

Exercício e Bloqueio – Opções Semanais

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	
L1.1	Cliente: Negociar 1000 quantidades de opção semanal.	Recebe Execution Report			
L1.2	Cliente: Enviar exercício de opção: <ul style="list-style-type: none"> • Quantidade: 100 • TAG 35=AL • Lançador: conta A • Titular: conta B 	Recebe 35=AM com a TAG 722=3 (Completed)	N	Pass	N/E
L1.3	Cliente: Enviar ordem de venda limitada, DIA, na opção correspondente ao exercício acima • 100@20,00 <ul style="list-style-type: none"> • Cliente: qualquer um que não A Cliente: Enviar ordem de compra limitada, DIA, na opção correspondente ao exercício acima <ul style="list-style-type: none"> • 100@20,00 • Cliente: conta A 	Recebe Execution Report com a tag 150=F Recebe 35=AM com a tag 709=101 (Auto blocking of short option position)	N	Pass	N/E

L2. Exercício Automático de Opções Semanais

Passo	Descrição	Resultado esperado	Req	Status	Passo
L2.1	Cliente: Negociar 1000 quantidades de opção semanal.	Recebe Execution Report			
L2.1	TRADING CERTIFICATION: Carregar posição in the money de opção disponível no dicionário. Cliente: Enviar contrary exercise para não exercer	Recebe Execution Report do contrary registrado.	N	Pass	N/E
L2.2	Cliente: Cancelar o contrary enviado no cenário L2.1.	Recebe Execution Report do cancelamento do contrary.	N	Pass	N/E
L2.3	TRADING CERTIFICATION: Altera o preço do ativo objeto para que a opção fique at the money. Cliente: Enviar contrary exercise para exercer	Recebe Execution Report do contrary registrado.	N	Pass	N/E
L2.4	TRADING CERTIFICATION: Cancela o contrary enviado no cenário L2.3.	Recebe Execution Report do cancelamento do contrary.	N	Pass	N/E
L2.5	TRADING CERTIFICATION: Altera o preço do ativo objeto para que a opção fique out the money. Cliente: Enviar contrary exercise para exercer a opção mesmo fora do dinheiro.	Recebe Execution Report do contrary registrado.	N	Pass	N/E

L2.6	Cliente: Enviar contrary para exercer posição que não existe, mas a opção existe no dicionário.	Recebe Execution Report do contrary rejeitado.	N	Pass	N/E
L2.7	Cliente: Enviar contrary para não exercer posição que não existe, mas a opção existe no dicionário.	Recebe Execution Report do contrary rejeitado.	N	Pass	N/E
L2.8	Cliente: Enviar contrary para exercer opção que não existe.	Recebe Execution Report do contrary rejeitado.	N	Pass	N/E
L2.9	Cliente: Enviar contrary para não exercer opção que não existe.	Recebe Execution Report do contrary rejeitado.	N	Pass	N/E