

Arquivo Analítico de Exposição Cambial Diário – Derivativos de Balcão

Descrição	Formato	Tamanho	Início	Fim	Observação
Tipo de Registro	N	002	1	2	Fixo "02"
Data do Movimento	A	008	3	10	Data com formato AAAAMMDD
Entidade	A	003	11	13	Fixo "BVF"
Código do Membro de Compensação	N	008	14	21	
Código do Participante	N	008	22	29	
Código do Cliente	N	008	30	37	
Tipo de Pessoa	A	001	38	38	Tabela 1
Número do Documento do Cliente	N	019	39	57	
Mercado	A	003	58	60	Tabela 2
Mercadoria	A	003	61	63	
Número do Contrato	N	022	64	85	
Código Tipo Opção	A	001	86	86	"C" – Call ou "P" – Put
Natureza – QA	A	001	87	87	"C" - Compra ou "V" - Venda
Quantidade – QA	N	017	88	104	2 decimais
Natureza – Q	A	001	105	105	"C" - Compra ou "V" - Venda
Quantidade – Q	N	017	106	122	2 decimais
Valor de Referência	N	017	123	139	2 decimais
Valor Taxa Base	N	019	140	158	4 decimais
Valor Delta	N	018	159	176	3 decimais
Valor Taxa de Juros Moeda Utilizada – Pré (%a.a.)	N	019	177	195	4 decimais
Valor do Cupom Cambial (%a.a.)	N	019	196	214	4 decimais
Valor da Volatilidade (%a.a.)	N	019	215	233	4 decimais
Valor do Ativo-Objeto	N	018	234	251	3 decimais
Valor do Preço do Exercício Opção	N	018	252	269	3 decimais
Valor do Rebate	N	018	270	287	3 decimais
Provisório/Definitivo	A	001	288	288	Tabela 2

Tabela 1 – Tipo de Pessoa

F – Pessoa física
J – Pessoa jurídica
C – CVM

Tabela 2 – Mercado

SWA – Swap
OPC - Opções Flexíveis de Compra
OPV - Opções Flexíveis de Venda
TMO – Termo

Tabela 3 – Indicador de Provisório/Definitivo

P – Provisório
D – Definitivo