

MANUAL DE OPERAÇÕES – TERMO 21

CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÃO DA VERSÃO	3
2 INTRODUÇÃO AO TERMO.....	5
2.1 Conhecendo o Produto	5
2.2 Ações dos Botões das Telas.....	5
3 LANÇAMENTOS	6
3.1 Contrato a Termo de Moedas	6
3.2 Antecipação	17
3.3 Intermediação de Contrato.....	20
3.4 Cessão de Contrato	23
3.5 Alteração e Exclusão de Contrato.....	25
3.6 Taxa de Câmbio para Avaliação	33
3.7 Ajustar Taxa.....	37
4 TERMO COM FLUXO.....	38
4.1 Registro de Termo de Moedas com Fluxo e TARF	38
4.2 Intermediação de Contrato.....	48
4.3 Cessão de Contrato	49
4.4 Antecipação de contrato	50
4.5 Registro de Parâmetros	52
4.6 Alteração de Contrato	55
4.7 Lançamento de Taxa de Câmbio para Ajuste	56
4.8 Cancelamento de Contrato	57
5 CONSULTAS.....	59
5.1 Contratos	59
6 INFORMAÇÕES ADICIONAIS	63
6.1 Formação dos Códigos do Instrumento Financeiro	63
6.2 Cruzamento de Funcionalidades	64
6.3 Regras de Registro Conforme Fonte de Informação	65
6.4 Regras de Negócios.....	69
6.5 Cross Rate	71
6.6 Moedas Negociadas	71
7 GLOSSÁRIO.....	74

1 ATUALIZAÇÃO DA VERSÃO

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
28/09/2020	28/09/2020	Contrato a Termo de Moedas	Inclusão dos campos “Atualizar Valor Base?”, “Cotação Inicial” e “Valor Base Original” para atualização do Valor Base replicando o efeito de “travar” o notional na moeda cotada, conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC.
28/09/2020	28/09/2020	Termo com Fluxo	Antecipação: Alteração de decimais dos campos “Valor Base a Antecipar” e “Valor a Antecipar” de 12 (doze) inteiros e 2 (dois) decimais para 12 (doze) inteiros e 8 (dois) decimais, conforme divulgado no comunicado 031/2020-VPC.
29/06/2020	29/06/2020	Alteração de Contrato	Informação de que podem ser realizadas mais de uma alteração do contrato no dia, conforme divulgado no comunicado 019/2020-VPC.
25/11/2019	15/04/2020	Contrato a Termo de Moedas	Ajuste nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
25/11/2019	25/11/2019	Alteração e Exclusão de Contrato	Inclusão do campo “Data de Liquidação” na Tela de Registro do Contrato a Termo de Moedas, conforme divulgado no Comunicado 030/2019-VPC.
25/11/2019	25/11/2019	Lançamentos	Inclusão do campo “Data de Liquidação” na Tela de Registro do Contrato a Termo de Moedas, conforme divulgado no Comunicado 030/2019-VPC.
26/11/2018	26/11/2018	Moedas Negociadas	Inclusão da Moeda Colón Costarriquenho conforme o comunicado 014/2018 – VPC e 020/2018 – VPC.
29/05/2017	04/04/2018	Contrato a Termo de Moedas	Melhoria da descrição do campo “Contrato Global”
29/05/2017	29/01/2018	Contrato a Termo de Moedas	Melhoria nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
29/05/2017	19/09/2017	Contrato a Termo de Moedas	Melhoria da descrição do campo “Taxa Termo”
29/05/2017	29/05/2017	Contrato a Termo de Moedas	Alteração na regra de preenchimento do campo “Taxa a Termo”, conforme comunicado 024/17.
21/11/2016	27/04/2017	Contrato a Termo de Moedas	Melhoria na descrição dos campos Limites, Superior (Paridade) e inferior (Paridade).
21/11/2016	07/04/2017	Contrato a Termo de Moedas	Alteração na descrição dos campos Cotação – Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD) e Cotação – Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda).
21/11/2016	22/12/2016	Glossário	Inclusão do arquivo Glossário.
21/11/2016	22/12/2016	Informações Adicionais	Inclusão dos arquivos “Cruzamento de Funcionalidades, Regras de Registro Conforme Fonte de Informação, Regras de Negócios, Cross Rate, Moedas Negociadas”.
21/11/2016	21/11/2016	Contrato a Termo de Moedas	Inclusão do campo “Cotação para Fixing”. Conforme comunicado 075/16.
29/08/2016	27/09/2016	Formação dos Códigos do Instrumento Financeiro	Atualização da informação.
29/08/2016	23/09/2016	Termo com Fluxo	Inclusão do módulo.
29/08/2016	29/08/2016	Cessão de Contrato	Inclusão da observação 3).
23/11/2016	22/07/2016	Todo o manual	Inclusão de quantidade de números inteiros e decimais nos campos.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
23/11/2016	22/06/2016	Informações Adicionais	Inclusão do item.
23/11/2016	26/04/2016	Contrato a Termo de Moedas Alteração e Exclusão de Contrato	Alteração na descrição do campo “Fonte de Informação”.
23/11/2016	07/04/2016	Antecipação	Inclusão do campo “Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada)”.
23/11/2015	06/04/2015	Alteração e Exclusão do Contrato	Alteração nas descrições dos campos: CPF/CNPJ da Parte e Contraparte.
23/11/2015	11/03/2016	Contrato a Termo de Moedas Alteração e Exclusão de Contrato	Melhoria no texto da descrição do campo “Fonte de Informação”.
23/11/2015	23/11/2015	-	Criação do manual.

2 INTRODUÇÃO AO TERMO

2.1 Conhecendo o Produto

O Módulo de Contrato do Termo 21 possui o objetivo de contribuir para o desenvolvimento do mercado local de derivativos. Nele, os Participantes podem realizar operações de compra e venda a termo de moedas.

Os contratos a termo são acordos de compra e venda de um ativo em uma data futura, por preço previamente estabelecido. Esses acordos são particulares e são estabelecidos entre dois agentes financeiros, no qual uma das partes assume sua posição de compra no contrato a termo em data específica e por um preço certo e ajustado; e a contraparte assume sua posição de venda em iguais condições.

Termo de Moedas

É realizado através da operação de compra e venda a Termo de Moeda, sem previsão de entrega física, a um preço acordado em uma data futura específica. Nele, os participantes podem escolher qual a taxa de câmbio a ser utilizada para a liquidação dos contratos, que é feita pela diferença entre a taxa de câmbio a termo contratada e a taxa vigente no dia do vencimento.

A operação a termo garante o *hedge* contra oscilações da moeda contratada. Os contratos são liquidados em moeda Real e são adequados, principalmente, para empresas exportadoras, importadoras e companhias que têm ativos e/ou passivos em moeda estrangeira. Além do Dólar dos Estados Unidos, Euro, Libra Esterlina, Iene Japonês e Dólar Canadense, são aceitos registros de contratos em diferentes moedas de referência de diversos outros países.

Uma das principais vantagens no registro do Termo de Moedas na Cetip é a livre negociação do tamanho do contrato, prazo de vencimento e taxa. Como também, a possibilidade de cotação do câmbio pela Ptax média do dia, pelas taxas apuradas pelo Banco Central a cada meia hora nos boletins intermediários, ou pelas cotações divulgadas pelos provedores internacionais de informações (*feeders*) de moedas.

Os participantes podem usar as taxas de câmbio divulgadas pelo Banco Central ou pelos *feeders* do mercado de moedas, como Reuters, Broadcast, BCE e Bloomberg.

Os contratos realizados com clientes do tipo 1 e 2 devem ter seus comitentes finais identificados diretamente na função de Registro de Contrato, no momento da sua inclusão.

Modalidades de Contrato

São permitidos os registros de Contratos à Vista, à Vista decorrido, a Termo ou a Termo decorrido para as modalidades abaixo:

- **Termo de Paridade:** permite o uso de outras moedas estrangeiras como referência, sendo que os contratos podem ser referidos e referenciados em uma relação de moedas distintas, incluindo o Real.
- **Termo Asiático:** a taxa de câmbio para liquidação do contrato é resultante da média aritmética simples ou ponderada de várias cotações das taxas de câmbio vigentes para datas definidas no Registro do Contrato.

Observação: Se na data do evento houver inadimplência, o participante titular da conta cliente tem a possibilidade de informar esta situação na função Informar Não Pagamentos de Eventos, no Módulo Operações, desta forma o Módulo altera a situação do evento para Retirado por Inadimplência.

2.2 Ações dos Botões das Telas

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

Botão	Funcionalidade
Limpar campos	Limpa todos os campos selecionados e digitados.
Confirmar	Confirma os dados informados em tela.
Pesquisar	Submete os dados selecionados para pesquisa.
Excluir	Permite a exclusão de lançamentos pendentes de contraparte ou dos contratos selecionados.

3 LANÇAMENTOS

3.1 Contrato a Termo de Moedas

Termo > Termo21 > Contrato a Termo de Moedas

Visão Geral

Esta função permite efetuar o registro dos quatro tipos de modalidade de Contrato a Termo: Termo de Paridade e/ou Termo de Moedas Asiático ou Termo de Termo.

O Registro depende do lançamento de dados dos participantes envolvidos. É feito por duplo comando, pela parte e contraparte, e este somente é efetivado se não apresentarem divergências nos lançamentos. Quando contrato realizado entre o participante e seu cliente, tipo de conta 1 ou entre clientes 1 do Participante, o contrato é registrado por comando único do participante, ou seja, não é necessária a confirmação da contraparte.

Os contratos realizados com clientes do tipo 1 e 2 devem ter seus comitentes finais identificados diretamente nesta função, no momento da inclusão do Contrato.

Para que o lançamento seja efetuado, após o preenchimento dos campos na tela, clique no botão **Confirmar**.

De acordo com a informação dos campos Fonte de Informação e Taxa média para Termo Asiático e Termo de Termo a ser utilizada.

Após a confirmação do lançamento, o sistema envia mensagem informando:

- O número do contrato e o número da operação que podem ser visualizados na consulta **Operações**.

O número do lançamento que pode ser visualizado na consulta **Lançamentos**, quando registro efetuado entre um participante e outro membro que não seja seu cliente.

Observações:

Para o registro de Contrato a Termo, o Real deve ser informado como Moeda Cotada e a Moeda Estrangeira como Moeda Base (Parâmetro equivalente a Moeda de Referência na antiga tela de registro).

É possível o registro de Contrato a Termo de Moeda entre Fundos de Investimento.

Informações sobre **Cross Rate** e **Moeda de Referência** acesse o capítulo Informações Adicionais.

Informação sobre cálculo da liquidação no vencimento acesse o **Caderno de Fórmulas** no *site* da B3.

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

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

Tela de Registro

Contrato a Termo de Moedas				
Lançamento do Participante (Conta)		Posição do Participante		CPF/CNPJ Cliente Participante
<input type="text"/>		<input type="text"/>		<input type="text"/>
Contraparte(Conta)		Contrato Global		CPF/CNPJ Cliente Contraparte
<input type="text"/>		NÃO <input type="text"/>		<input type="text"/>
Características				
Nº Controle Interno	Valor Base(Referência)	Data de Operação	Data de Vencimento	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	2 / 9 / 2020	<input type="text"/>	
Moeda Base(Referência)	Moeda Cotada	Taxa a Termo		
USD (220) - DOLAR DOS EUA <input type="text"/>	BRL (790) - REAL <input type="text"/>	<input type="text"/>		
Ajuste de Taxa				
Ajustar Taxa	Responsável pelo Ajuste de Taxa	Data Inicial para Ajuste de Taxa	Data Final para Ajuste de Taxa	
NÃO <input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Média Asiática				
Taxa média para Termo Asiático		Quantidade de Datas de Verificação		
<input type="text"/>		<input type="text"/>		
Fonte de Informação				
Cross Rate na Avaliação?	Fonte de Informação	Cotação para o Vencimento	Boletim	Fonte de Consulta
NÃO <input type="text"/>	SISBACEN <input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Tela ou Função de Consulta	Praça de Negociação	Horário de Consulta	Cotação - Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)	Cotação - Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Data de Avaliação				
<input type="text"/>				
Termo a termo				
Termo de Termo	Data de Fixação	Cotação para Fixing	Forma de Atualização	Valor/Percentual Negociado
NÃO <input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Atualizar Valor Base?	Cotação Inicial			
<input type="text"/>	<input type="text"/>			
Limite				
Limites	Superior (Paridade)		Inferior (Paridade)	
<input type="text"/>	<input type="text"/>		<input type="text"/>	
Prêmio				
Prêmio a ser pago pelo	Valor do Prêmio (R\$)	Data de Liquidação		
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>		
Modalidade de Liquidação				
<input type="text"/>				
Observação				
Observação <input type="text"/>				
Código Identificador <input type="text"/>				
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>				

Descrição dos Campos da Tela de Registro Termo de Moedas Asiático

Campo	Descrição
Contrato a Termo de Moedas	
Lançamento do Participante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip do participante para quem está sendo lançando o contrato.
Posição do participante	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou comprador Indica a posição assumida pelo participante.

Campo	Descrição
CPF/CNPJ Cliente Participante	<p>Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ previamente cadastrado no SIC.</p> <p>Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. E as combinações possíveis são: Própria X Própria, Cliente X Própria, Cliente X Cliente.</p>
Contraparte (Conta)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip da outra parte envolvida no contrato.</p>
Contrato Global	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Indica se o contrato registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Sim ou Não</p>
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	<p>Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.</p> <p>Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. E as combinações possíveis são: Própria X Própria, Cliente X Própria, Cliente X Cliente.</p>
Características	
Nº Controle Interno	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informado com até 10 (dez) inteiros.</p> <p>Número de identificação do lançamento indicado pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.</p> <p>Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.</p>
Valor Base (Referência)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informado com até 14 (quatorze) inteiros e 2 (dois) decimais.</p> <p>Valor base do contrato expresso em quantidades da moeda de referência.</p> <p>Quando casas decimais não preenchidas, o sistema preenche com zeros.</p>
Data de Operação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data em que o participante contratou a operação. Pode ser informada em até D-2 útil anterior à data do sistema, quando a contraparte na operação é um de seus clientes, tipo de conta 1. Data de início do contrato, se contrato registrado à vista.</p>
Data de Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data de vencimento do contrato. Livrementemente pactuada entre os participantes. A data de vencimento do contrato pode ser indicada em dias não uteis. Caso o ajuste caia em dia não útil, o comportamento do sistema deve ser como ocorre em outros casos, de gerar o ajuste para o próximo dia útil conhecido.</p>
Moeda Base (Referência)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a moeda objeto do contrato a termo.</p>

Campo	Descrição
Moeda Cotada	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a moeda de referência para apuração da atualização do contrato.
Taxa a Termo	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 4 (quatro) inteiros e 6 (seis) decimais quando Moeda Base (Referência) escolhida for USD (Dólar dos Estados Unidos) e com 8 (oito) casas decimais para outras moedas. Valor da taxa de câmbio contratada. Esta taxa é utilizada na apuração do resultado do contrato. Para contrato com registro a termo: <ul style="list-style-type: none"> ➤ Campo não deve ser preenchido quando fonte de informação for SISBACEN. ➤ Campo de preenchimento opcional quando a fonte de informação for FEEDER; SPOT ou SISBACEN/FEEDER. Obs.: No cálculo de média asiática de USD será utilizada até 8 (oito) casas decimais, entretanto, nas consultas, serão apresentadas apenas até 6 (seis) decimais.
Ajuste de Taxa	
Ajustar Taxa	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: SIM ou NÃO. Indica se o contrato conta com Shift, ou seja, modificação da taxa forward. Em caso da opção ser SIM a função retornará os seguintes campos: Responsável pelo Ajuste de Taxa, Data Inicial para ajuste de taxa, Data Final para ajuste de taxa.
Responsável pelo Ajuste de Taxa	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa de seleção com as opções: Comprador, Vendedor ou Comprador e Vendedor. Indicar o responsável pelo ajuste de taxa. O Participante pode ou não ajustar a taxa no período contratado.
Data Inicial para Ajuste de Taxa	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Indica o início do período estipulado para o ajuste de taxa pelo Participante responsável. Para lançamento do contrato com os campos “ Ajustar Taxa ” e “ Termo de Termo ” preenchidos com as Opções: SIM e SIM: A data inicial para ajuste de taxa deve ser igual ou superior a D+1 útil da data de fixação. SIM e NÃO: A data inicial para ajuste da taxa deve ser igual ou superior a D+1 útil do lançamento do contrato.
Data Final para Ajuste de Taxa	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Indica o final do período estipulado para o ajuste de taxa pelo Participante responsável. Deve ser igual ou inferior a D-1 útil da data de vencimento do contrato. Deve ser igual ou superior a D+1 útil da Data Inicial para ajuste de taxa.
Média Asiática	

Campo	Descrição
Taxa média para Termo Asiático	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Aritmética simples e Aritmética ponderada. Indica o tipo de média para a taxa de câmbio para liquidação do contrato.</p> <p>Só preencher quando opção de contrato for à modalidade Termo Asiático. Após a escolha da opção é apresentado o item Datas de Verificação para a inclusão dos dados complementares.</p>
Quantidade de Datas de Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informado com até 3 (três) inteiros.</p> <p>Quantidade de Datas de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada ou simples.</p>
Fonte de Informação	
Cross Rate na Avaliação?	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>O participante deve marcar este campo quando optar pela utilização desta opção.</p> <p>O uso desta opção não é permitido, quando moeda de referência ou cotada for Dólar dos EUA e quando a fonte de informação for Sisbacen.</p>
Fonte de Informação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Sisbacen, <i>Feeder</i>, <i>Spot</i> e <i>Sisbacen/Feeder</i>. Quando opção for <i>Spot</i> a moeda de referência deve ser Moeda Base =USD (Dólar Americano) e Moeda Cotada = BRL (Real).</p> <p>Indica a fonte a ser utilizada para a cotação de fixing para vencimento.</p> <p>Exclusivamente para a fonte de Informação <i>Feeder</i>, no caso específico em que a fonte de informação para formação da Taxa a Termo (Forward) seja o ECB/BCE (Banco Central Europeu), mas esta fonte seja diferente da que será utilizada para a formação do fixing para vencimento, a fonte BCE/ECB deve ser informada exclusivamente no campo "Observação".</p> <p>Quando a Fonte de Informação for FEEDER ou SPOT, é possível a indicação do Fixing em D0, informando Spot D0 no campo "Tela ou Função de Consulta Função de Consulta".</p> <p>A regra é válida para geração de eventos de Resgate de Termo de Moedas e para eventos de fixing dos contratos de termo de Asiático.</p> <p>De acordo com a Modalidade do Contrato ou a Fonte de Informação a ser utilizado para a consulta de cotação, o módulo apresenta campos diferentes a ser preenchidos. A descrição dessas diferenças encontra-se no capítulo Introdução ao Termo de Moedas/Conhecendo o Produto ou no capítulo Informações Adicionais/Regras de Registro Conforme Fonte de Informação.</p>
Cotação para o Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.</p> <p>Indica a data de cotação para o vencimento.</p>
Boletim	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>18h00minh-Fechamento. Boletim de fechamento de cotação da moeda.</p>

Campo	Descrição
Fonte de Consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Spot, Reuters, Broadcast, Bloomberg, BCE e outros. Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda.</p>
Tela ou Função de Consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que deve ser utilizada pelos Participantes para cotação.</p> <p>Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.</p> <p>É possível informar Spot D0 quando a fonte de informação for FEEDER ou SPOT.</p>
Praça de Negociação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Local de negociação da moeda de referência.</p> <p>Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo de Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.</p>
Horário de Consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Horário de verificação da taxa de câmbio. Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo de Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.</p>
Cotação – Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)	<p>A taxa de câmbio utilizada para avaliação.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: “VENDA”, “COMPRA” e MÉDIA.</p> <p>Informar quando a fonte de informação para taxa de câmbio no contrato for “FEEDER”, “SPOT” ou “SISBACEN/FEEDER”.</p>
Cotação – Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	<p>A taxa de câmbio utilizada para avaliação.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: “NENHUM”, “VENDA”, “COMPRA” e MÉDIA.</p> <p>Informar quando a fonte de informação para taxa de câmbio no contrato for “FEEDER”, “SPOT” ou “SISBACEN/FEEDER”.</p> <p>Caso o contrato não possua Cross Rate na avaliação, o campo deve ser preenchido com a opção “NENHUM”.</p> <p>Caso o contrato possua Cross Rate na avaliação, o campo deve ser preenchido com uma das seguintes opções: “VENDA”, “COMPRA” ou MÉDIA.</p>

Campo	Descrição
Data de Avaliação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data pactuada entre as partes para indicar a partir de quando será possível avaliar o contrato. A última data em que o contrato for avaliado apresentará a cotação utilizada para a liquidação financeira do mesmo.</p> <p>A data de avaliação deve ser maior que a data de início do contrato e até D-1 da data de vencimento do contrato.</p> <p>Quando for opção asiática deve coincidir com a primeira data de verificação.</p> <p>Quando for Spot D0 a data é a do vencimento do contrato.</p>
Termo a Termo	
Termo de Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: SIM ou NÃO. Informa se o contrato terá seu início em data futura.</p> <p>A opção SIM aciona os campos: "Data de Fixação", "Valor/Percentual Negociado" e "Forma de Atualização" de preenchimento obrigatório.</p>
Data de Fixação	<p>Campo de preenchimento obrigatório se Termo de Termo = SIM.</p> <p>Data em que o contrato terá início, se registrado a termo.</p> <p>Nas operações de termo de termo, o campo "Cotação para Fixing" é utilizado como referência para a definição da cotação da taxa a termo do contrato e também indica a data de fixing para a atualização do valor base (para contratos com "Atualiza Valor Base?" = SIM).</p> <p>Observação: É permitido que os titulares (Parte e Contraparte) do Contrato possam informar a Taxa de Fixação de Termo de Termo antes da data Informada na "Data de Fixação". Isto é, durante o período de Termo, antes do início do contrato. O Contrato deve ter a Fonte de Informação SISBACEN/FEEDER.</p>
Cotação para Fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando o campo "Termo de Termo" for marcado com "SIM".</p> <p>Caixa com as opções: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.</p> <p>Para o cálculo da moeda de início do período do Termo, é considerado o deslocamento indicado no campo "Cotação para Fixing" em relação ao campo "Data de Fixação".</p> <p>Para contrato "Atualizar Valor Base?" = SIM, também indica o deslocamento a ser aplicado na data informada no campo "Data de Fixação" para captura da cotação final para atualização do valor base.</p> <p>Para o cálculo de IOF o sistema considera o campo "Data de Fixação" juntamente com o campo "Cotação para Fixação". Por exemplo: Data de Fixação: 11/dez/15 e Cotação para Fixação: D-3. O IOF é considerado desde o dia 08/dez/15</p>
Forma de Atualização	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Valor ou Percentual. Indica a forma de atualização da taxa inicial apurada na data início do contrato.</p>

Campo	Descrição
Valor/Percentual Negociado	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais.</p> <p>Informar o valor ou percentual negociado para ser aplicado para atualização da taxa inicial na data início do contrato.</p> <p>Quando casas decimais não preenchidas, o sistema preenche com zeros.</p>
Atualizar Valor Base?	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Campo com as opções: SIM e Vazio. Indica se o valor base do contrato será atualizado no período a termo.. Só é possível indicar “Atualizar Valor Base?” = SIM quando o campo “Termo de Termo” = SIM.</p> <p>Quando o campo “Taxa média para Termo Asiático = ARITMÉTICA PONDERADA”, o campo “Atualizar Valor Base?” deverá ficar vazio.</p> <p>* Para mais informações sobre a metodologia de cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas do Termo..</p>
Cotação Inicial	<p>Para contrato Termo a Termo com atualização do valor base.</p> <p>Campo destinado a informar a cotação inicial da paridade que será utilizada para a atualização do valor base no período a termo.</p>
Limite	
Limites	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Superior, Inferior ou Superior/Inferior. Informar se o contrato conta com limitador de variação de valorização do contrato.</p>
Superior (Paridade)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informado com até 6 (seis) inteiros e 8 (oito) decimais.</p> <p>Paridade máxima aceita pelos participantes para correção do contrato.</p> <p>Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja maior que o valor definido no campo Superior, o sistema utilizará o valor preenchido neste campo para corrigir o contrato.</p>
Inferior (Paridade)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informado com até 6 (seis) números inteiros e 8 (oito) decimais.</p> <p>Paridade mínima aceita pelos participantes para correção do contrato.</p> <p>Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja menor que o valor definido no campo Inferior, o sistema utilizará o valor preenchido neste campo para corrigir o contrato.</p>
Prêmio	
Prêmio a ser pago pelo	<p>Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.</p> <p>Indicar a Parte que pagará o prêmio na data informada no campo Data de Liquidação, se houver</p>

Campo	Descrição
Valor do Prêmio (R\$)	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. Informado com até 14 (quatorze) inteiros e 2 (dois) decimais. Informar o valor em reais (R\$) do prêmio total a ser pago na data informada no campo Data de Liquidação.
Modalidade de Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. Caixa de seleção com as opções: Bilateral, Bruta ou Sem Modalidade. Indicar a modalidade de liquidação da operação de prêmio na data informada no campo Data de Liquidação. Operações Mercado x Cliente deverão ser obrigatoriamente na “Sem Modalidade”
Data de Liquidação	Campo de preenchimento opcional. Indica a data de liquidação do prêmio. Permitida a inclusão de qualquer data útil entre a data de registro (inclusive) e a data de vencimento (inclusive).
Observação	
Código Identificador	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Código de controle interno do participante.
Observação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Campo destinado ao complemento da descrição do contrato. Texto livre com até 280 caracteres.
Datas de Verificação	
Data Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Data(s) de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada ou aritmética simples. A última data de verificação tem que ser igual a data de vencimento do contrato. Pode ser igual ou superior a data de início do contrato.
Valor Referência	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 10 (dez) inteiros. Valor definido para data de referência, o qual é utilizado no cálculo da taxa média aritmética ponderada. O somatório destes valores deve ser igual ao Valor Base.
Pesos (%)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Indica a Porcentagem do Valor Base na data de verificação para a apuração da taxa média aritmética ponderada. Observação: Calculado pelo sistema automaticamente, quando informado o Valor Referência.

Ao clicar no botão **CONFIRMAR**, o sistema apresenta tela para confirmação.

Observação				
				Código Identificador
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Desistir"/>				
Contrato a Termo de Moedas				
Lançamento do Participante (Conta)	Posição do Participante	CPF/CNPJ Cliente Participante		
05000.10-8	COMPRADOR	233.110.534-00		
Contraparte(Conta)	Contrato Global	CPF/CNPJ Cliente Contraparte		
05000.00-5	NÃO			
Características				
Nº Controle Interno	Valor Base(Referência)	Data de Operação	Data de Vencimento	
2266	1.000.000,00	02/09/2020	02/09/2021	
Moeda Base(Referência)	Moeda Cotada	Taxa a Termo		
USD (220) - DOLAR DOS EUA	BRL (790) - REAL			
Ajuste de Taxa				
Ajustar Taxa	Responsável pelo Ajuste de Taxa	Data Inicial para Ajuste de Taxa	Data Final para Ajuste de Taxa	
NÃO				
Média Asiática				
Taxa média para Termo Asiático		Quantidade de Datas de Verificação		
Fonte de Informação				
Cross Rate na Avaliação?	Fonte de Informação	Cotação para o Vencimento	Boletim	Fonte de Consulta
NÃO	SISBACEN	D-1	PTAX800 de Fechamento	
Tela ou Função de Consulta	Praça de Negociação	Horário de Consulta	Cotação - Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)	Cotação - Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)
Data de Avaliação				
Termo a termo				
Termo de Termo	Data de Fixação	Cotação para Fixing	Forma de Atualização	Valor/Percentual Negociado
SIM	30/09/2020	D-1	PERCENTUAL	1,50000000
Atualizar Valor Base?	Cotação Inicial			
SIM	5,30000000			
Limite				
Limites Superior (Paridade)		Inferior (Paridade)		
Prêmio				
Prêmio a ser pago pelo	Valor do Prêmio (R\$)	Data de Liquidação	Modalidade de Liquidação	
Observação				
				Observação
				Código Identificador
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Desistir"/>				

Ao clicar no botão **CONFIRMAR**, o sistema apresenta código do contrato registrado.

Contrato 20100021699 registrado sob o No. CETIP 2020090316333768

3.2 Antecipação

Termo > Termo21 > Antecipação

Visão Geral

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 dessa operação pode ser feito a partir do primeiro dia útil subsequente a data de registro ou a data de início do contrato, o que for menor, e até o dia útil anterior (D-1) ao vencimento da opção.

Quando a antecipação for para um contrato de modalidade Asiático com média ponderada é permitida a antecipação não linear, onde o participante determina quanto deve ser antecipado de cada valor de referência.

Em casos de antecipação de contrato com limitadores, as cotações informadas pelos Participantes serão utilizadas como base para apuração do valor financeiro da operação, sem realizar o corte da paridade.

Não é permitida antecipação de contrato caso tenha sido realizada avaliação em data igual ou posterior a data de avaliação prevista no registro de contrato.

O valor da antecipação deve ser apurado com base no indicador econômico e nas demais condições pactuadas no contrato, refletindo as condições de mercado na ocasião de seu lançamento.

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.

Observações:

- 1) A liquidação financeira da antecipação de um contrato é gerada na modalidade BILATERAL e, nos casos em que esta não esteja mais disponível, na modalidade BRUTA. As operações realizadas entre o Participante e seus Clientes 1 ou 2, ou aquelas com financeiro igual a zero, são exclusivamente geradas na modalidade SEM MODALIDADE.
- 2) Para contratos com a atualização do notional no período a termo ("Atualizar Valor Base = SIM"), a antecipação só é permitida após a Data de Fixação.
- 3) Informação sobre cálculo da liquidação antecipada acesse o Caderno de Fórmulas no site da B3.

Tela Filtro de Antecipação

Antecipação de Contrato	
Contrato	<input type="text" value="15J00000908"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Após informação do nº do contrato que se deseja antecipar é apresentada Tela de Detalhe.

De acordo com a modalidade do contrato e a Fonte de Informação utilizada para a consulta de cotação, o módulo apresenta campos diferentes a serem preenchidos.

Contratos de Termos de Moeda com Agenda de Redutor de Risco de Crédito

1) O registro de antecipação total de contrato gera antecipação de agenda de redutor de risco de crédito com liquidação financeira do saldo pela mesma modalidade de liquidação da operação do contrato original.

2) As antecipações parciais não gerarão operações de antecipação de agenda de redutor de risco de crédito, as antecipações parciais ocorridas no contrato original deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

Tela Detalhe de Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato	
Lançamento do Participante (Conta)	<input type="text" value="05000"/> <input type="text" value="10"/> <input type="text" value="8"/>
Contraparte(Conta)	<input type="text" value="05000"/> <input type="text" value="00"/> <input type="text" value="5"/>
Nº Controle Interno	<input type="text" value="3669"/>
Contrato	16B00004592
Valor Base a Antecipar	<input type="text" value="5000"/> , <input type="text"/>
Data Antecipação	<input type="text" value="7"/> / <input type="text" value="4"/> / 2016
Taxa a Termo	<input type="text" value="6"/> , <input type="text" value="26"/>
Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada)	<input type="text" value="3"/> , <input type="text" value="2"/>
Taxa de Juros (%)	<input type="text" value="0"/> , <input type="text" value="53"/>
Liquidante (Conta)	<input type="text"/> <input type="text"/> <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Após a confirmação do lançamento da antecipação, o sistema envia mensagem informando:

- O número da operação realizada, o código do contrato e o valor financeiro calculado a receber, quando efetuado o lançamento da antecipação.

Conforme mensagem a seguir:

Antecipação do contrato 15J00000908 sob o No. CETIP 2015101413105306 Realizada Com Sucesso

Descrição dos Campos da Tela Detalhe Antecipação de Contrato

Campo	Descrição
Lançamento do Participante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip do membro envolvido na operação.

Campo	Descrição
Contraparte (Conta)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código Cetip que identifica o membro com quem foi efetuado o contrato.</p>
Número Controle Interno	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informado com até 10 (dez) inteiros.</p> <p>Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.</p> <p>Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.</p>
Contrato	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro.</p>
Valor Base a Antecipar	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informado com até 14 (quatorze) inteiros e 2 (dois) decimais.</p> <p>É valor que se deseja antecipar. Pode representar parte ou a totalidade do valor base registrado no contrato ou do saldo remanescente do mesmo.</p> <p>Observações: Quando contrato Asiático com média ponderada este campo deve ser preenchido com valor igual à soma dos valores a antecipar informado em cada data de verificação (dados complementares).</p>
Data Antecipação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Este campo deve ser preenchido quando se deseja efetuar uma Antecipação Retroativa com cliente 1. Deve ser preenchido em no máximo D-2 útil anterior à data do sistema.</p>
Taxa a Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais.</p> <p>Campo exclusivo para Termo de Paridade/Asiático.</p>
Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Disponível apenas quando o campo "Taxa Cotada" for preenchido com moeda diferente de BRL (790) – REAL.</p>
Taxa de Juros %	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informado com até 2 (dois) inteiros e 8 (oito) decimais.</p> <p>A função permite a antecipação de contrato de Termo de Moedas onde a taxa de juros indicada pode assumir valor positivo, negativo ou nulo.</p> <p>Expressa em % ao ano, para 252 dias úteis com tratamento exponencial.</p>

Campo	Descrição
Liquidante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Código Cetip do Banco Liquidante que fará a liquidação financeira da operação. Caso o campo não seja preenchido, o sistema assumirá o Banco Liquidante Principal.
Datas de verificação - Dados complementares para contrato com modalidade Termo Asiático com média ponderada – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Data	Data(s) de referência para apuração da atualização da Taxa Média Aritmética Ponderada .
Valor Referência	Valor definido para data de referência, o qual deve ser utilizado no cálculo da Média Aritmética Ponderada . Informado com até 14 (quatorze) inteiros e 2 (dois) decimais.
Valor a Antecipar	Valor a antecipar do Valor Referência indicado.

3.3 Intermediação de Contrato

Termo > Termo21 > Intermediação de Contrato

Visão Geral

A intermediação de um contrato é registrada pela digitação de ambas as partes envolvidas, o Intermediador, que promove o encontro das partes interessadas em realizar determinado contrato e, conseqüentemente, recebe o percentual de comissão acordada; e o Participante, quem paga a comissão. Pode ser efetuada somente no dia do registro do contrato.

É possível a intermediação de um contrato de Termo de Moedas.

A comissão incide sobre o valor base e o participante pode visualizar o valor a pagar ou a receber na consulta **Operações**.

Observação: Informação sobre cálculo da comissão de Intermediação acesse o **Caderno de Fórmulas** no *site* da B3.

Tela de Intermediação de Contrato

Intermediação de Contrato

Lançamento do Participante (Conta)

Posição do Participante

Contraparte(Conta)

Nº Controle Interno

Contrato

Comissão(%) ,

Momento do Pagamento

Liquidante (Conta)

Modalidade de Liquidação

Após a confirmação do lançamento, o sistema envia tela de mensagem informando:

- O número da operação e o número do contrato, quando as duas partes envolvidas na operação efetuaram o lançamento.

Campo	Descrição
Lançamento do Participante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip do participante que está efetuando o lançamento da intermediação.
Posição do Participante	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Intermediador ou Intermediado. Indica o papel assumido pelo membro que está efetuando o lançamento da intermediação.
Contraparte (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip do outro membro envolvido na operação.
Nº Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 10 (dez) inteiros. Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.
Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro.
Comissão (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 2 (dois) inteiros e 4 (quatro) decimais. Valor percentual que deve ser aplicado sobre o Valor Base Inicial ou Valor Base Final da operação, a ser paga ao intermediador.
Momento do Pagamento	Campo de preenchimento obrigatório. Indica que a comissão deve ser paga no início do contrato. Não é permitido registros de intermediação com liquidação do valor da comissão na data do vencimento do contrato. O pagamento da comissão de intermediação deve ser na data de registro do contrato.
Liquidante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Código Cetip do Banco Liquidante que deve efetuar a liquidação financeira da operação. Caso o campo não seja preenchido, o sistema assume o Banco Liquidante principal.
Modalidade de Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Forma de liquidação financeira da operação.

3.4 Cessão de Contrato

Termo > Termo21 > Cessão de Contrato

Visão Geral

Um dos participantes envolvidos no contrato pode ceder a um terceiro o contrato registrado anteriormente, desde que exista anuência da contraparte. A cessão pode ocorrer entre a data de registro até a data anterior de vencimento do contrato, sempre pelo valor total.

Contrato entre contas 00 e 10 do mesmo participante, ao ceder a ponta da conta 10 para uma conta 20 de outro ou mesmo participante, é necessário efetuar a confirmação do anuente.

A cessão de contrato também pode ser entre conta Participante e Cliente 1 para conta Cliente 2 do mesmo participante, que possuam o mesmo CPF ou CNPJ.

Cessão e Pagamento de Prêmio

Somente o Cedente ou o Adquirente pode ser titular da operação de pagamento de prêmio. O adquirente paga prêmio da cessão, quando o Cedente for o Lançador do contrato e recebe o prêmio, quando o Cedente for o Titular.

A operação de prêmio somente é gerada após lançamento da operação de confirmação da cessão pelo Anuente. O pagamento de prêmio é efetuado simultaneamente à respectiva liquidação financeira.

- Os direitos ou obrigações do cedente nos pagamentos de prêmios agendados nos registros do contrato anterior a cessão são transferidos para o adquirente.

Observações:

- Caso o Anuente não confirme a cessão, até o encerramento do horário estabelecido para a grade sem liquidação no STR (Sem modalidade), a mesma não é processada, permanecendo o contrato com suas condições originais.
- Não é permitida a cessão de contrato de Termo de Moedas com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.
- O sistema deve impedir a realização de uma nova cessão caso já exista uma Cessão com status diferente de “Finalizada” e “Cancelada”.

Tela Cessão de Contrato

Cessão de Contrato

Lançamento do Participante (Conta)

Posição do Participante

Contraparte (Conta)

CPF/CNPJ (Cedente)

CPF/CNPJ (Adquirente)

Nº Controle Interno

Contrato

Valor do Prêmio ,

Titular do Prêmio

Após a confirmação do lançamento, o sistema envia tela de mensagem informando:

- O número da operação e o número do contrato, quando as duas partes envolvidas na operação efetuaram o lançamento.

Descrição dos Campos da Tela Cessão de Contrato

Campo	Descrição
Lançamento do Participante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip do participante que está efetuando o lançamento: Cedente ou Adquirente.
Posição do participante	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Cedente ou Adquirente. Identifica o participante que está efetuando o lançamento.
Contraparte (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip do outro participante envolvido na operação: Cedente ou Adquirente.
CPF/CNPJ (Cedente)	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.
CPF/CNPJ (Adquirente)	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.
Nº Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 10 (dez) inteiros. Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.
Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro do mesmo.
Valor do Prêmio	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 14 (quatorze) inteiros e 2 (dois) decimais. Valor do prêmio a ser pago. Não é necessário que o valor do prêmio seja o mesmo pago na operação original. Caso o campo não seja preenchido as partes não se obrigam, ou seja, apenas realizam a cessão do contrato.
Titular do Prêmio	Preenchimento obrigatório se for preenchido o campo Valor do Prêmio. Indica a ponta que deve pagar o prêmio, se houver.

3.5 Alteração e Exclusão de Contrato

Termo > Termo21 > Alteração e Exclusão de Contrato

Visão Geral

Esta função permite ao participante com perfil de SUPERVISOR ou DIGITADOR, alterar ou excluir os contratos realizados entre Participantes distintos, contratos realizados entre sua conta própria e seus Clientes 1 e 2, assim como contratos realizados entre seus Clientes 1, no período de 1 até 3 dias úteis após o registro, não podendo o mesmo encontrar-se VENCIDO ou CEDIDO.

Quando operação efetuada entre clientes 1 do participante ou entre o participante e seu cliente 1, é necessário apenas o lançamento do participante. No caso de contrato entre Participantes ou entre o Participante e seu cliente 2, o duplo lançamento é obrigatório.

A alteração/exclusão do contrato deve obedecer a Grade Sem Liquidação STR - CTP11 e não pode ocorrer na data do vencimento do mesmo.

O contrato pode ser alterado mais de uma vez no mesmo dia desde que a alteração anterior esteja confirmada ou cancelada. **Contratos de Termos de Moeda com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.**

A alteração de contrato de Termos de Moeda que afete Redutor de Risco de Crédito não gera alteração de Agenda de Redutor de Risco de Crédito, tais alterações devem ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos - MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

Observações:

Alterações e exclusões não envolvem financeiro;

A consulta de Operações é sensibilizada no NoMe. Na consulta Operações, é gerada uma operação, cujo campo Tipo de Operação exibe a informação Alteração, campo Modalidade com Sem Modalidade de Liquidação e o campo Situação recebe status FINALIZADA;

Na consulta Contratos é exibida a informação atualizada, no campo que sofreu a alteração;

O código da operação é 099, se realizada pelo mercado e 098, se realizada pela B3.

Disponibilização ao participante do relatório RALTERAÇÕES, através do Nome/Transferência de Arquivos/Arquivo/Receber Relatórios, em formato.pdf. A Emissão desse relatório é no dia seguinte ao da retificação do contrato e no próprio são exibidos os detalhes do contrato, antes e depois da alteração;

No relatório RMAPAMOVTERMOPDF também são exibidas as operações de alterações realizadas.

Tela Filtro de Alteração e Exclusão de Contrato

Alteração e Exclusão de Contrato	
Código IF	<input type="text" value="15J00000908"/>
Posição do Participante	<input type="text" value="v"/>
Ação	<input type="text" value="CORRECAO v"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Após o preenchimento do nº do contrato que se deseja alterar, clique no botão **Confirmar**, o módulo apresenta tela com os dados preenchidos conforme no registro do contrato.

Descrição dos Campos da Tela Filtro de Alteração e Exclusão de Contrato

Campo	Descrição
Código IF	Número do Contrato que deseja alterar ou excluir.
Posição do Participante	Caixa de seleção com as opções: COMPRADOR e VENDEDOR COMPRADOR parte compradora do contrato e VENDEDOR parte vendedora do contrato.
Ação	Caixa de seleção com as opções: CORREÇÃO, ADITAMENTO e EXCLUSÃO.

Tela de Correção de Contrato

Alteração e Exclusão de Contrato				
Código IF 20100021699				
Lançamento do Participante (Conta)		Posição do Participante	CPF/CNPJ Cliente Participante	
[5000][.][10][.][8]		COMPRADOR	233.110.534-00	
Contraparte(Conta)		Contrato Global	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	
05000[.][00][.][5]		NÃO		
Características				
Nº Controle Interno	Valor Base(Referência)	Data de Operação	Data de Vencimento	
	1000000[.][]	2[.][9][.][2020]	2[.][9][.][2021]	
Moeda Base(Referência)	Moeda Cotada	Taxa a Termo		
USD (220) - DOLAR DOS EUA	BRL (790) - REAL	[.][.][]		
Ajuste de Taxa				
Ajustar Taxa	Responsável pelo Ajuste de Taxa	Data Inicial para Ajuste de Taxa	Data Final para Ajuste de Taxa	
NÃO		[.][.][.][]	[.][.][.][]	
Média Asiática				
Taxa média para Termo Asiático	Quantidade de Datas de Verificação			
	[]			
Fonte de Informação				
Cross Rate na Avaliação?	Fonte de Informação	Cotação para o Vencimento	Boletim	Fonte de Consulta
NÃO	SISBACEN	D-1	PTAX800 de Fechamento	
Tela ou Função de Consulta	Praça de Negociação	Horário de Consulta	Cotação - Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)	Cotação - Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)
Data de Avaliação				
	[.][.][.][]			
Termo a termo				
Termo de Termo	Data de Fixação	Cotação para Fixing	Forma de Atualização	Valor/Percentual Negociado
SIM	30[.][9][.][2020]	D-1	PERCENTUAL	1[.][.][.][50000000]
Atualizar Valor Base?	Cotação Inicial			
SIM	5[.][.][.][30000000]			
Limite				
Limites	Superior (Paridade)		Inferior (Paridade)	
	[.][.][.][]		[.][.][.][]	
Prêmio				
Prêmio a ser pago pelo	Valor do Prêmio (R\$)		Data de Liquidação	
Modalidade de Liquidação				
Observação				
Observação				
Código Identificador				
[]				
Complementos para IOF				
Data de Registro	Valor Total Antecipado			
3[.][9][.][2020]	[.][.][.][]			
Valor Base Remanescente Início IOF				
Operações				
Data Cessão	Valor Cessão			
[.][.][.][]	[.][.][.][]			
Quantidade Antecipações				
[]				
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>				

Descrição dos Campos da Tela de Correção de Contrato

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório ou não, igual ao do registro.	
Alteração e Exclusão do Contrato	
Código IF	Código do contrato.
Lançamento do Participante (Conta)	Código Cetip do participante para quem está sendo lançado o contrato.
Posição do Participante	Indica a posição assumida pelo participante. Campo bloqueado para alteração
CPF/CNPJ Cliente Parte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.
Contraparte (Conta)	Código Cetip da outra parte envolvida no contrato.
Contrato Global	Caixa de seleção com as opções: SIM e NÃO. Indica se o contrato que está sendo registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos.
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.
Características	
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Informado até 10 (dez) inteiros. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.
Valor Base (Referência)	Valor base do contrato expresso em quantidades da moeda de referência. Informado com 14 (quatorze) inteiros e 2 (dois) decimais.
Data de Operação	Data em que o participante contratou a operação. Pode ser informada com a data do dia útil anterior a data do sistema, quando a contraparte na operação é um de seus clientes, tipo de conta 1. Data de início do contrato, se contrato registrado à vista.
Data de Vencimento	Data de Vencimento do contrato. Livremente pactuada entre os participantes.
Moeda Base (Referência)	Indica a moeda de referência para apuração da atualização do contrato.
Moeda Cotada	Indica a moeda objeto do contrato a termo.

Campo	Descrição
Taxa a Termo	<p>Valor da taxa de câmbio contratada entre comprador e vendedor. É utilizada na apuração do resultado.</p> <p>Informado com até 4 (quatro) inteiros e 6 (seis) decimais, quando Moeda Base (Referência) escolhida for USD – Dolar dos EUA e 8 (oito) decimais para outras moedas.</p>
Ajuste de Taxa	
Ajustar Taxa	Caixa de seleção com as opções: SIM e NÃO.
Responsável pelo Ajuste de Taxa	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: COMPRADOR, VENDEDOR ou COMPRADOR E VENDEDOR.</p> <p>Indicar o responsável pelo ajuste de taxa.</p> <p>O Participante pode ou não ajustar a taxa no período contratado.</p>
Data Inicial para Ajuste de Taxa	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Indica o início do período estipulado para o ajuste de taxa pelo Participante responsável.</p> <p>Para lançamento do contrato com os campos “Ajustar Taxa” e “Termo de Termo” preenchidos com as Opções:</p> <p>SIM e SIM: A data inicial para ajuste de taxa deve ser igual ou superior a D+1 útil da data de fixação.</p> <p>SIM e NÃO: A data inicial para ajuste da taxa deve ser igual ou superior a D+1 útil do lançamento do contrato.</p>
Data Final para Ajuste de Taxa	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Indica o final do período estipulado para o ajuste de taxa pelo Participante responsável.</p> <p>Deve ser igual ou inferior a D-1 útil da data de vencimento do contrato.</p> <p>Deve ser igual ou superior a D+1 útil da Data Inicial para ajuste de taxa.</p>
Média Asiática	
Taxa Média para Termo Asiático	<p>Caixa de seleção com as opções: Aritmética simples e Aritmética ponderada.</p> <p>Preencher quando opção de contrato for à modalidade Termo Asiático. Após a escolha da opção é apresentado o item Datas de Verificação para a inclusão dos dados complementares.</p> <p>Para contrato com registro a termo somente preencher este campo se a Fonte de Informação utilizada for diferente de SISBACEN.</p>
Quantidade de Datas de Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informado com até 3 (três) inteiros.</p> <p>Quantidade de Datas de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada ou simples.</p>
Fonte de Informação	

Campo	Descrição
Cross Rate na Avaliação?	<p>Caixa de seleção com as opções: SIM e NÃO.</p> <p>O participante deve marcar este campo quando optar pela utilização desta opção.</p> <p>Não é permitido, quando moeda de referência for Dólar dos USA e quando a fonte de informação for Sisbacen.</p>
Fonte de Informação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Sisbacen, Feeder, Spot e Sisbacen/Feeder. Quando opção for Spot a moeda de referência deve ser Moeda Base =USD (Dólar Americano) e Moeda Cotada = BRL (Real).</p> <p>Indica a fonte a ser utilizada para a cotação de fixing para vencimento.</p> <p>Exclusivamente para a fonte de Informação Feeder, no caso específico em que a fonte de informação para formação da Taxa a Termo (Forward) seja o ECB/BCE (Banco Central Europeu), mas esta fonte seja diferente da que será utilizada para a formação do fixing para vencimento, a fonte BCE/ECB deve ser informada exclusivamente no campo “Observação”.</p> <p>Quando a Fonte de Informação for FEEDER ou SPOT, é possível a indicação do Fixing em D0, informando Spot D0 no campo “Tela ou Função de Consulta Função de Consulta”.</p> <p>A regra é válida para geração de eventos de Resgate de Termo de Moedas e para eventos de fixing dos contratos de termo de Asiático.</p> <p>De acordo com a Modalidade do Contrato ou a Fonte de Informação a ser utilizado para a consulta de cotação, o módulo apresenta campos diferentes a ser preenchidos. A descrição dessas diferenças encontra-se no capítulo Introdução ao Termo de Moedas/Conhecendo o Produto ou no capítulo Informações Adicionais/Regras de Registro Conforme Fonte de Informação.</p>
Cotação para o vencimento	<p>Caixa de seleção com as opções: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.</p> <p>Indica a data de cotação para o vencimento.</p>
Boletim	PTAX800 de Fechamento. Boletim de fechamento de cotação da moeda.
Fonte de Consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Spot, Reuters, Broadcast, Bloomberg, BCE e Outros.</p> <p>Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda.</p>
Tela ou Função de Consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que deve ser utilizada pelos Participantes para cotação.</p> <p>Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.</p> <p>É possível informar Spot D0 quando a fonte de informação for FEEDER ou SPOT.</p>

Campo	Descrição
Praça de Negociação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Local de negociação da moeda de referência.</p> <p>Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo de Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.</p>
Horário de Consulta	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Horário de verificação da taxa de câmbio. Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo de Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.</p>
Cotação – Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)	<p>A taxa de câmbio utilizada para avaliação.</p> <p>Informar quando a fonte de informação para taxa de câmbio no contrato for Feeder ou Spot ou Sisbacen/Feeder.</p>
Cotação – Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	<p>A taxa de câmbio utilizada para avaliação.</p> <p>Informar quando a fonte de informação para taxa de câmbio no contrato for Feeder ou Spot ou Sisbacen/Feeder.</p>
Data de Avaliação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data pactuada entre as partes para indicar a partir de quando será possível avaliar o contrato. A última data em que o contrato for avaliado apresentará a cotação utilizada para a liquidação financeira dele.</p> <p>A data de avaliação deve ser maior que a data de início do contrato e até D-1 da data de vencimento do contrato.</p> <p>Quando for opção asiática deve coincidir com a primeira data de verificação.</p> <p>Quando for Spot D0 a data é a do vencimento do contrato.</p>
Termo a Termo	
Termo de Termo	<p>Caixa de seleção com as opções: SIM ou NÃO.</p> <p>Informa se o contrato terá seu início em data futura.</p> <p>A opção SIM aciona os campos “Data de Fixação”, “Valor/Percentual Negociado” e “Forma de Atualização” de preenchimento obrigatório.</p>
Data de Fixação	Data de início do contrato, se contrato registrado a termo.
Cotação para Fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando o campo “Termo de Termo” for marcado com “SIM”.</p> <p>Caixa com as opções: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.</p> <p>Para o cálculo da moeda de início do período do Termo, é considerado o deslocamento indicado no campo “Cotação para Fixing” em relação ao campo “Data de Fixação”.</p> <p>Para contrato “Atualizar Valor Base?” = SIM, também indica o deslocamento a ser aplicado na data informada no campo “Data de Fixação” para captura da cotação final para atualização do valor base.</p>

Campo	Descrição
Forma de Atualização	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Valor ou Percentual.</p> <p>Indica a forma de atualização da taxa inicial apurada na data início do contrato.</p>
Valor/Percentual negociado	<p>Informar o valor ou percentual negociado para ser aplicado para atualização da taxa inicial na data de início do contrato.</p> <p>Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais, caso contrário, o sistema preenche os decimais com zeros.</p>
Atualizar Valor Base?	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Campo com as opções: SIM e Vazio. Indica se o valor base do contrato será atualizado no período a termo. Só é possível indicar “Atualizar Valor Base?” = SIM quando o campo “Termo de Termo” = SIM.</p> <p>Quando o campo “Taxa média para Termo Asiático = ARITMETICA PONDERADA”, o campo “Atualizar Valor Base?” deverá ficar vazio.</p>
Cotação Inicial	<p>Para contrato Termo a Termo com atualização do valor base, campo destinado a informar a cotação inicial da paridade que será utilizada para a atualização do valor base no período a termo. Campo Obrigatório quando o campo “Atualizar Valor Base?” = SIM.</p>
Limite	
Limites	<p>Caixa de seleção com as opções: Superior, Inferior ou Superior/Inferior.</p> <p>Informar se o contrato conta com limitador de variação de valorização do contrato.</p>
Superior (Paridade)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Paridade máxima aceita pelos participantes para correção do contrato.</p> <p>Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja maior que o valor definido no campo Superior, o sistema utilizará o valor arbitrado para corrigir o contrato.</p> <p>Informado com até 6 (seis) números inteiros e 8 (oito) decimais.</p>
Inferior (Paridade)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Paridade mínima aceita pelos participantes para correção do contrato.</p> <p>Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja menor que o valor definido no campo Inferior, o sistema utilizará o valor arbitrado para corrigir o contrato.</p> <p>Informado com até 6 (seis) números inteiros e 8 (oito) decimais.</p>
Prêmio	
Prêmio a ser pago pelo	<p>Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.</p> <p>Indicar a Parte que pagará o prêmio na data informada no campo Data de Liquidação, se houver</p>

Campo	Descrição
Valor do Prêmio (R\$)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 14 (quatorze) inteiros e 2 (dois) decimais. Valor do prêmio a ser pago. Não é necessário que o valor do prêmio seja o mesmo pago na operação original. Caso o campo não seja preenchido as partes não se obrigam, ou seja, apenas realizam a cessão do contrato.
Data de Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Data de Liquidação do Prêmio.
Modalidade de Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Bilateral, Bruta ou Sem Modalidade. Indicar a modalidade de liquidação em que operação de prêmio cursará.
Observação	
Código Identificador	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Código de controle interno do participante.
Datas de Verificação	
Data de Verificação	Data(s) de referência para apuração da Taxa média aritmética ponderada ou Aritmética simples. A última data de verificação tem que ser igual a data de vencimento do contrato. Pode ser igual ou maior que a data de início do contrato.
Valor Referência	Valor definido para data de referência, o qual é utilizado no cálculo da taxa média aritmética ponderada. Informado com até 14 (quatorze) inteiros e 2 (dois) decimais. O somatório destes valores deve ser igual ao Valor Base.
Pesos (%)	Indica a Porcentagem do Valor Base na data de verificação para a apuração da taxa média aritmética ponderada. Obs.: Calculado pelo sistema automaticamente, quando informado o Valor Referência.

Ao clicar no botão **CONFIRMAR**, o sistema apresenta mensagem abaixo:

Contrato 15J00000908 alterado sob o No. CETIP 2015101413105347

3.6 Taxa de Câmbio para Avaliação

Termo > Termo21 > Taxa de Câmbio para Avaliação

Visão Geral

Esta função é exclusiva para os contratos registrados cuja fonte de informação de taxa de câmbio seja um *Feeder*, *Spot* ou *Sisbacen/Feeder*, independente da moeda.

Quando fonte de informação *Feeder* ou *Spot*, o contrato pode ser avaliado periodicamente da data de registro até a data de vencimento, inclusive.

Quando fonte de informação *Sisbacen/Feeder*, o contrato pode ser avaliado a partir da data de avaliação, informada no registro do contrato, até a data de vencimento, inclusive.

Os contratos a Termo de Moedas podem ser avaliados diariamente com base nas taxas de câmbio do dia, apenas para simples consulta. Deste modo, proporciona o reconhecimento em contas de resultado, o diferencial a receber ou a pagar a cada dia útil até a data de vencimento do contrato, como pode ser visto na função de Consulta de Contratos.

Somente a partir da data de avaliação acordada no contrato é que a taxa lançada é passível de utilização no resgate. Quando do vencimento, a atualização é efetuada com a taxa de avaliação mais recente.

Caso o contrato seja avaliado até o dia útil anterior ao vencimento, o contrato deve amanhecer resgatado, caso contrário, o sistema gera operação de pendência de taxa de câmbio para controle e acompanhamento dos participantes, sendo permitida a avaliação nesta data.

Caso a taxa de câmbio não seja informada, inclusive no dia do vencimento, até final da grade SEM MODALIDADE (ou até o final da BRUTA, no caso de contratos com mercado), o resgate não será gerado.

Neste caso, o contrato ficará com status VENCIDO NÃO RESGATADO. Para confirmar a atualização é necessária a digitação de ambas as partes envolvidas, exceto quando contrato realizado com cliente próprio, tipo de conta 1 ou entre contas de cliente 1 de uma mesma instituição, casos em que a digitação deve ser realizada apenas pelo Membro de Mercado titular.

Observações:

Esta função pode ser utilizada quando a fonte de informação da taxa de câmbio for *Sisbacen*, no caso em que ocorra a não divulgação tempestiva das taxas de câmbio ou ausência de procedimentos determinados pelo BACEN.

1) As taxas de câmbio que façam referência a cotação de D-1 ou D-2 da data de vencimento do contrato podem ser informadas pelas partes durante a grade de registro de operações para modalidade bilateral.

2) Uma vez informada a taxa de câmbio pelas partes, mesmo que o sistema apure a informação junto a fonte oficial de divulgação prevalecerá a informação registrada. Por outro lado, caso a partir das 11h15m as partes não informem a taxa de câmbio ou apenas uma delas o tenha feito e o sistema apure a mesma junto à fonte oficial, esta é utilizada para atualização do evento.

3) Para contratos registrados sem *Cross Rate* são solicitadas duas cotações para realizar a avaliação: Moeda Cotada/Moeda Base (Referência) e R\$/Moeda Cotada.

4) Para contratos registrados com *Cross Rate* é solicitado três cotações para realizar a avaliação: Moeda Cotada/USD ou USD/Moeda Cotada, Moeda Base (Referência) /USD ou USD/Moeda Base (Referência) e R\$/USD.

Informação sobre cálculo da taxa de câmbio para avaliação acesse o Caderno de Fórmulas no *site* da B3.

Tela de Filtro de Taxa de Câmbio para Avaliação

Taxa de Câmbio para Avaliação

Nº do Contrato

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Após informação do nº do contrato que se deseja avaliar é apresentada Tela de Detalhe.

Tela de Detalhe de Taxa de Câmbio para Avaliação

Taxa de Câmbio para Avaliação		
Lançamento do Participante (Conta)	<input type="text"/>	
Contraparte (Conta)	<input type="text"/>	
Nº Controle Interno	<input type="text"/>	
Nº do Contrato	15100000075	
Paridade (Moeda Base(Referência)/Moeda Cotada)		
Paridade (R\$/Moeda Cotada)	<input type="text"/>	
Datas de Verificação		
Data Verificação	Paridade Informada	Paridade (Moeda Base(Referência)/Moeda Cotada)
02/09/2016		<input type="text"/> 1 <input type="text"/> , <input type="text"/> 26
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Após a confirmação do lançamento, o sistema envia mensagem com o número da operação efetuada.

De acordo com a Modalidade do Contrato ou a Fonte de Informação a ser utilizado para a consulta de cotação, o módulo apresenta campos diferentes a serem preenchidos. A descrição dessas diferenças encontra-se no capítulo Introdução ao Termo de Moedas/Conhecendo o Produto ou no capítulo Informações Adicionais/Regras de Registro Conforme Fonte de Informação.

Observação:

Nos casos em que seja necessária confirmação da Contraparte, esta poderá ser feita pelo módulo: Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes.

Descrição dos Campos da Tela de Detalhe de Taxa de Câmbio para Avaliação

Campo	Descrição
	Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.
Lançamento do Participante (Conta)	Código Cetip do membro envolvido na operação.
Contraparte (Conta)	Código Cetip que identifica o membro com quem foi efetuado o contrato.
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Informado com até 10 (dez) inteiros. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.
Nº do Contrato	Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro.
Taxa Dólar para <i>Cross Rate</i>	Taxa de câmbio em dólar utilizada para converter as moedas de referência para o Real. Preencher quando tipo de contrato tiver sido registrado com <i>Cross Rate</i> .

Campo	Descrição
<p>Se o contrato exibe o campo: Taxa de câmbio (R\$/Moeda) ou</p> <p>Se o contrato com paridade não asiático e sem <i>Cross Rate</i> exibe o campo: Paridade (Moeda Base (Referência) /Moeda Cotada) ou</p> <p>Se o contrato com paridade não asiático e com <i>Cross Rate</i> exibe o campo: Paridade (USD/Moeda Base (Referência) ou Moeda Base (Referência) /USD) ou</p> <p>Se o contrato com paridade, asiático e com <i>Cross Rate</i>: Este campo não é para ser preenchido.</p> <p>Os valores para paridade devem ser lançados nos campos complementares em Datas de Verificação. ou</p> <p>Se o contrato com paridade, asiático e sem <i>Cross Rate</i>: Este campo não é para ser preenchido.</p> <p>Os valores para paridade devem ser lançados nos campos complementares em Datas de verificação.</p>	<p>A taxa de câmbio utilizada para avaliação.</p> <p>Informar quando a fonte de informação para taxa de câmbio no contrato for <i>Feeder</i> ou <i>Spot</i>.</p> <p>Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais.</p>
<p>Se o contrato exibe o campo: Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda) ou</p> <p>Se o contrato não asiático e sem <i>Cross Rate</i> exibe o campo: Paridade (R\$/Moeda Cotada) ou</p> <p>Se o contrato com paridade não asiático e com <i>Cross Rate</i> exibe o campo: Paridade (USD/Moeda Cotada ou Moeda Cotada/USD). ou</p> <p>Se o contrato com paridade, asiático e com <i>Cross Rate</i> exibe o campo: Paridade (USD/Moeda Cotada ou Moeda Cotada/USD). ou</p> <p>Se o contrato com paridade, asiático e sem <i>Cross Rate</i> exibe o campo: Paridade (R\$/Moeda Cotada).</p>	<p>A taxa de câmbio utilizada para avaliação.</p> <p>Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais.</p>
<p>Datas de verificação - Dados complementares para contrato com modalidade Termo Asiático.</p>	
Data Verificação	Data(s) de referência para apuração da atualização da taxa média aritmética ponderada e aritmética simples.
Paridade Informada	Última Taxa informada para avaliação na data de referência.

Campo	Descrição
Paridade (Moeda Base (Referência) /Moeda Cotada)	Taxa utilizada para avaliação na data de referência.

3.7 Ajustar Taxa

Termo > Termo21 > Ajustar Taxa

Visão Geral

Essa função permite ao Participante informar nova taxa do contrato, porém só é possível o Ajuste de Taxa por um Participante ou pai do serviço de digitação deste, se na função “Contrato a Termo de Moedas” o mesmo tenha a indicação de Responsável pelo Ajuste de Taxa.

O ajuste da taxa *forward* será permitido apenas no período compreendido entre as datas início e fim estabelecidas para ajuste na função “Registro de Contrato a Termo de Moedas”.

O Participante só poderá ajustar a taxa uma única vez. O estorno da operação é permitido somente no dia do lançamento da operação de Ajuste de Taxa.

Tela de Filtro Ajustar Taxa

Ajustar Taxa

Nº do Contrato

Tela de Ajustar Taxa

Ajustar Taxa

Nº do Contrato 15J00001463
 Comprador (Conta) 05000.10-8
 Vendedor (Conta) 05000.00-5
 Data de Operação 13/10/2015
 Data de Vencimento 13/11/2015
 Moeda Base(Referência) USD (220) - DOLAR DOS EUA
 Moeda Cotada BRL (790) - REAL
 Valor Base 500.000,00
 Valor Total Antecipado
 Taxa a Termo Atual 2,990000
 Taxa a Termo ,
 Nº Controle Interno

Os campos da Tela Ajustar Taxa são de preenchimento obrigatório. Após a confirmação da nova taxa a função deve alterar a taxa a termo do contrato.

Após clicar no botão **CONFIRMAR** o sistema apresenta mensagem abaixo:

Criada operação relativa ao Ajuste de Taxa de Contrato a Termo de Moeda

4 TERMO COM FLUXO

4.1 Registro de Termo de Moedas com Fluxo e TARF

Termo > Termo com Fluxo > Registro de Termo de Moedas com Fluxo

Visão Geral

Esta função permite o registro de Termo com Fluxo e possibilita a limitação dos ajustes positivos e negativos pelo comprador ou vendedor bem como a inclusão de alavancagem variáveis nos diversos fluxos.

O TARF é composto por uma série de vencimentos inter-relacionados e à medida que esses vencimentos vão ocorrendo, caso a soma dos ajustes pagos exceda determinado nível (CAP) os vencimentos remanescentes deixam de existir, ou seja, implicará na extinção automática do Contrato a Termo.

A liquidação financeira do contrato será realizada na modalidade Bilateral e nos casos em que esta não esteja mais disponível, será na modalidade Bruta. As operações realizadas entre o Participante e seus clientes 1 ou 2, ou aquelas com financeiro igual a zero, são geradas na modalidade Sem Modalidade.

Obs.: Deve ser entendido como um TARF, o registro que possuir qualquer um dos campos abaixo preenchidos:

- CAP Global Comprador,
- CAP Global Vendedor,

Caso contrário os contratos deverão ser considerados como Termos com Fluxos.

Tela de Registro de Termo com Fluxo - Taxa a Termo/ Limites e alavancagem Únicos

Registro de Termo de Moedas com Fluxo	
Parte (Conta)	05000,00,5
Boletim	PTAX800 de Fechamento
Posição do Participante	COMPRADOR
Taxa a Termo	ÚNICO
CPF/CNPJ Cliente Participante	
Pagamento de Prêmio	
Contraparte(Conta)	05000,10,8
Prêmio a ser pago pelo	
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	012.345.678-90
Tipo de CAP	
Adesão ao Contrato	SEM ADESAO
CAP Global Vendedor	
Nº Controle Interno	417
CAP Global Comprador	
Valor Base (Referência)	1000000,
Alavancagem	
Data de Início	10/7/2014
Limites	
Data de Vencimento	10/9/2014
Quantidade de Eventos	2
Moeda Base(Referência)	USD (220) - DOLAR DOS EUA
Fonte de Informação	SISBACEN
Moeda Cotada	BRL (790) - REAL
Observação	

Descrição dos Campos da Tela de Registro Termo com Fluxo (Único, Variável e TARF)

Campo	Descrição
Parte (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip do participante (Parte). Pode ser conta própria ou conta cliente.
Posição do participante	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a posição assumida pelo participante. Lista pré-definida: Vendedor ou comprador
CPF/CNPJ Cliente Participante	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ previamente cadastrado no SIC.
Contraparte (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip do participante (Contraparte). Pode ser conta própria ou conta cliente.
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ previamente cadastrado no SIC.
Adesão ao Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa com as opções: “CGD”, “CSA”, “CGD/CSA” ou “Sem Adesão”.
Nº Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 10 (dez) inteiros. Número de controle do participante.
Valor Base (Referência)	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 12 (doze) inteiros e 2 (dois) decimais. Indica o valor de referência do contrato.
Data de Início	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a data de início do fluxo de termos
Data de Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Data de vencimento do contrato. Livrementemente pactuada entre os participantes. A data de vencimento do contrato pode ser indicada em dias não úteis. Caso o ajuste caia em dia não útil, o comportamento do sistema deve ser como ocorre em outros casos, de gerar o ajuste para o próximo dia útil conhecido.
Moeda Base (Referência)	Campo de preenchimento obrigatório. É a moeda objeto do Fluxo de termo.
Moeda Cotada	Campo de preenchimento obrigatório. É a moeda na qual a moeda base é cotada. No Termo com Fluxo deverá ser obrigatoriamente BRL (Real).
Boletim	Campo de preenchimento obrigatório. 18h00minh-Fechamento. Boletim de fechamento de cotação da moeda.

Campo	Descrição
Taxa a Termo	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa com as opções “ÚNICO” e “VARIÁVEL”
Pagamento de Prêmio	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 10 (dez) inteiros e 2 (dois) decimais. Indica o valor do prêmio pago no registro do Fluxo de Termos.
Prêmio a ser pago pelo	Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor. Indicar a Parte que pagará o prêmio na data informada no campo Data de Liquidação, se houver.
Tipo de CAP	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa com as opções “EXATO” e “INCLUSIVE”. A opção “Exato” indica o somatório de créditos que o vendedor ou comprador receberá deverá ser igual ao valor indicado no campo “CAP Global”. A opção “INCLUSIVE” indica o somatório de créditos que o vendedor ou comprador receberá poderá ser inclusive o último evento de crédito a disparar o TARNOUT.
CAP Global Vendedor	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Indica o valor Máximo (exclusive) de créditos que o Vendedor receberá sem disparar o TARNOUT.
CAP Global Comprador	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Indica o valor Máximo (exclusive) de créditos que o comprador receberá sem disparar o TARNOUT.
Alavancagem	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa com as opções: “Único” e “Variável”
Limites	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa com as opções: “Único” e “Variável”
Quantidade de Eventos	Campo de preenchimento obrigatório. Indica as quantidades de eventos do Termo
Fonte de Informação	Campo de preenchimento obrigatório. Fonte de informação responsável pela divulgação da cotação
Observação	Campo livre.

Após clicar no botão **Enviar**, o sistema apresenta a tela para confirmar os dados.

Registro de Termo de Moedas com Fluxo	
Parte (Conta) 05000.00-5	Boletim PTAX800 de Fechamento
Posição do Participante COMPRADOR	Taxa a Termo ÚNICO
CPF/CNPJ Cliente Participante	Pagamento de Prêmio
Contraparte(Conta) 05000.10-8	Prêmio a ser pago pelo
CPF/CNPJ Cliente Contraparte 012.345.678-90	Tipo de CAP
Adesão ao Contrato SEM ADESAO	CAP Global Vendedor
Nº Controle Interno 417	CAP Global Comprador
Valor Base (Referência) 1.000.000,00	Alavancagem
Data de Início 10/07/2014	Limites
Data de Vencimento 10/09/2014	Quantidade de Eventos 2
Moeda Base(Referência) USD (220) - DOLAR DOS EUA	Fonte de Informação SISBACEN
Moeda Cotada BRL (790) - REAL	Observação
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Após clicar o botão **Confirmar**, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Registro de Termo de Moedas com Fluxo
Contrato 14G00001091 registrado sob o No. CETIP 2014071014293497
Clique em 'PROSSEGUIR' para informar os fluxos de eventos
<input type="button" value="Prosseguir"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Após clicar no botão **Prosseguir**, o sistema apresenta a tela para Registro da Agenda de Eventos.

Registro da Agenda de Eventos		
Conta		
Lançamento do Participante (Conta)		
05000.00-5		
Contraparte(Conta)	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	
05000.10-8	012.345.678-90	
Código IF		
14G00001091		
Valor Base (Referência)	Data de Início	
1.000.000,00	10/07/2014	
Data de Vencimento	Posição do Participante	
10/09/2014	COMPRADOR	
Meu Número	Meu Número (Oper Original)	
<input type="text" value="321"/>	417	
Parâmetros		
Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior Limite Superior Fator Alavancagem Comprador Fator Alavancagem Vendedor	
<input type="text" value="2"/> , <input type="text" value="25"/>		
Dados do Evento		
Data	Data de Cotação	Amortização
<input type="text" value="08"/> / <input type="text" value="08"/> / 2014	<input type="text" value="07"/> / <input type="text" value="08"/> / 2014	<input type="text" value="50"/> , <input type="text"/>
Data	Data de Cotação	Amortização
<input type="text" value="10"/> / <input type="text" value="09"/> / 2014	<input type="text" value="09"/> / <input type="text" value="09"/> / 2014	<input type="text" value="50"/> , <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Descrição dos campos da tela de Registro da Agenda de Eventos

Campo	Descrição
Meu número	Número de controle do participante.
Valor da Taxa a Termo	Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.
Data	Indica data do evento. É a data onde ocorrerá a liquidação financeira de valor de referência ou redução do valor base.
Data de Cotação	Data da cotação que será utilizada para liquidação do evento.
Amortização	Informado com até 3 (três) inteiros e 5 (cinco) decimais.

Após clicar no botão **Enviar**, o sistema apresenta a tela para confirmar os dados.

Registro da Agenda de Eventos

Conta

Lançamento do Participante (Conta)	
05000.00-5	
Contraparte(Conta)	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
05000.10-8	012.345.678-90
Código IF	
14G00001091	
Valor Base (Referência)	Data de Início
1.000.000,00	10/07/2014
Data de Vencimento	Posição do Participante
10/09/2014	COMPRADOR
Meu Número	Meu Número (Oper Original)
321	417

Parâmetros

Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior	Limite Superior	Fator Alavancagem Comprador	Fator Alavancagem Vendedor
2,25000000				

Dados do Evento

Data	Data de Cotação	Amortização
08/08/2014	07/08/2014	50,00000
Data	Data de Cotação	Amortização
10/09/2014	09/09/2014	50,00000

Após clicar o botão **Confirmar**, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Agenda de eventos registrada sob o No. CETIP 2014071014293498

Tela de Registro de Termo com Fluxo - Taxa a Termo/ Limites e alavancagem Variados

Registro de Termo de Moedas com Fluxo	
Parte (Conta)	05000.00-5
Posição do Participante	COMPRADOR
CPF/CNPJ Cliente Participante	
Contraparte(Conta)	05000.10-8
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	012.345.678-90
Adesão ao Contrato	SEM ADESAO
Nº Controle Interno	9877
Valor Base (Referência)	1000000
Data de Início	10/7/2014
Data de Vencimento	10/9/2014
Moeda Base(Referência)	USD (220) - DOLAR DOS EUA
Moeda Cotada	BRL (790) - REAL
Boletim	PTAX800 de Fechamento
Taxa a Termo	VARIÁVEL
Pagamento de Prêmio	
Prêmio a ser pago pelo	
Tipo de CAP	
CAP Global Vendedor	
CAP Global Comprador	
Alavancagem	VARIÁVEL
Limites	VARIÁVEL
Quantidade de Eventos	2
Fonte de Informação	SISBACEN
Observação	

Descrição dos campos igual ao exemplo Taxa a Termo/ Limites e alavancagem Únicos.

Após clicar no botão **Enviar**, o sistema apresenta a tela para confirmar os dados.

Registro de Termo de Moedas com Fluxo	
Parte (Conta)	05000.00-5
Posição do Participante	COMPRADOR
CPF/CNPJ Cliente Participante	
Contraparte(Conta)	05000.10-8
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	012.345.678-90
Adesão ao Contrato	SEM ADESAO
Nº Controle Interno	9877
Valor Base (Referência)	1.000.000,00
Data de Início	10/07/2014
Data de Vencimento	10/09/2014
Moeda Base(Referência)	USD (220) - DOLAR DOS EUA
Moeda Cotada	BRL (790) - REAL
Boletim	PTAX800 de Fechamento
Taxa a Termo	VARIÁVEL
Pagamento de Prêmio	
Prêmio a ser pago pelo	
Tipo de CAP	
CAP Global Vendedor	
CAP Global Comprador	
Alavancagem	VARIÁVEL
Limites	VARIÁVEL
Quantidade de Eventos	2
Fonte de Informação	SISBACEN
Observação	

Após clicar o botão **Confirmar**, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Registro de Termo de Moedas com Fluxo
Contrato 14G00001092 registrado sob o No. CETIP 2014071014293501
Clique em 'PROSSEGUIR' para informar os fluxos de eventos

Após clicar no botão **Prosseguir**, o sistema apresenta a tela para Registro da Agenda de Eventos.

Registro da Agenda de Eventos									
Conta									
Lançamento do Participante (Conta)					CPF/CNPJ Cliente Contraparte				
05000.00-5					012.345.678-90				
Contraparte(Conta)					Data de Início				
05000.10-8					10/07/2014				
Código IF					Posição do Participante				
14G00001092					COMPRADOR				
Valor Base (Referência)					Meu Número (Oper Original)				
1.000.000,00					9877				
Data de Vencimento									
10/09/2014									
Meu Número									
21447									
Dados do Evento									
Data	Data de Cotação	Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior	Limite Superior	Amortização	Fator Alavancagem Comprador	Fator Alavancagem Vendedor		
08 /08 /2014	07 /08 /2014	2 ,25	1 ,	1 ,5	50 ,	1 ,1	1 ,1		
Data	Data de Cotação	Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior	Limite Superior	Amortização	Fator Alavancagem Comprador	Fator Alavancagem Vendedor		
10 /09 /2014	09 /09 /2014	2 ,30	1 ,	1 ,4	50 ,	1 ,	1 ,2		
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>									

Descrição dos campos da tela de Registro da Agenda de Eventos

Campo	Descrição
-------	-----------

Registro da Agenda de Eventos – Campos de preenchimento obrigatório.

Meu Número	Número de controle do participante.
Data	Indica data do evento. É a data onde ocorrerá a liquidação financeira de valor de referência ou redução do valor base.
Data de Cotação	Data da cotação que será utilizada para liquidação do evento.
Valor da Taxa a Termo	Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.
Limite Inferior	Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.
Limite Superior	Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.
Amortização	Informado com até 3 (três) inteiros e 5 (cinco) decimais.
Fator Alavancagem Comprador	Fator de alavancagem do comprador
Fator Alavancagem Vendedor	Fator de alavancagem do vendedor

Após clicar no botão **Enviar**, o sistema apresenta a tela para confirmar os dados.

Registro da Agenda de Eventos									
Conta									
Lançamento do Participante (Conta)									
05000.00-5									
Contraparte(Conta)					CPF/CNPJ Cliente Contraparte				
05000.10-8					012.345.678-90				
Código IF									
14G00001092									
Valor Base (Referência)					Data de Início				
1.000.000,00					10/07/2014				
Data de Vencimento					Posição do Participante				
10/09/2014					COMPRADOR				
Meu Número					Meu Número (Oper Original)				
21447					9877				
Dados do Evento									
Data	Data de Cotação	Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior	Limite Superior	Amortização	Fator Alavancagem Comprador	Fator Alavancagem Vendedor		
08/08/2014	07/08/2014	2,25000000	1,00000000	1,50000000	50,00000	1,10000000	1,10000000		
Data	Data de Cotação	Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior	Limite Superior	Amortização	Fator Alavancagem Comprador	Fator Alavancagem Vendedor		
10/09/2014	09/09/2014	2,30000000	1,00000000	1,40000000	50,00000	1,00000000	1,20000000		

Após clicar o botão **Confirmar**, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Agenda de eventos registrada sob o No. CETIP 2014071014071014

Tela de Registro de Termo com Fluxo – TARF (tem CAP)

Registro de Termo de Moedas com Fluxo	
Parte (Conta)	05000 .00 .5
Boletim	PTAX800 de Fechamento
Posição do Participante	COMPRADOR
Taxa a Termo	ÚNICO
CPF/CNPJ Cliente Participante	
Pagamento de Prêmio	
Contraparte(Conta)	05000 .10 .8
Prêmio a ser pago pelo	
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	01234567890
Tipo de CAP	EXATO
Adesão ao Contrato	SEM ADESÃO
CAP Global Vendedor	20000
Nº Controle Interno	1347
CAP Global Comprador	
Valor Base (Referência)	1000000
Alavancagem	
Data de Início	10 /07 /2014
Limites	
Data de Vencimento	10 /09 /2014
Quantidade de Eventos	2
Moeda Base(Referência)	USD (220) - DOLAR DOS EUA
Fonte de Informação	SISBACEN
Moeda Cotada	BRL (790) - REAL
Observação	

Descrição dos campos igual ao exemplo Taxa a Termo/ Limites e alavancagem Únicos e Variados.

Após clicar no botão **Enviar**, o sistema apresenta a tela para confirmar os dados.

Registro de Termo de Moedas com Fluxo	
Parte (Conta) 05000.00-5	Boletim PTAX800 de Fechamento
Posição do Participante COMPRADOR	Taxa a Termo ÚNICO
CPF/CNPJ Cliente Participante	Pagamento de Prêmio
Contraparte(Conta) 05000.10-8	Prêmio a ser pago pelo
CPF/CNPJ Cliente Contraparte 012.345.678-90	Tipo de CAP EXATO
Adesão ao Contrato SEM ADESAO	CAP Global Vendedor 20.000,00
Nº Controle Interno 1347	CAP Global Comprador
Valor Base (Referência) 1.000.000,00	Alavancagem
Data de Início 10/07/2014	Limites
Data de Vencimento 10/09/2014	Quantidade de Eventos 2
Moeda Base(Referência) USD (220) - DOLAR DOS EUA	Fonte de Informação SISBACEN
Moeda Cotada BRL (790) - REAL	Observação
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Após clicar no botão **Confirmar**, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Registro de Termo de Moedas com Fluxo
Contrato 14G00001094 registrado sob o No. CETIP 2014071014293507
Clique em 'PROSSEGUIR' para informar os fluxos de eventos
<input type="button" value="Prosseguir"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Após clicar no botão **Prosseguir**, o sistema apresenta a tela para Registro da Agenda de Eventos.

Registro da Agenda de Eventos		
Conta		
Lançamento do Participante (Conta)		
05000.00-5		
Contraparte(Conta)	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	
05000.10-8	012.345.678-90	
Código IF		
14G00001094		
Valor Base (Referência)	Data de Início	
1.000.000,00	10/07/2014	
Data de Vencimento	Posição do Participante	
10/09/2014	COMPRADOR	
Meu Número	Meu Número (Oper Original)	
<input type="text" value="139"/>	1347	
Parâmetros		
Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior Limite Superior Fator Alavancagem Comprador Fator Alavancagem Vendedor	
<input type="text" value="2"/> , <input type="text" value="25000000"/>		
Dados do Evento		
Data	Data de Cotação	Amortização
<input type="text" value="8"/> / <input type="text" value="8"/> / 2014	<input type="text" value="7"/> / <input type="text" value="8"/> / 2014	<input type="text" value="50"/> , <input type="text"/>
Data	Data de Cotação	Amortização
<input type="text" value="10"/> / <input type="text" value="9"/> / 2014	<input type="text" value="9"/> / <input type="text" value="9"/> / 2014	<input type="text" value="50"/> , <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Descrição dos campos igual a tela de Registro da Agenda de Eventos Únicos.

Após clicar no botão **Enviar**, o sistema apresenta a tela para confirmar os dados.

Registro da Agenda de Eventos		
Conta		
Lançamento do Participante (Conta)		
05000.00-5		
Contraparte(Conta)	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	
05000.10-8	012.345.678-90	
Código IF		
14G00001094		
Valor Base (Referência)	Data de Início	
1.000.000,00	10/07/2014	
Data de Vencimento	Posição do Participante	
10/09/2014	COMPRADOR	
Meu Número	Meu Número (Oper Original)	
439	1347	
Parâmetros		
Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior	Limite Superior
2,25000000		
Fator Alavancagem Comprador	Fator Alavancagem Vendedor	
Dados do Evento		
Data	Data de Cotação	Amortização
08/08/2014	07/08/2014	50,00000
Data	Data de Cotação	Amortização
10/09/2014	09/09/2014	50,00000
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Após clicar o botão **Confirmar**, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Agenda de eventos registrada sob o No. CETIP 2014071014293508

4.2 Intermediação de Contrato

Termo > Termo com Fluxo > Intermediação de Contrato

Visão Geral

Esta função permite a intermediação de um contrato de Termo com Fluxo, em que o intermediador promove o encontro de partes interessadas em realizar determinado contrato e, conseqüentemente, recebe o percentual da comissão acordado. Clientes 1 e 2 não podem ser intermediadores de contrato.

Tela Intermediação de Contrato

Intermediação de Contrato

Parte (Conta) <input type="text"/>	Posição do Participante <input type="text"/>
Contraparte(Conta) <input type="text"/>	Nº Controle Interno <input type="text"/>
Contrato <input type="text"/>	Comissão(%) <input type="text"/>
Momento do Pagamento <input type="text"/>	Liquidante (Conta) <input type="text"/>
Modalidade de Liquidação BRUTA	

Descrição dos Campos da Tela Intermediação de Contrato

Campo	Descrição
Intermediação de Contrato – Campos de preenchimento obrigatório, exceto o campo “Liquidante Conta”.	
Parte Conta	Código Cetip do participante que deseja antecipar o contrato.
Posição do Participante	Indica a posição assumida pelo participante. Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou Comprador.
Contraparte	Código Cetip que identifica o outro membro envolvido na operação.
Código IF	Código do Instrumento Financeiro
Número Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Informado com até 10 (dez) inteiros.
Contrato	Código do Instrumento Financeiro
Comissão (%)	Valor a ser pago ao intermediador. Informado com até 2 (dois) inteiros e 4 (quatro) decimais.
Momento do Pagamento	A comissão do valor deve ser paga sempre no início do contrato.
Liquidante Conta	Código Cetip do Banco Liquidante que deve efetuar a liquidação financeira da operação. Caso o campo não seja preenchido, o sistema assume o Banco Liquidante principal.

4.3 Cessão de Contrato

Termo > Termo com Fluxo > Cessão de Contrato

Visão Geral

Um dos Participantes envolvidos pode ceder a um terceiro o contrato registrado anteriormente, podendo ocorrer entre a data de registro até a data anterior ao vencimento do contrato, sempre pelo valor total. A cessão de contrato pode ser entre conta Participante e Cliente 1 para conta Cliente 2 do mesmo participante, que possuam o mesmo CPF ou CNPJ.

Tela Cessão de Contrato

Cessão de Contrato

Parte (Conta) Posição do Participante

Contraparte(Conta) CPF/CNPJ (Adquirente)

Nº Controle Interno Contrato

Valor do Prêmio Titular do Prêmio

Descrição dos Campos da Tela Cessão de Contrato

Campo	Descrição
Parte Conta	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip do participante que deseja antecipar o contrato.
Posição do Participante	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o papel assumido pelo participante sendo: Cedente ou Adquirente.
Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o outro membro envolvido na operação.
CPF/CNPJ (Adquirente)	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.
Número Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 10 (dez) inteiros. Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.
Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Código do Contrato envolvido na operação

Campo	Descrição
Valor do Prêmio	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 10 (dez) inteiros e 2 (dois) decimais. Valor do prêmio a ser pago, sendo este opcional e não necessitando ser o mesmo valor pago na operação original. A cessão ocorre independente do pagamento de um prêmio.
Titular do Prêmio	Preenchimento obrigatório caso haja o pagamento do prêmio. Indica quem pagará o prêmio.

4.4 Antecipação de contrato

Termo > Termo com Fluxo > Antecipação de Contrato

Visão Geral

É possível também a antecipação de contrato de termo com fluxo e TARF.

Caso o contrato tenha um dos campos: CAP Global Comprador ou CAP Global Vendedor trata-se de um TARF, caso contrário trata-se de um Termo com Fluxo. Para o TARF será solicitado o Valor Financeiro da Antecipação e no caso do Termo com Fluxo será solicitado a Taxa a Termo e Taxa de Juros.

No caso de TARF o contrato será reduzido com base no Valor Base a Antecipar informado em relação ao Valor base Remanescente do contrato. Para Termo com Fluxo a antecipação é calculada pela diferença financeira entre o valor da paridade utilizada para a reversão e a paridade a termo pactuada no registro do contrato, descontada pela taxa de juros de descapitalização.

Tela Antecipação de Contrato de Termo com Fluxo e TARF

Descrição dos Campos da Tela Antecipação de Contrato de Termo com Fluxo e TARF

Campo	Descrição
Antecipação de Contrato – Campos de preenchimento obrigatório.	
Parte Conta	Código Cetip do participante que deseja antecipar o contrato.
Posição do Participante	Indica a posição assumida pelo participante. Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou Comprador.
Código IF	Código do Instrumento Financeiro

Tela Detalhe

Antecipação de Contrato

Código IF 14G00001091

Nº Controle Interno

Valor Base a Antecipar

Data Antecipação / / 2014

Liquidante (Conta) , -

Descrição dos Campos da Tela Detalhe de Antecipação de Contrato

Campo	Descrição
Número Controle Interno	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informado com até 10 (dez) inteiros.</p> <p>Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.</p> <p>Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.</p>
Valor Base a Antecipar	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informado com até 12 (doze) inteiros e 8 (dois) decimais.</p> <p>É valor que se deseja antecipar. Pode representar parte ou a totalidade do valor base registrado no contrato ou do saldo remanescente do mesmo.</p> <p>Observações: Quando contrato Asiático com média ponderada este campo deve ser preenchido com valor igual à soma dos valores a antecipar informado em cada data de verificação (dados complementares).</p>
Data Antecipação	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando se deseja efetuar uma Antecipação Retroativa com cliente 1.</p> <p>Deve ser preenchido em no máximo D-2 útil anterior a data do sistema.</p>
Liquidante (Conta)	<p>Código Cetip do Banco Liquidante que deve efetuar a liquidação financeira da operação. Caso o campo não seja preenchido, o sistema assume o Banco Liquidante principal.</p>

Após Confirmar, o sistema apresenta a tela abaixo.

Antecipação Termo com Fluxo

Data 08/08/2014 Valor a Antecipar , Paridade Antecipação , Taxa de Juros ,

Data 10/09/2014 Valor a Antecipar , Paridade Antecipação , Taxa de Juros ,

Na antecipação do termo com fluxo, o sistema permite a definição do valor base antecipado para cada fluxo de forma independente, além de permitir também o informe da taxa forward e da taxa de juros.

Descrição dos Campos da Tela Adicional Detalhe de Antecipação de Contrato

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Valor a Antecipar	Valor a Antecipar. Informado com até 12 (doze) inteiros e 8 (dois) decimais.
Paridade Antecipação	Paridade Antecipação. Informado com até 5 (cinco) inteiros e 8 (oito) decimais.
Taxa de Juros	Taxa de Juros. Informado com até 3 (três) inteiros e 4 (quatro) decimais.

Após Confirmar, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Contrato 14G00001091 antecipado sob o No. CETIP 2014071114299434

Tela exemplo antecipação de TARF
Descrição dos Campos da Tela exemplo antecipação de TARF

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Valor Financeiro da Antecipação	Valor Financeiro da Antecipação. Informado com até 12 (doze) inteiros e 2 (dois) decimais.
Credor da Antecipação	Credor da Antecipação.

Após Confirmar, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Contrato 14G00001094 antecipado sob o No. CETIP 2014071114299449

4.5 Registro de Parâmetros

Termo > Termo com Fluxo > Registro de Parâmetros

Visão Geral

Nesta função, é possível registrar os parâmetros do Termo com Fluxo após a realização do Registro do Contrato.

Tela Registro de Parâmetros

Registro de Parâmetros

Parte (Conta)

Contraparte(Conta)

Posição do Participante

Código IF

Descrição dos Campos da Tela Registro de Parâmetros

Campo	Descrição
Parte (Conta)	Campo de preenchimento Obrigatório. Número da conta do participante na Cetip.
Contraparte (Conta)	Campo de preenchimento Obrigatório. Código Cetip do outro membro envolvido no lançamento da operação.
Posição do Participante	Campo de preenchimento Obrigatório. Caixa com as opções Comprador e Vendedor.
Código IF	Campo de preenchimento Obrigatório. Código do Instrumento Financeiro

Após preenchimento de todos os dados e avançar para a próxima tela, será aberta a possibilidade do preenchimento da quantidade de eventos informada no contrato de Termo com Fluxo na tela de Registro de Agenda de Eventos. Em nosso exemplo, há cinco datas de Fluxo.

Tela Registro de Agenda de Eventos

Registro da Agenda de Eventos		
Conta		
Contraparte(Conta) 10020.10-4	CPF/CNPJ Cliente Participante 987.654.321-00	
Lançamento do Participante (Conta) 10020.00-1		
Código IF 14100000300		
Valor Base (Referência) 100.000,00	Data de Início 09/09/2014	
Data de Vencimento 09/09/2015	Posição do Participante VENDEDOR	
Meu Número <input type="text"/>	Meu Número (Oper Original) 123131312	
Parâmetros		
Valor da Taxa a Termo <input type="text"/>	Limite Inferior Limite Superior Fator Alavancagem Comprador Fator Alavancagem Vendedor	
Dados do Evento		
Data <input type="text"/>	Data de Cotação <input type="text"/>	Amortização <input type="text"/>
Data <input type="text"/>	Data de Cotação <input type="text"/>	Amortização <input type="text"/>
Data <input type="text"/>	Data de Cotação <input type="text"/>	Amortização <input type="text"/>
Data <input type="text"/>	Data de Cotação <input type="text"/>	Amortização <input type="text"/>
Data <input type="text"/>	Data de Cotação <input type="text"/>	Amortização <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Descrição dos campos da tela de Registro da Agenda de Eventos

Campo	Descrição
Registro da Agenda de Eventos – Campos de preenchimento obrigatório.	
Meu número	Número de controle do participante.
Valor da Taxa a Termo	Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.
Data	Indica data do evento. É a data onde ocorrerá a liquidação financeira de valor de referência ou redução do valor base.
Data de Cotação	Data da cotação que será utilizada para liquidação do evento.
Amortização	Informado com até 3 (três) inteiros e 5 (cinco) decimais.

Após clicar no botão **Enviar**, o sistema apresenta a tela para confirmar os dados.

4.6 Alteração de Contrato

Termo > Termo com Fluxo > Alteração de Contrato

Visão Geral

Função disponível para que o Comprador ou Vendedor possa alterar o contrato.

Tela Filtro de Alteração de Contrato

Campos de preenchimento obrigatório.

Tela de Alteração de Contrato de Termo com Fluxo e TARF

Descrição dos campos da tela de Alteração de Contrato de Termo com Fluxo e TARF

Campos com possibilidade de alteração

Mesma definição de campos de preenchimento obrigatório do registro.

Cotação para o Vencimento	Lista pré-definida: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5 Indica a data de cotação para o vencimento.
Boletim	18:00h-Fechamento. Boletim de fechamento de cotação da moeda.
Taxa a Termo	Caixa com as opções “ÚNICO” e “VARIÁVEL”

Campos com possibilidade de alteração	
Número controle interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Informado com até 10 (dez) inteiros.
Cap. Global Vendedor	Indica o valor Máximo (exclusive) de créditos que o Vendedor receberá sem disparar o TARNOUT.
Valor Base (Referência)	Valor base do contrato expresso em quantidades da moeda de referência. Informado com até 12 (doze) inteiros e 2 (dois) decimais.
Alavancagem	Caixa com as opções: “Único” e “Variável”
Limites	Caixa com as opções: “Único” e “Variável”
Data início	Indica a data de início do fluxo de termos
Data vencimento	Data de vencimento do contrato. Livremente pactuada entre os participantes.
Moeda base referência	Indica a moeda objeto do contrato a termo.
Moeda cotada	Indica a moeda de referência para apuração da atualização do contrato.
Fonte de informação	Indica a fonte utilizada para cotação da moeda.
Observação	Campo destinado ao complemento da descrição do contrato. Texto livre com até 280 caracteres.

4.7 Lançamento de Taxa de Câmbio para Ajuste

Termo > Termo com Fluxo > Lançamento de Taxa de Câmbio para Ajuste

Visão Geral

Esta função possibilita informar a cotação para os casos em que a Fonte de Informação não divulgar a cotação necessária para o cálculo do Ajuste.

Na data no evento, caso a fonte de informação não divulgar a cotação, o evento deverá ficar pendente de lançamento de taxa de câmbio até que o participante efetue o lançamento da mesma.

Tela de Lançamento de Taxa de Câmbio para Ajuste

Lançamento de Taxa de Câmbio	
Parte (Conta)	<input type="text"/> - <input type="text"/> - <input type="text"/>
Contraparte(Conta)	<input type="text"/> - <input type="text"/> - <input type="text"/>
Posição do Participante	<input type="text"/> ▼
Código IF	<input type="text"/>
Nº Controle Interno	<input type="text"/>
Taxa de Câmbio	<input type="text"/> , <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela de Lançamento de Taxa de Câmbio para Ajuste

Campos com possibilidade de alteração

Campos de preenchimento obrigatório.

Parte (Conta)	Número da conta do participante na Cetip.
Contraparte (Conta)	Código Cetip do outro membro envolvido no lançamento da operação.
Posição do Participante	Caixa com as opções Comprador e Vendedor.
Código IF	Código do Instrumento Financeiro
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Informado com até 10 (dez) inteiros.
Taxa de Câmbio	Taxa de câmbio utilizada. Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.

4.8 Cancelamento de Contrato

Termo > Termo com Fluxo > Cancelamento de Contrato

Visão Geral

Esta função possibilita o cancelamento de Contrato de Termo com Fluxo.

Tela de Lançamento de Cancelamento de Contrato

Descrição dos Campos da Tela Cancelamento de Contrato

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Parte (Conta)	Código Cetip que identifica a parte da operação.
Contraparte (Conta)	Código Cetip que identifica a contraparte da operação.
Posição do Participante	Posição da Parte no Contrato de Termo com Fluxo.
Código do IF	Código do instrumento financeiro da que se quer cancelar.
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Informado com até 10 (dez) inteiros.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se confirmado o cancelamento, retorna à tela da área de serviços, informando que a operação de cancelamento foi realizada.

5 CONSULTAS

5.1 Contratos

Termo > Consultas > Termo21 > Consulta de Contratos

Visão Geral

Exibe os contratos efetuados pelo participante, com as respectivas datas de vencimento e de registro.

Tela Filtro

Consulta Contratos

Comprador (Nome Simplificado)

Comprador (Razão Social)

Tipo de Conta Comprador

Comprador (Conta)

Vendedor (Nome Simplificado)

Vendedor (Razão Social)

Tipo de Conta Vendedor

Vendedor (Conta)

Situação

Fonte de Informação

Contrato

Contrato(Original)

Tipo Instrumento Financeiro

Tipo

Data de Operação

Data de Registro

Data de Vencimento

Ao clicar no botão **PESQUISAR**, é apresentada tela de relação.

Na Tela de Relação, a primeira coluna (Contrato) identifica o número do contrato. Ao ser selecionado, exibe as características do contrato.

Descrição dos Campos da Tela Filtro

Campo	Descrição
Comprador (Nome simplificado)	Nome simplificado que identifica, no ambiente da Cetip, o participante envolvido na operação.
Comprador (Razão Social)	Razão Social do participante envolvido na operação.
Tipo de Conta Comprador	Identificação da conta do Comprador. Caixa de seleção com as opções: Própria, Cliente1, Cliente2, Emissora, Caução, Reserva Técnica ou Margem.

Campo	Descrição
Comprador (Conta)	Número da conta do Comprador na Cetip.
Vendedor (Nome simplificado)	Nome simplificado que identifica o outro membro envolvido na operação no ambiente da Cetip.
Vendedor (Razão Social)	Razão Social do outro membro envolvido na operação.
Tipo de Conta Vendedor	Identificação da conta do Vendedor. Caixa de seleção com as opções: Própria, Cliente1, Cliente2, Emissora, Caução, Reserva Técnica ou Margem.
Vendedor (Conta)	Número da conta do Vendedor na Cetip.
Situação	Caixa de seleção com as opções: Todas, Cancelado, Antecipado total, Avaliado, Confirmado, Vencido, Vencido não resgatado, Resgatado, Confirmado, Pendente Câmbio (<i>Feeder</i>) e etc.
Fonte de informação	Indica a fonte utilizada para cotação da moeda.
Contrato	Número atribuído ao contrato quando efetuado o registro do mesmo.
Contrato (Original)	Número atribuído ao contrato quando efetuado uma operação de cessão.
Tipo Instrumento Financeiro	Informar o tipo de instrumento financeiro: TER ou TMO.
Tipo	Informar o tipo de característica do contrato. Caixa de seleção com as opções: Final, Asiático Aritmética Simples ou Asiático Aritmética Ponderada.
Data de Operação	Data em que o participante contratou a operação.
Data de Registro	Data da efetivação do contrato.
Data de Vencimento	Data na qual o contrato vence.

Tela de Relação

Consulta Contratos							
Página 1 de 6 (Linhas 1 a 25 de 149)							
Data e Hora da Consulta: 14/10/2015 - 16:35:10							
 Critério de pesquisa							
Contrato	Tipo Inst. Financeiro	Vendedor	Comprador	Fonte de Informação	Data de Operação	Data de Registro	Data de Vencimento
15J00000838	TERMO DE MOEDA	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	02715.00-1 TESTE - IFBB	SISBACEN/FEEDER	09/10/2015	09/10/2015	14/10/2015
15J00000837	TERMO DE MOEDA	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	02715.00-1 TESTE - IFBB	SISBACEN/FEEDER	09/10/2015	09/10/2015	14/10/2015
15J00000836	TERMO DE MOEDA	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	02715.00-1 TESTE - IFBB	SISBACEN/FEEDER	09/10/2015	09/10/2015	14/10/2015
15J00000831	TERMO DE MOEDA	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	02715.00-1 TESTE - IFBB	SPOT	09/10/2015	09/10/2015	14/10/2015
15J00000830	TERMO DE MOEDA	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	02715.00-1 TESTE - IFBB	SPOT	09/10/2015	09/10/2015	14/10/2015
15J00000829	TERMO DE MOEDA	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	02715.00-1 TESTE - IFBB	SPOT	09/10/2015	09/10/2015	14/10/2015

(continua)

Saldo (R\$)	Situação	Tipo	CPF/CNPJ Comprador	CPF/CNPJ Vendedor	Responsável pela Aceleração - Parte	Responsável pela Aceleração - Contraparte	Agente de Calculo - Parte	Agente de Calculo - Contraparte
0,00	PENDENTE CAMBIO	FINAL						
0,00	PENDENTE CAMBIO	FINAL						
0,00	PENDENTE CAMBIO	FINAL						
0,00	PENDENTE CAMBIO	FINAL						
0,00	PENDENTE CAMBIO	FINAL						

 << < 1 > >>
 Excel

(fim)

Os números dos contratos são exibidos com *link* que, quando acionado, exibe tela de detalhe com as principais características do contrato.

Tela Detalhe do Contrato a Termo de Moeda

Contrato a Termo de Moeda Sem Entrega Física		
Código Contrato 15J00001463		
Comprador 05000.10-8 TESTE - BCO RIO S/A	CPF/CNPJ Comprador 233.110.534-00	
Vendedor 05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	CPF/CNPJ Vendedor	
Data de Operação 13/10/2015	Data de Vencimento 13/11/2015	
Data de Registro 14/10/2015		
Valor Base 500.000,00	Situação CONFIRMADO	
Valor Antecipado 0,00	Contrato Global NÃO	
Moeda Base(Referência) USD(220)-DOLAR DOS EUA	Taxa a Termo 2,990000	Cross Rate na Avaliação? NÃO
Ajustar Taxa SIM	Responsável pelo Ajuste de Taxa VENDEDOR	
Data Inicial para Ajuste de Taxa 15/10/2015	Data Final para Ajuste de Taxa 20/10/2015	Taxa ajustada em
Saldo 0,00	Taxa de Câmbio Utilizada na Avaliação	Data da Última Atualização
Fonte de Informação SISBACEN		
Cotação para o Vencimento D-1		Boletim PTAX800 Fechamento
Moeda Cotada BRL(790)-REAL	Taxa média para Termo Asiático -	
Termo a Termo NÃO	Data Fixação	
Forma de Atualização	Valor ou Percentual Negociado	
Limites	Superior (Paridade)	Inferior (Paridade)
Prêmio a ser pago pelo	Valor do Prêmio (R\$)	
Modalidade de Liquidação	Código Identificador	
Observação		

[Versão para Impressão](#)

Observação:

Quando a Taxa Forward de um contrato é alterada (através da função Ajustar Taxa), o campo **taxa ajustada em**, apresenta data em que a taxa fora ajustada.

6 INFORMAÇÕES ADICIONAIS

6.1 Formação dos Códigos do Instrumento Financeiro

Para Contrato de Termo de Moeda - TER

Exemplo: - AAMXXXXXXXX

Onde:

AA = Ano de Emissão

M = Sequência representativa do mês da emissão, onde A corresponde à janeiro, B fevereiro e assim por diante, até L que corresponde à dezembro

XXXXXXXX = Sequência alfanumérica

Para Contrato de Termo de Moeda (migrados)

Exemplo: F13H06089

Onde:

F = será sempre F

13 = Dois últimos dígitos do ano da data de operação

H = Sequência representativa do mês da emissão, onde A corresponde à janeiro, B fevereiro e assim por diante, até L que corresponde à dezembro.

06089 = Sequência numérica

Para Termo com Fluxo – TCF

Exemplo: AAMXXXXXXXX

Onde:

AA = Ano de Emissão

M = Sequência representativa do mês da emissão, onde A corresponde à janeiro, B fevereiro e assim por diante, até L que corresponde à dezembro

XXXXXXXX = Sequência alfanumérica.

6.2 Cruzamento de Funcionalidades

	Contrato	Contrato com Cesta de Garantia	Estorno	Taxa de Câmbio para Avaliação	Intermediação
Estorno	Possível			Possível	Possível
Antecipação	Possível	Possível	Possível		
Taxa de Câmbio para Avaliação	Possível	Possível	Possível		
Intermediação	Possível	Possível	Possível		
Cessão	Possível		Possível		
Confirmação de Cessão			Possível		
Alteração de Lançamento	Possível	Possível		Possível	Possível
Alteração de Contrato	Possível				

6.3 Regras de Registro Conforme Fonte de Informação

Fontes Alternativas de Obtenção de Taxas de Câmbio

As fontes alternativas de utilização de cotações de compra, venda ou média entre compra e venda são:

Sisbacen

Sistema de informação do Banco Central.

Os valores relativos às cotações utilizados para avaliação e liquidação dos contratos são obtidos através da consulta a este sistema.

Feeder

Sistema de informação de dados com atualização em tempo real.

Os valores relativos às cotações utilizados para avaliação e liquidação dos contratos são informados, através de função específica no sistema.

Spot

Alternativa disponível somente para moeda Dólar dos Estados Unidos.

Os valores relativos à cotação utilizados para avaliação e liquidação dos contratos são informados, através de função específica no sistema, pelos participantes registradores conforme as características do contrato previamente pactuadas no registro.

Sisbacen/Feeder

Alternativa válida exclusivamente para contratos que utilizam o *Cross Rate*.

Fonte mista de informação de taxas de câmbio para avaliação e liquidação de contratos.

Campos Que Devem Ser Informados Conforme a Escolha da Fonte de Informação

Campo da Tela Contrato	Campo Equivalente na Mensageria	FEEDER	SPOT	SISBACEN	SISBACEN/FEEDER
<TpContrtoTermo>					
Cotação para o Vencimento	<IndrDesloc>			Ver tabela 4 e 5	Ver tabela 6
Boletim	<IndrBol>			Ver tabela 4 e 5	Ver tabela 6
Fonte de Consulta	<TpFnte>	Ver tabela 1, 2, 7 e 8	Ver tabela 3		Ver tabela 7 e 8

Campo da Tela Contrato	Campo Equivalente na Mensageria	FEEDER	SPOT	SISBACEN	SISBACEN/FEEDER
Tela ou Função de Consulta	<DescRefCons>	X	X		X
Praça de Negociação	<DescPcaCot>	X	X		X
Horário de Consulta	<DescHrioCons>	X	X		X
Cotação Taxa Câmbio R\$/Cotada ou R\$/USD	<TpCotCam>	X	X		Ver tabela 6
Cotação Paridade Moeda/USD ou USD/Moeda	<TpCotParid>	Ver tabela 1 e 2	Ver tabela 3		Ver tabela 6
Data da Avaliação	<DtAval>	X	X		X

Tabela 1 - Fonte de Informação: FEEDER e moeda USD

Fonte de consulta	Cotação Taxa Câmbio	Cotação Paridade
Bloomberg, Reuters, Broadcast.	Venda ----- Compra ----- Média	Nenhum

É obrigatório selecionar a opção: Nenhum do campo Cotação-Paridade.

Não pode ser selecionado o campo *Cross Rate*.

Não é permitida fonte de consulta *Spot* e BCE- Banco Central Europeu.

Tabela 2 - Fonte de Informação: FEEDER e outra moeda diferente de USD

Fonte de consulta	Cotação Taxa Câmbio	Cotação Paridade
Bloomberg, Reuters, Broadcast, BCE.	Venda	Venda ou Compra ou Média ou Nenhum.
	Compra	
	Média	

É obrigatório informar Cotação-Paridade com Venda ou Compra ou Média, se o campo *Cross Rate* for selecionado.

Não é permitida fonte de consulta *Spot*.

Tabela 3 - Fonte de Informação: SPOT e moeda USD

Fonte de consulta	Cotação Taxa Câmbio	Cotação Paridade
Somente <i>Spot</i>	Venda	Nenhum
	Compra	
	Média	

É obrigatório selecionar a opção: Nenhum do campo Cotação-Paridade.

Não pode ser selecionado o campo *Cross Rate*.

Não é possível com outro tipo de moeda.

Tabela 4 - Fonte de Informação: SISBACEN e moeda USD

Cotação para o vencimento	Boletim
D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5	PTAX800 18:00-Fechamento

Não é permitida a seleção do campo *Cross Rate*.

Tabela 5 - Fonte de Informação: SISBACEN e outra moeda diferente de USD

Cotação para o vencimento	Boletim
D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5	PTAX800 de Fechamento

Não é permitida a seleção do campo *Cross Rate*.

Tabela 6 - Fonte de Informação: SISBACEN/FEEDER e outra moeda diferente de USD e EURO

Cotação para o vencimento	Boletim	Fonte de Consulta	Cotação Taxa de Câmbio	Cotação Paridade
D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5	PTAX800 de 18:00 Fechamento	Bloomberg, Reuters, Broadcast.	Venda	Compra, Venda ou Média.

É obrigatório informar Cross Rate.

Não é possível Cotação Paridade Nenhum.

Não é permitida fonte de consulta *Spot*.

Tabela 7 - Fonte de Informação: FEEDER e moeda EURO

Fonte de consulta	Cotação Taxa Câmbio	Cotação Paridade
Bloomberg, Reuters, Broadcast, BCE.	Venda Compra Média	Venda ou Compra ou Média ou Nenhum.

É obrigatório informar Cotação-Paridade com Venda ou Compra ou Média, se o campo *Cross Rate* for selecionado.

Não é permitida fonte de consulta *Spot*.

Tabela 8 - Fonte de Informação: SISBACEN/FEEDER e moeda EURO

Cotação para o vencimento	Boletim	Fonte de Consulta	Cotação Taxa de Câmbio	Cotação Paridade
D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5	PTAX800 de 18:00 Fechamento	Bloomberg, Reuters, Broadcast, BCE.	Venda	Compra, Venda ou Média.

É obrigatório informar *Cross Rate*.

Não é possível Cotação Paridade Nenhum.

Não é permitida fonte de consulta *Spot*.

6.4 Regras de Negócios

Identificação dos Membros Envolvidos na Operação

Participante

Pessoa Física ou Jurídica, comprador ou vendedor da moeda de referência.

Contraparte

Pessoa Física ou Jurídica, comprador ou vendedor da moeda de referência.

Cedente

Participante (ou a Contraparte) que transfere o contrato.

Adquirente

Pessoa física ou jurídica que adquire o contrato.

Intermediário

Membro de Mercado, cujo objetivo é encontrar contrapartes interessadas em realizar contratos.

Banco Liquidante

Instituições financeiras com conta reserva bancária compulsória, em espécie, no Banco Central do Brasil, detentoras de conta individualizadas junto a Cetip, habilitadas no sistema, para prestar serviços de liquidação financeira das operações registradas no sistema, bem como para o pagamento das taxas e encargos relativos a utilização deste.

Anuente

Participante que permaneceu no contrato.

Identificação das Entidades

Membros de Mercado

Entende-se como tal as instituições financeiras ou as sociedades autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil, a atuarem neste mercado, associadas a Cetip.

Cliente 1

São clientes próprios do Membro de Mercado. Considerando-se como tal as pessoas físicas ou jurídicas não-financeiras, investidores institucionais ou fundos de investimento, não obrigados por normas específicas a possuírem conta própria em sistema de custódia, registro e liquidação financeira, e que operam somente através das instituições as quais estejam vinculados.

Cliente 2

Considerando-se como tal as pessoas físicas ou jurídicas, investidores institucionais ou fundos de investimento não obrigados por normas específicas a possuírem conta própria em sistema de custódia, registro e liquidação financeira, e que operam tanto com as instituições as quais estejam vinculados, como com outros Membros de Mercado.

Modalidades de Liquidação Financeira**Sem Modalidade:**

Modalidade que permite a liquidação financeira fora do âmbito da Cetip.

Tipos de Operação:

- Registro de Contrato
- Alteração de Contrato
- Avaliação de Taxa de Câmbio
- Ajustar Taxa
- Antecipação de Contrato
- Cessão de Contrato
- Estornos de Operação
- Vencimento

Valor Bruto em Tempo Real (LBTR) - BRUTA:

Modalidade que exige a liquidação financeira em tempo real de operação por operação.

Tipos de Operação:

- Prêmio
- Antecipação de Contrato
- Intermediação de Contrato

Liquidação Bilateral:

Modalidade que permite a compensação dos valores financeiros do conjunto das operações realizadas entre dois participantes.

Tipos de Operação:

- Prêmio
- Antecipação de Contrato
- Vencimento

6.5 Cross Rate

É a taxa de câmbio resultante das cotações de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.

O uso desta opção não é permitido, quando moeda de referência ou cotada for Dólar dos EUA e quando a fonte de informação for Sisbacen.

A Cetip adota dois processos para obtenção das taxas de câmbio resultantes expressas em Reais por Moeda para avaliações intermediárias e avaliação para liquidações no vencimento, conforme o tipo de moeda de referência.

O sistema calcula a taxa resultante, baseadas no campo **Tipo** da Tabela Moedas Autorizadas para Registros de Contratos a Termo, no capítulo Informações Adicionais/Moedas Negociadas, cujo domínio é A ou B.

Observações: Para maiores informações acesse o **Caderno de Fórmulas** no *site* da Cetip.

6.6 Moedas Negociadas

Moedas negociadas pelos participantes utilizadas para apuração de saldo do contrato.

Tipo de Moedas:

- Moeda Tipo A: Moeda cuja taxa de câmbio expressa em quantidades de moeda por uma unidade de Dólar dos Estados Unidos (USD).
- Moeda Tipo B: Moeda cuja taxa de câmbio é expressa em quantidades de Dólar dos Estados Unidos (USD) por uma unidade de moeda.

Tabela Moedas Autorizadas para Registros de Contratos a Termo

Moeda	Tipo	País	Símbolo	Código Moeda Sisbacen	Casas decimais no registro
Rande/África do Sul	A	África do Sul	ZAR	785	8
Marco Alemão(*)	A	Alemanha	DEM	610	8
Rial/Arábia Saudita	A	Arábia Saudita	SAR	820	8
Peso Argentino	A	Argentina	ARS	706	8
Dólar Australiano	B	Austrália	AUD	150	8
Franco Belga(*)	A	Bélgica	BEF	360	8
Boliviano	A	Bolívia	BOB	30	8
REAL	A	Brasil	BRL	790	8
Dólar Canadense	A	Canadá	CAD	165	8
Rial/Catar	A	Catar	QAR	800	8
Iuan Renmimbi/China	A	China	CNY	795	8

Moeda	Tipo	País	Símbolo	Código Moeda Sisbacen	Casas decimais no registro
Peso Chileno	A	Chile	CLP	715	8
Dólar/Cingapura	A	Cingapura	SGD	195	8
Peso Colombiano	A	Colômbia	COP	720	8
Euro	B	Comunidade Européia	EUR	978	8
Won/Coréia do Sul	A	Coréia do Sul	KRW	930	8
Coroa Dinamarquesa	A	Dinamarca	DKK	055	8
Sucre	A	Equador	ECS	895	8
Peseta Espanhola(*)	A	Espanha	ESP	700	8
Dólar dos Estados Unidos	-	Estados Unidos	USD	220	6 (seis)
Franco Francês(*)	A	França	FRF	395	8
Florim Holandês(*)	A	Holanda	NLG	335	8
Peso/Filipinas	A	Filipinas	PHP	735	8
Dólar/Hong-Kong	A	Hong-Kong	HKD	205	8
Forint/Hungria	A	Hungria	HUF	345	8
Rupia/Índia	A	Índia	INR	860	8
Rupia/Indonésia	A	Indonésia	IDR	865	8
Lira Italiana(*)	A	Itália	ITL	595	8
Iene Japonês	A	Japão	JPY	470	8
Franco de Luxemburgo(*)	A	Luxemburgo	LUF	400	8
RINGGIT	A	Malásia	MYR	828	8
Peso Mexicano	A	México	MXN	741	8
Coroa Norueguesa	A	Noruega	NOK	065	8
Dólar/Nova Zelândia	B	Nova Zelândia	NZD	245	8
Guarani/Paraguai	A	Paraguai	PYG	450	8
Novo-Sol	A	Peru	PEN	660	8

Moeda	Tipo	País	Símbolo	Código Moeda Sisbacen	Casas decimais no registro
Zloty/Polônia	A	Polônia	PLN	975	8
Escudo Português(*)	A	Portugal	ESC	315	8
Libra Esterlina	B	Reino Unido	GBP	540	8
Cora Tcheca	A	República Tcheca	CZK	075	8
Rublo/Rússia	A	Rússia	RUB	830	8
Coroa Sueca	A	Suécia	SEK	070	8
Franco Suíço	A	Suíça	CHF	425	8
Bath/Tailândia	A	Tailândia	THB	015	8
Novo Dólar/Taiwan	A	Formosa (Taiwan)	TWD	640	8
Nova Lira/Turquia	A	Turquia	TRY	642	8
Peso Uruguaio	A	Uruguai	UYU	745	8
Bolívar Forte	A	Venezuela	VEF	26	8
Dongue	A	Vietnã	VND	260	8
Colón/Costa Rica	A	Costa Rica	CRC	040	8

7 GLOSSÁRIO

A

Adquirente: Pessoa física ou jurídica que adquire o contrato

Anuente: Participante que permaneceu no contrato

B

Banco Liquidante: Instituição financeira com conta reserva bancária compulsória, em espécie, no Banco Central do Brasil, detentora de conta individualizada junto à Cetip, habilitada para prestar serviços de liquidação financeira das operações registradas no módulo, bem como para pagamento das taxas e encargos relativos à utilização deste módulo

C

Cedente: Participante (ou a Contraparte) que transfere o contrato.

Cliente 1: Cliente próprio do Membro de Mercado. Pessoa física ou jurídica não-financeira, investidor institucional ou fundo de investimento, não obrigado por normas específicas a possuir conta própria em sistema de custódia, registro e liquidação financeira, e que opera somente por meio das instituições às quais esteja vinculado

Cliente 2: Pessoa física ou jurídica, investidor institucional ou fundo de investimento não obrigado por normas específicas a possuir conta própria em sistema de custódia, registro e liquidação financeira, e que opera tanto com as instituições à quais esteja vinculado, como com outros Membros de Mercado

Contraparte: Pessoa Física ou Jurídica, comprador ou vendedor da moeda de referência

D

Data de referência: Data(s) de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada ou aritmética simples

I

Intermediário: Membro de Mercado cujo objetivo é encontrar contrapartes interessadas em realizar contratos

M

Média Aritmética Ponderada: É a média das cotações apuradas nas datas indicadas na tela de Registro de Contrato e ponderadas pela parcela do Valor Base, também indicada na referida tela

Média Aritmética Simples: É a média das cotações apuradas nas datas indicadas na tela de Registro do Contrato

Membros de Mercado: Instituições financeiras ou sociedades autorizadas pelo Banco Central do Brasil a atuar neste mercado, associadas à Cetip

Moeda Base (Referência): Moeda objeto do Termo

Moeda Cotada: Moeda de referência em que a Moeda Base é cotada

P

Participante: Pessoa Física ou Jurídica, comprador ou vendedor da moeda de referência

Preço de Antecipação: Preço relativo à antecipação do Contrato a Termo de Moedas.

S

SISBACEN: Sistema de informação do Banco Central. Os valores relativos às cotações utilizados para avaliação e liquidação dos contratos são obtidos através da consulta a este sistema

V

Valor Base (Referência): Valor base do contrato expresso em quantidades da moeda de referência.