitação:' com um campo de texto; e 'Data da Solicitação:' com campos para dia (25), mês (08) e ano (2021). Na base do formulário, há dois botões: 'Pesquisar' e 'Limpar Campos'.

Tela de Resultados

A tela de resultados mostra o mesmo cabeçalho de navegação. Abaixo, há uma barra azul com o título 'Erros em Arquivos'. Seguem as informações: 'Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)' e 'Data e Hora da Consulta: 25/08/2021 - 14:21:41'. Um ícone de informação precede o texto 'Critério de pesquisa'. Abaixo, há uma tabela com os seguintes dados:

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

Na base da tabela, há controles de paginação: '<< 1 >>' e um botão 'Exibir página'. Abaixo, há um campo 'Obter no formato:' com uma seta para baixo e a opção 'Excel' selecionada.

Lançamentos Pendentes

Menu [Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes](#)

Visão Geral

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

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

Na Tela de Resultados é exibido na primeira coluna “Ação” onde quando acionada, leva as opções:

1. “CONFIRMAR” ou “DETALHAR” para a Contraparte do contrato.
2. “CANCELAR” ou “DETALHAR” para a Parte que lançou o contrato.

Tela de Filtro

A captura de tela mostra a interface de usuário para a 'Manutenção de Operações Pendentes'. No topo, há uma barra de navegação com o caminho '> Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes'. Abaixo, o título 'Manutenção de Operações Pendentes' está em uma barra azul. O formulário contém os seguintes campos: 'Parte (Conta)' com três caixas de texto; 'Contraparte (Conta)' com três caixas de texto; 'Tipo IF' com uma seta para baixo; 'Código IF' com uma caixa de texto; 'Cód Operação' com uma caixa de texto; 'Tipo de Operação' com uma caixa de texto e uma seta para baixo; 'Modalidade' com uma caixa de texto e uma seta para baixo; 'Situação' com uma caixa de texto e uma seta para baixo; 'Meu número' com uma caixa de texto; 'Num Ctrl Operação' com uma caixa de texto; e 'Data de Liquidação' com três caixas de texto contendo '25', '8' e '2021'. Na base do formulário, há três botões: 'Pesquisar', 'Limpar Campos' e 'Desistir'.

Tela de Resultados

Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes												
Manutenção de Operações Pendentes Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1) Data e Hora da Consulta: 25/08/2021 - 14:36:31 Critério de pesquisa												
Ação	Parte (Conta)	Contraparte (Conta)	Tipo IF	Código IF	Quantidade	PU	Valor	Num Ctrl Operação	Meu número	Cód Operação	Tipo de Operação	Ponta na Operação
	10020.00-1	05000.00-5	OPC	21H00004161	1.000,00000000	1,00000000	0,00	2021082519938078		1	REGISTRO	LANCADOR

(Continua)

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

(Fim)

Lançamentos

Menu [Operações > Consultas > Operações](#)

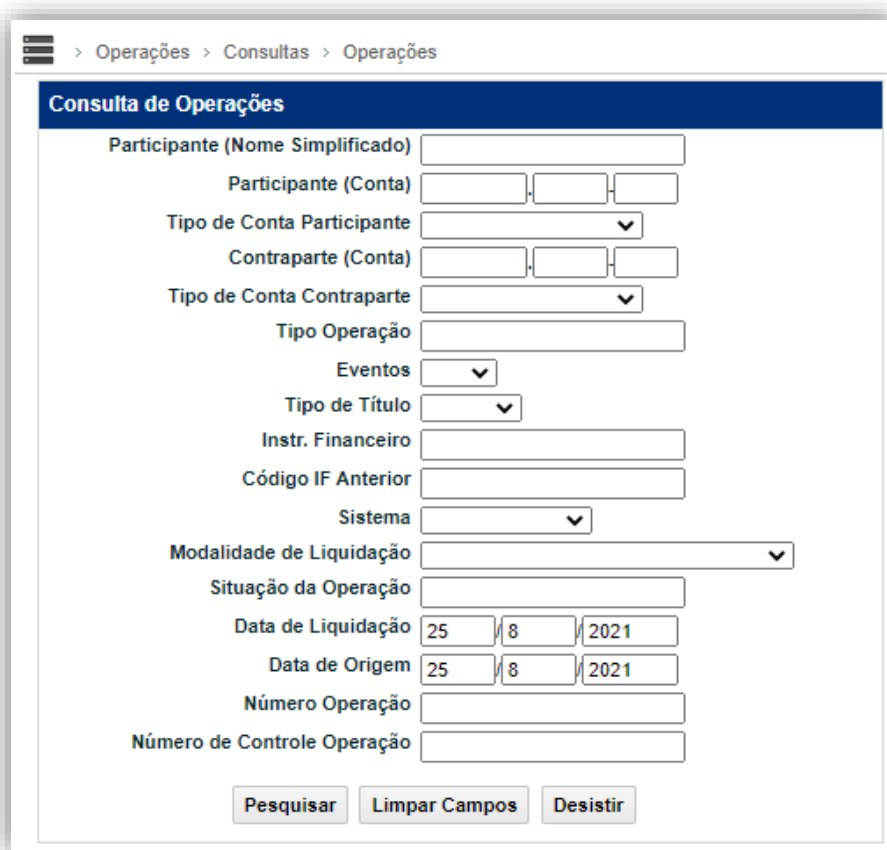
Visão Geral

Permite consultar todos os lançamentos feitos no dia.

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

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

Tela de Filtro



> Operações > Consultas > Operações

Consulta de Operações

Participante (Nome Simplificado)

Participante (Conta)

Tipo de Conta Participante

Contraparte (Conta)

Tipo de Conta Contraparte

Tipo Operação

Eventos

Tipo de Título

Instr. Financeiro

Código IF Anterior

Sistema

Modalidade de Liquidação

Situação da Operação

Data de Liquidação 25 / 8 / 2021

Data de Origem 25 / 8 / 2021

Número Operação

Número de Controle Operação

Tela de Resultados

Operações > Consultas > Operações													
Consulta de Operações													
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2) Data e Hora da Consulta: 25/08/2021 - 14:46:31													
Critério de pesquisa													
Participante (Nome Simpl.)	Conta	Liquidante	Cód.Operação	Tipo Operação	C/V	Tipo Compra/Venda	Título	Código IF Anterior	Tipo Título	Tipo de Regime	Eventos Cursados pela Cetip?	Data Emissão	Data Vencimento
LEMEBM	10020 00-1		1	REGISTRO	LANÇADOR	----	21H00004161		OPC	NÃO HABILITADO		25/08/2021	01/09/2021
RIOBM	05000 00-5		1	REGISTRO	TITULAR	----	21H00004161		OPC	NÃO HABILITADO		25/08/2021	01/09/2021

(Continua)

Quantidade	PU	Valor	Tx Colocação	Sistema	Modalidade Liquidação	Status	Número Operação	Número Associação	Data Liquidação	Data Origem	Instituicao Confirmadora(Conta)
1.000.00000000	1,000000000	0,00		CETIP21	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	FINALIZADA	773		25/08/2021	25/08/2021	
1.000.00000000	1,000000000	0,00		CETIP21	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	FINALIZADA	4367		25/08/2021	25/08/2021	

(Continua)

Instituicao Confirmadora(Papel)	Contraparte (Nome Simpl.)	Conta Contraparte	Data Compromisso	PU/Ida Compromisso	Número Operação Original	Data Operação Original	PU Op Original	Qtd Op Original	Liquidante Contraparte	ISPB Liq. Contraparte	Nu Op Msg	Num Ctrl Operação
	RIOBM	05000 00-5		0,00000000								#2021082519938078
	LEMEBM	10020 00-1		0,00000000								#2021082519938078

(Continua)

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

(Fim)

Informações Adicionais

Metodologia de cálculo de valores financeiros para liquidação

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

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

Intermediação

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

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

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

O estorno da Opção não implica no estorno da operação de intermediação, caso esta já tenha sido liquidada.

Tratamento de Proventos

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

- SIM – AJUSTADO PELAS PARTES
- NÃO

Observações:

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