

LAYOUT EM IMPLEMENTAÇÃO

REGISTRO DE CONTRATO DE OPÇÃO CCP

CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÕES.....	3
2 LEGENDAS.....	3
3 ENVIAR ARQUIVOS	4
3.1 REGISTRO DE CONTRATO DE OPÇÃO CCP.....	4

1 ATUALIZAÇÕES

Atualizado em	Referência	Atualização
18/06/2026	Registro de Contrato de Opção CCP	Inclusão dos campos “Tipo de Barreira” e “Data de Verificação” para os contratos de Opção com CCP, conforme divulgado no Comunicado Externo.

2 LEGENDAS

Legendas obrigatórias:

- Novos domínios
- Alteração de regra ou detalhamento
- Novo campo – Preenchimento opcional
- Novo campo – Preenchimento obrigatório condicional
- Novo campo – Preenchimento obrigatório

3 ENVIAR ARQUIVOS

3.1 REGISTRO DE CONTRATO DE OPÇÃO CCP

Títulos e Valores Mobiliários
Nome do Arquivo: Registro - Opção CCP
Descrição: Este arquivo permite ao participante realizar o registro do contrato de opção flexível com CCP.

Header

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

Registro

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

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

Seq	Campo	Formato	Posição	Obrigatório	Conteúdo
34	Boletim	9(02)	271 - 272	Sim	Domínio: 01 - PTAX Venda; 02 - Fechamento; 03 - Liquidação; 04 - 2005; 05 – 2009; 06-WMR X PTAX VENDA.
35	Proteção contra Proventos	9(02)	273 - 274	Somente ação – Sim	Domínio: 01 – SIM
36	Limitador	9(15),9(7)	275 - 296	Não	Campo Numérico
37	Prêmio Unitário	9(15),9(7)	297 - 318	Sim	Campo Numérico
38	Data de Pagamento de Prêmio	9(08)	319 - 326	Sim	Campo tipo data AAAAMMDD, podendo ser D+1 ou D+2 da data do registro.
39	ID - Knock In and Down	9(15)v9(7)	327 - 348	Não	Valor da barreira ID
40	IU - Knock In and Up	9(15)v9(7)	349 - 370	Não	Valor da barreira IU
41	OD - Knock Out and Down	9(15)v9(7)	371 - 392	Não	Valor da barreira OD
42	OU - Knock Out and Up	9(15)v9(7)	393 - 414	Não	Valor da barreira OU
43	Tipo de Rebate	9(02)	415 – 416	Não	Domínio: 01 – “Valor” 02 – “Percentual”
44	Monitoramento de Barreira	X(01)	417 - 417	Não	C – Contínuo; D – Discreto
45	Rebate Unitário	9(15)v9(7)	418 - 439	Não	Valor do Rebate
46	Data de Liquidação do Rebate	9(02)	440 - 441	Não	Domínio: 01- D+1
47	Trade	9(09)	442 - 450	Sim	Campo usado para usuário B3. Participante preencher com “ ” (espaço)
48	Código Confirmação Lançamento Pendente	X(15)	451-465	Não	Código de controle atribuído pelo participante
49	Parâmetros em %	X(01)	466-466	Sim	“ ” – Vazio; S – Sim
50	Tipo de Barreira	X(01)	467-467	Não	Informa o tipo de Barreira e a periodicidade de verificação da mesma A - Barreira tipo Americana – Verificação durante a data de início até a data fixing do contrato E - Barreira tipo Europeia – realiza verificação de barreiras exclusivamente na “Data da Barreira” Caso preenchido em branco e com barreiras, sistema se comportará como barreira Americana
51	Data da Barreira	9(08)	468-475	Sim – Quando tipo Barreira – “E”	Data de verificação da barreira podendo ser da data de início do contrato até o a data fixing.