


---



# Manual de Operações

Swap



**Versão: 29/06/2020**

**Atualizado em: 25/02/2021**

## Conteúdo

<b>Atualizações da Versão .....</b>	<b>5</b>
<b>Introdução ao Swap .....</b>	<b>56</b>
Conhecendo o Produto .....	57
Ações dos botões das telas .....	60
<b>Lançamento .....</b>	<b>61</b>
Registro de Contrato - Pagamento Final .....	62
Registro de Contrato - Fluxo Constante .....	76
Registro de Contrato - Fluxo Não Constante.....	88
Registro Fluxo de Caixa Não Constante .....	100
Registro de Fluxo de Datas de Verificação .....	105
Registro de Pagamento de Prêmio .....	108
Registro de Parâmetros para Disparo de Reset.....	111
Registro de Curvas Marcadas a Mercado .....	115
Registro de Reset .....	117
Intermediação de Contrato.....	121
Registro de Reset - Alterações .....	123
Alteração de Contrato - Pagamento Final .....	127
Alteração de Contrato - Fluxo Constante .....	136
Alteração de Contrato - Fluxo não Constante.....	144
Alteração de Fluxo de Caixa Não Constante.....	152
Alteração de Fluxo de Data de Verificação .....	155
Alteração de Pagamento de Prêmio.....	157
Antecipação de Contratos .....	160
Cessão de Contrato .....	167
Cancelamento de Contrato .....	174
Atualização de PU/Fator .....	176
Registro de Taxas de Juros Mercado Internacional.....	179
Exercício de Opção.....	181
<b>Consulta .....</b>	<b>187</b>
Características de Contrato de Swap .....	188
Agenda de Eventos.....	196
Fluxo não Constante .....	198
Histórico de Parâmetros Para Disparo de Reset.....	202
Histórico de Curvas Marcadas a Mercado.....	204
Histórico Reset.....	207

Resumo de Contratos .....	209
Contratos com Opção de Arrependimento .....	210
Contratos de Swaption/Compound.....	211
Histórico de Alteração de Contratos.....	212
<b>Consulta Tipo Classe .....</b>	<b>214</b>
Curvas Não-Calculadas (VCP).....	215
Moedas.....	217
Taxas de Juros Nacionais .....	219
Taxas de Juros Internacionais .....	221
Índices .....	224
Índices de Preço.....	224
Índices Nacionais .....	226
Índices Internacionais.....	227
ETFs	232
Futuro de Índices.....	241
Outros Índices .....	243
Futuro de Taxas de Juros .....	246
Futuro de Moedas.....	247
Futuro de Mercadorias .....	248
Futuro de Ativos.....	250
Ações Nacionais .....	251
Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira).....	257
Ações Internacionais.....	259
Ativos.....	277
Estratégia.....	287
Paridade de Moedas .....	288
Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais.....	292
Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais .....	295
Commodity.....	300
Títulos Públicos Nacionais .....	303
Bloqueio e Desbloqueio VCP .....	304
<b>Informações Adicionais .....</b>	<b>305</b>
Código dos contratos .....	306
Prazos para Alteração.....	307
Contratos com Funcionalidades .....	308
Cruzamento de Funcionalidades x Operações.....	313
Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 1 .....	314

---

Contratos com limitador .....	316
Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2 .....	317
Cancelamento referente aos prêmios e comissões .....	319
Registro Contrato com curva VCP .....	321
Regras de Negócios.....	323
Metodologia de Cálculo.....	324
Formação dos Códigos do Instrumento Financeiro Swap .....	325
<b>Glossário.....</b>	<b>326</b>

## Atualizações da Versão

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/06/2020	25/02/2021	- Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais - Índices Internacionais	Inclusões nas "Informações Adicionais".
29/06/2020	25/02/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15658</b> SOLXPCOM Index; <b>15667</b> BNPIWA8U Index; <b>15762</b> EFIV UP Equity e <b>15802</b> YOLO US Equity.
29/06/2020	25/02/2021	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15409</b> BTGPGRF KY Equity.
29/06/2020	25/02/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15633</b> EBR US Equity; <b>15634</b> MNOD LI Equity; <b>15635</b> VINP US Equity; <b>15637</b> MWK US Equity; <b>15655</b> SQ US Equity; <b>15656</b> SF SS Equity; <b>15659</b> NVDA US Equity; <b>15665</b> TSLA UW Equity; <b>15801</b> OXY US Equity e <b>15803</b> HP US Equity.
29/06/2020	25/02/2021	Ações	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15636</b> VAMO3 BZ Equity.
29/06/2020	22/01/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15553</b> TENB US Equity; <b>15615</b> PFE UN Equity e <b>15616</b> MELI UW Equity.
29/06/2020	22/01/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15552</b> USCARN8E Index e <b>15593</b> JPMRFTED Index.
29/06/2020	22/01/2021	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15554</b> IEUR US Equity; <b>15594</b> ITB US Equity; <b>15613</b> URA US Equity; <b>15614</b> ICLN UP Equity; <b>15617</b> IPO UP Equity; <b>15618</b> BETZ UP Equity; <b>15619</b> ARKG UP Equity; <b>15620</b> XSOE UP Equity; <b>15621</b> SCHA UP Equity e <b>15622</b> REMX UP Equity
29/06/2020	09/12/2020	Moedas	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15546</b> - XDR BNG Curncy
29/06/2020	09/12/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15532</b> CCL US Equity; <b>15533</b> YNDX US Equity; <b>15534</b> INAQ US Equity; <b>15535</b> JOF US Equity; <b>15539</b> CMI US Equity; <b>15538</b> NKLA US Equity; <b>15537</b> BLPD US Equity; <b>15540</b> LIN US Equity; <b>15541</b> PYPL US Equity; <b>15542</b> POG LN Equity; <b>15543</b> POLY LN Equity; <b>15544</b> MAIL LI Equity; <b>15545</b> ITM LN Equity; <b>15547</b> PVG US Equity;
29/06/2020	08/12/2020	Ações Nacionais	Alteração do ativo: <b>15531</b> - IGNT3 BZ Equity para GNDI3 BZ Equity.
29/06/2020	03/12/2020	Registro de Contrato - Pagamento Final	Alteração na descrição sobre o " Código da Commodity"
29/06/2020	24/11/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15497</b> EQX US Equity; <b>15499</b> ZEN US Equity; <b>15501</b> SBER LI Equity; <b>15502</b> SKG LN Equity; <b>15503</b> AAL LN Equity; <b>15517</b> WRK US Equity e <b>15518</b> IP US Equity.
29/06/2020	24/11/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15530</b> LOGG3 BZ Equity e <b>15531</b> IGNT3 BZ Equity
29/06/2020	24/11/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15500</b> CIMAAIAI Index; <b>15504</b> M1US000V Index; <b>15505</b> M1WO000G Index; <b>15506</b> M1US000G Index; <b>15507</b> M1WO000V Index e <b>15508</b> SOLXPTEC Index.
29/06/2020	24/11/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15498</b> SUSC US Equity.
29/06/2020	13/11/2020	Ações Internacionais	Alteração na descrição sobre o "Cotação Inicial" em "Informações Necessárias"

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/06/2020	04/11/2020	Moedas	Alteração na descrição sobre o "Cotação Inicial" em "Informações Necessárias"
29/06/2020	28/10/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15496</b> GMATDEA ID Equity
29/06/2020	28/10/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15493</b> IGTA3 BZ Equity
29/06/2020	28/10/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15492</b> SKYY UP Equity; <b>15495</b> IXJ US Equity
29/06/2020	28/10/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15490</b> VRTX UW Equity; <b>15491</b> DXCM UW Equity; <b>15497</b> EQX US Equity
29/06/2020	07/10/2020	Ações Nacionais	Alteração do ativo: <b>5074 - NATU3</b> para <b>NTCO3</b> .
29/06/2020	07/10/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15449</b> SPXESUP Index.
29/06/2020	07/10/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15468</b> GME US Equity e <b>15488</b> CLF US Equity.
29/06/2020	28/09/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15448</b> MATRDHC ID Equity.
29/06/2020	28/09/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15433</b> BRFSBZ 5 ¼ 09/21/50 REGS CORP.
29/06/2020	28/09/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15430</b> QQQ UP Equity; <b>15431</b> MCHI UN Equity e <b>15432</b> Ewt up equity.
29/06/2020	14/09/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15419</b> JLN US Equity; <b>15421</b> XHB US Equity; <b>15423</b> DBA US Equity e <b>15429</b> SHE US Equity.
29/06/2020	14/09/2020	Futuro de Mercadorias	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15428</b> Mini Futuro de Prata.
29/06/2020	14/09/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15425</b> BIDI4 BZ Equity.
29/06/2020	14/09/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15420</b> BLMN US Equity; <b>15422</b> NGD US Equity e <b>15424</b> CCJ US Equity
29/06/2020	01/09/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15417</b> ICLN US Equity e <b>15418</b> UUP UP Equity.
29/06/2020	25/08/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15388</b> KWEB US Equity e <b>15408</b> VNQ US Equity.
29/06/2020	25/08/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15409</b> BTGPGRD KY Equity; <b>15410</b> BTGPGA1 KY Equity; <b>15411</b> BTGPA1A KY Equity e <b>15412</b> BTGPGRA KY Equity.
29/06/2020	25/08/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15384</b> GILD US Equity; <b>15385</b> AZN US Equity; <b>15413</b> NEM UM Equity; <b>15414</b> GOLD UM Equity; <b>15415</b> AU UM Equity e <b>15416</b> AEM UM Equity.
29/06/2020	12/08/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15344</b> VSTA US Equity; <b>15347</b> ARCE US Equity; <b>15348</b> FM CN Equity e <b>15364</b> TAST US Equity.
29/06/2020	12/08/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15345</b> TLT US Equity
29/06/2020	31/07/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15331</b> SHOP UM Equity e <b>15332</b> SQ UM Equity.
29/06/2020	31/07/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15284</b> NEOE3 BZ Equity.
29/06/2020	31/07/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15305</b> RDEDOR 4 ½ 01/22/30 REGS CORP e <b>15306</b> BANVOR 4 3/8 07/29/25.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/06/2020	31/07/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15285</b> DSI UP Equity e <b>15324</b> GDXJ US Equity.
29/06/2020	31/07/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14544</b> CSTREND Index; <b>15327</b> MSUSMPT6 Index; <b>15328</b> MSFDVT12 Index; <b>15329</b> MSFDMSV9 Index e <b>15330</b> MSFDMS11 Index.
29/06/2020	31/07/2020	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15325</b> MSUSBS17 Index e <b>15326</b> MSUSBZ20 Index. Exclusão do Tipo/Classe: <b>14544</b> CSTREND5 Index.
29/06/2020	22/07/2020	Índices Nacionais Índices Internacionais ETFs	Alteração na descrição sobre o "Cupom Limpo" no campo "Informações Necessárias".
29/06/2020	14/07/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12567</b> NDX Index.
29/06/2020	01/07/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15166</b> USFD US Equity e <b>15184</b> TECK US Equity
29/06/2020	01/07/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15244</b> CIEQPU01 Index; <b>15245</b> CIEQDUV3 Index e <b>15246</b> CIEQCUOI Index.
29/06/2020	01/07/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15164</b> DBB US Equity; <b>15185</b> ESGU US Equity; <b>15186</b> ESGE US Equity; <b>15187</b> ESGD US Equity; <b>15204</b> MCHI UP Equity e <b>15224</b> URTN US Equity.
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.
29/06/2020	29/06/2020	-Registro de Contrato – Pagamento Final -Registro de Contrato – Fluxo Constante -Registro de Contrato – Fluxo não Constante	Alteração na descrição dos campos "Cupom Limpo" e "Data de Cotação" do bloco: <b>Cupom Limpo/Data Cotação – Parte/Contraparte.</b>
29/06/2020	29/06/2020	Alteração de Contrato – Pagamento Final	Alteração na descrição dos campos "Cupom Limpo" e "Data de Cotação" do bloco: <b>Cupom Limpo/Data Cotação – Parte/Contraparte.</b>
29/06/2020	29/06/2020	- Ações Nacionais - Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira)	Alteração na descrição sobre o "Cupom Limpo" no campo "Informações Necessárias".
29/06/2020	29/06/2020	Ações Internacionais	Alteração na descrição sobre "Denominação" no campo "Informações Necessárias".
29/06/2020	29/06/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15065</b> IWM UP Equity; <b>15124</b> RSX US Equity e <b>15127</b> SIL US Equity.
29/06/2020	29/06/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15104</b> BRFSBZ 4 7/8 01/24/30 REGS CORP e <b>15105</b> AEGEBZ 5 ¾ 10/10/24 REGS CORP.
29/06/2020	29/06/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15125</b> FNV US Equity e <b>15126</b> GOLD US Equity.
29/06/2020	29/06/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15144</b> VVAR3 BZ Equity.
17/02/2020	26/05/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15084</b> F2036CP BZ Equity.
17/02/2020	18/05/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15066</b> BKLN IS Equity.
17/02/2020	14/05/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15048</b> AGI US Equity e <b>15049</b> AEM US Equity.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
17/02/2020	14/05/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15050</b> MTRE3 BZ Equity.
17/02/2020	14/05/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15064</b> XLV UP Equity.
17/02/2020	06/05/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15044</b> XPH UP Equity.
17/02/2020	06/05/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15045</b> BEEFBZ 6 ½ 09/20/26 REGS CORP.
17/02/2020	28/04/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15025</b> YDUQ3 BZ Equity; <b>15026</b> COGN3 BZ Equity.
17/02/2020	28/04/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>15024</b> EWZ UP Equity.
17/02/2020	23/04/2020	Taxas de Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14967</b> FEDL01 Index.
17/02/2020	23/04/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14904</b> CRAK US Equity; <b>14965</b> FEZ US Equity; <b>14968</b> IEF US Equity; <b>14988</b> XOP US Equity; <b>14990</b> GREK US Equity; <b>14991</b> EWU US Equity; <b>15004</b> EWUS US Equity; <b>15007</b> IVVB11 BZ Equity.
17/02/2020	23/04/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14985</b> BRCR11 (CNPJ 08.924.783/001-0).
17/02/2020	23/04/2020	Futuro de Mercadorias	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14925</b> Futuro de Palladium; <b>15006</b> Futuro de Platina.
17/02/2020	23/04/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14924</b> PETBRA 5 ¼ 02/01/29 CORP; <b>14944</b> ARGENT 2 12 12/31/38 GOVT; <b>14966</b> SBSPBZ 6 ¼ 16/12/20 REGS CORP; <b>14969</b> BVMFBZ 5 ½ 07/16/20 REGS CORP.
17/02/2020	23/04/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14970</b> TOTS3 BZ Equity
17/02/2020	23/04/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14984</b> ENIC US Equity; <b>14986</b> JNJ UN Equity; <b>15005</b> NLMK LI Equity.
17/02/2020	23/04/2020	Ações Internacionais	Atualização de participação para Ações Internacionais
17/02/2020	15/04/2020	Registro de Contrato - Pagamento Final	Ajuste nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
17/02/2020	23/03/2020	Ações Nacionais	Atualização de participação para Ações Nacionais
17/02/2020	12/03/2020	Índices Internacionais (ETF)	Atualização de proventos para ETF
17/02/2020	27/02/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14824</b> VVNT US Equity; <b>14825</b> SCR CN Equity; <b>14864</b> CNE CN Equity e <b>14885</b> FCX US Equity.
17/02/2020	27/02/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14823</b> PETRA 6.9 03/19/49 CORP; <b>14843</b> CSNABZ 6 34 01/28/28 REGS-CORP; <b>14846</b> ELEBRA 4 5/8 02/04/2030 REGS-CORP e <b>14884</b> 4 5/8 PERP REGS-CORP.



Versão	Atualização em	Referência	Atualização
17/02/2020	27/02/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14847</b> IYW UP Equity; <b>14848</b> JJC US Equity; <b>14849</b> OESA GR Equity; <b>14850</b> TUR US Equity; <b>14886</b> SLX US Equity e <b>14887</b> COPX US Equity.
17/02/2020	17/02/2020	- Contratos com funcionalidade - Exercício de Opção	Alteração do funcionamento da funcionalidade da opção de arrependimento, exclusivamente no vencimento, conforme comunicado no 002/2020-VPC.
28/05/2019	20/01/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14805</b> PETBRA 6 7/8 01/20/40 CORP; <b>14806</b> HIDRVS 5.95 01/24/25 CORP
28/05/2019	20/01/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14804</b> CSEAGG20 Index.
28/05/2019	20/01/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14763</b> ACEL/WS US Equity; <b>14783</b> GM UN; <b>14803</b> UBER UN Equity
28/05/2019	06/01/2020	Taxa de Juros Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14743</b> Selic REFIS.
28/05/2019	17/12/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14723</b> BMEBMZ 9 5/8 07/16/20 REGS-CORP
28/05/2019	12/12/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14683</b> BAC US Equity; <b>14684</b> SCHW US Equity; <b>14685</b> KO UN Equity e <b>14686</b> XP US Equity.
28/05/2019	10/12/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14663</b> V UN Equity.
28/05/2019	09/12/2019	Taxa de Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14624</b> EONIA Index.
28/05/2019	09/12/2019	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14643</b> MJ US Equity.
28/05/2019	02/12/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14623</b> BAKIDE 7.45 11/15/29 CORP.
28/05/2019	02/12/2019	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14544</b> CSTREND5 Index.
28/05/2019	02/12/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14583</b> GOOGL UW Equity.
28/05/2019	28/11/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14603</b> NEXA RESOURCES SA.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2019	21/11/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14543</b> DESP US Equity.
28/05/2019	11/11/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14503</b> BA US Equity
28/05/2019	01/11/2019	Registro de Contrato – Pagamento Final	Alteração na descrição do campo “Valor (R\$)”
28/05/2019	23/10/2019	Taxa de Juros Nacionais	Inclusão no campo “ Informações Necessárias” sobre o Percentual da Curva.
28/05/2019	22/10/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14444</b> MVFPO 6.748 06/01/34 REGS – CORP.
28/05/2019	22/10/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14423</b> FTCH US Equity e <b>14443</b> V US Equity.
28/05/2019	15/10/2019	Lançamentos	Alteração na descrição do campo “Adesão a Contrato”.
28/05/2019	11/10/2019	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14400</b> BZRFIB5+ Index; <b>14401</b> BZRFIRFM Index e <b>14402</b> BZRFIMAB Index.
28/05/2019	10/10/2019	Indices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14391</b> IB5M 11 BZ Equity; <b>14392</b> IRFM11 BZ Equity e <b>14393</b> IMAB11 BZ Equity
28/05/2019	10/10/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14351</b> BONSUC 9 1/4 11/03/20 REGS - CORP.
28/05/2019	10/10/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14331</b> MCD UN Equity.
28/05/2019	12/09/2019	Indices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14312</b> IJR US Equity.
28/05/2019	12/09/2019	Futuro de Mercadorias	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14310</b> FUTURO DE AÇUCAR; <b>14311</b> FUTURO DE ZINCO.
28/05/2019	06/09/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14291</b> SBS US Equity.
28/05/2019	27/08/2019	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14272</b> MGOIEAA LX Equity.
28/05/2019	27/08/2019	Futuro de Taxas de Juros	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14271</b> Futuro de Cupom IPCA (DAP).

<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>
28/05/2019	27/08/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14250</b> GDX US Equity.
28/05/2018	15/08/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14159</b> SPXU US Equity e <b>14190</b> QID US Equity.
28/05/2018	15/08/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14191</b> 7974 JT; <b>14210</b> IFS US Equity e <b>14230</b> KER FP Equity.
28/05/2018	15/08/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14231</b> BIDI11 BZ Equity.
28/05/2018	26/07/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13995</b> EXITO CB Equity.
28/05/2018	26/07/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14110</b> USIM 5 7/8 07/18/26 REGS – CORP.
28/05/2018	26/07/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão dos Tipos/Classe: <b>14090</b> SQQQ US Equity e <b>14130</b> SRTY US EQUITY.
28/05/2018	26/07/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>14075</b> TAE11 BZ Equity.
28/05/2018	24/06/2019	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: <b>13993</b> WORK US Equity; <b>13990</b> DIS UN Equity
28/05/2018	24/06/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13992</b> JSLGBZ 7 3/4 07/26/24 REGS - CORP
28/05/2018	24/06/2019	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13991</b> Futuro de DXY Index
28/05/2018	18/06/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13972</b> UNIGEL 10 1/2 01/22/24 REGS - Corp
28/05/2018	18/06/2019	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: <b>13973</b> SUZ US Equity; <b>13951</b> WCAGY US Equity
28/05/2018	18/06/2019	Cotas de Fundos de Investimento Internacional	Inclusão dos Tipos/Classe: <b>13971</b> PGIPVA ID Equity; <b>13970</b> MORAMAH LX Equity
28/05/2018	18/06/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13932</b> ENAT3 BZ Equity
28/05/2018	13/05/2019	Moedas	Melhoria da descrição das Informações Necessárias.

<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>
28/05/2018	13/05/2019	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13789</b> EURBARR LX Equity
28/05/2018	13/05/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13809</b> PDCAR 7 1/8 06/10/21 CORP; <b>13829</b> KLAB 5 3/4 04/03/29 CORP; <b>13930</b> BUENOS 9 58 04/18/28 CORP; <b>13931</b> BUENOS 6 12 02/15/23 CORP

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2018	13/05/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13850</b> SLCE3 BZ Equity; <b>13851</b> BRDT3 BZ Equity; <b>13890</b> IRBR3 BZ Equity; <b>13912</b> EGIE3 BZ Equity; <b>13913</b> GRND3 BZ Equity; <b>13914</b> RAPT4 BZ Equity
28/05/2018	13/05/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13849 NETS US Equity; <b>13911</b> IPOA US Equity
28/05/2018	18/03/2019	ETF	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13769</b> SMIN US Equity
28/05/2018	18/03/2019	Ativos	Inclusão dos Tipo/Classe: <b>13549</b> VALEBZ 5 78 06/10/21 Corp; <b>13530</b> MENDOZ 8 38 05/19/24 Cor
28/05/2018	18/03/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13569</b> 005930 KP Equity
28/05/2018	14/03/2019	Ativos	Inclusão dos Tipo/Classe: <b>13610</b> ITAU 6 18 PERP CORP; <b>13589</b> PETBRA 7 14 03/17/44 Corp
28/05/2018	14/03/2019	Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira)	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13669</b> PETR4 (contínuo)
28/05/2018	14/03/2019	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipo/Classe: <b>13689</b> 6758 JP Equity; <b>13629</b> WB US Equity; <b>13609</b> EA US Equity
28/05/2018	14/03/2019	ETFs	Inclusão dos Tipo/Classe: <b>13729</b> ACWX US Equity; <b>13649</b> GXG US Equity
28/05/2018	14/03/2019	Índices Internacionais	Inclusão dos Tipo/Classe: <b>13749</b> ENHAEMD5 Index; <b>13709</b> JPUSFTRC Index.
28/05/2018	21/01/2019	Taxas de Juros	Correção da descrição das informações Necessárias.
28/05/2018	21/01/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13429</b> B3SA3 BZ Equity
28/05/2018	21/01/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13469</b> IRCP US Equity

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2018	21/01/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13510</b> EDNAR 9 ¾ 10/25/22 Corp; <b>13509</b> BUENOS 7 78 06/15/27 Corp; <b>13490</b> BUENOS 4 05/15/35 Corp; <b>13489</b> ARGENT 2 12 12/31/38 Corp
28/05/2018	26/12/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13389</b> FISD11 (CNPJ 16.543.270/0001-89)
28/05/2018	26/12/2018	Futuro de Moedas	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13409</b> Futuro de CHF
28/05/2018	06/12/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>9255</b> FCFS US Equity
28/05/2018	04/12/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13309</b> STNE US Equity; <b>13349</b> SE US Equity
28/05/2018	04/12/2018	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13329</b> MSDIUSP7 Index
28/05/2018	04/12/2018	Cotas de Fundo Nacional	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13370</b> AQLL11 (CNPJ 13.555.918/0001-49); <b>13369</b> ARFI11B (CNPJ 14.069.202/0001-02).
28/05/2018	22/11/2018	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13289</b> GSIS150B Index.
28/05/2018	22/11/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13290</b> GSGLCEE LX Equity.
28/05/2018	14/11/2018	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13299</b> SPXT10UE Index.
28/05/2018	14/11/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13269</b> AMZN UW Equity; <b>13270</b> BABA UN Equity.
28/05/2018	14/11/2018	Ações Nacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: <b>13250</b> HAPV3 BZ Equity; <b>13251</b> POMO4 BZ Equity; <b>13252</b> MGLU3 BZ Equity; <b>13253</b> STBP3 BZ Equity.
28/05/2018	31/10/2018	Índices Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: <b>13211</b> CPURNSA Index; <b>13189</b> ENHABDAP Index; <b>13108</b> VGT US Equity; <b>13109</b> JNK US Equity
28/05/2018	31/10/2018	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: <b>13209</b> CRESY US Equity; <b>13210</b> CEPU US Equity; <b>13149</b> AGG US Equity; <b>13129</b> BNR GR Equity

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2018	31/10/2018	Registro de Fluxo de Datas de Verificação	Melhoria da descrição dos campos “Quantidade de Datas e Verificação Parte” e “Quantidade de Datas de Verificação Contraparte”.
28/05/2018	28/09/2018	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13107</b> BNPIOMA Index
28/05/2018	26/09/2018	Índices	Separação de tipos de Índices.
28/05/2018	26/09/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13088</b> ACBFF US Equity e <b>13067</b> LINU GR Equity
28/05/2018	26/09/2018	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/ Classe: <b>13047</b> SMLS3 BZ Equity.
28/05/2018	05/09/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13027</b> DIICELC LX Equity.
28/05/2018	05/09/2018	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>13007</b> BUENOS 10 7/8 01/26/21 REGS Corp; <b>12887</b> BUENOS 9 1/8 03/16/24.
28/05/2018	30/08/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12988</b> EFJPFU5E Index; <b>12987</b> EFJPFE5N Index
28/05/2018	28/08/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12969</b> MSUEGAH LX Equity; <b>12968</b> ALSFFCT LX Equity; <b>12967</b> MSGOPAH LX Equity.
28/05/2018	28/08/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12950</b> GLP UP Equity
28/05/2018	28/08/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>8166</b> SX7E Index; <b>12949</b> SOLWGOAL Index; <b>12948</b> BNPIECFT Index; <b>12947</b> BNPIAD5 Index; <b>12927</b> BNPICASE Index.
28/05/2018	10/08/2018	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12807</b> CMIGBZ 9 ¼ 12/05/24 (ISIN USP2205LAT28)
28/05/2018	10/08/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12867</b> NH2ADRC FP Equity; <b>12847</b> ABMGA2A LX Equity
28/05/2018	30/07/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12767</b> QQQ UQ Equity.
28/05/2018	30/07/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12787</b> MALLPLAZ CI Equity.

<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>
28/05/2018	30/07/2018	Registro de Contrato - Fluxo Não Constante	Exclusão das opções Índices e Índices de Preços na descrição do campo "Categoria".
28/05/2018	19/07/2018	Ativos	Inclusão dos Tipo/Classe: <b>12707</b> VOTORA 4 ¼ 06/17/24 CORP; <b>12647</b> RAILBZ 5 7/8 01/08/25 CORP – REGS
28/05/2018	19/07/2018	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classes: <b>12568</b> PX US Equity; <b>12667</b> CRM US Equity
28/05/2018	19/07/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12567</b> NDX Index
28/05/2018	19/07/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12727</b> MSGBRCA LX Equity
28/05/2018	02/07/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão dos Tipo/Classe: <b>12610</b> SCHGCAH LX Equity; <b>12609</b> OMEAEHA ID Equity; <b>12608</b> NORMABP LX Equity; <b>12607</b> MGOIAEA LN Equity; <b>12588</b> GAMSCOE ID Equity; <b>12587</b> BKRSPEA LX Equity; <b>12638</b> CSGRBHE LX Equity; <b>12637</b> JPGIAEA LX Equity; <b>12636</b> JPMECAA LX Equity; <b>12635</b> JUPLEUR LX Equity; <b>12634</b> LEODEUB LX Equity; <b>12633</b> MERGAAA LX Equity; <b>12632</b> NIMEHYB LX Equity; <b>12631</b> NOCEBPE LX Equity; <b>12630</b> PFSECPC LX Equity; <b>12629</b> SCIEHYA LX Equity; <b>12628</b> WAMOAHE ID Equity; <b>12627</b> XCRER1C LX Equity.
28/05/2018	06/06/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12447</b> GLOBAL X MSCI ARGENTINA ETF
28/05/2018	06/06/2018	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipo/Classe: <b>12507</b> BIDU US Equity; <b>12487</b> SCCO US Equity; <b>12467</b> BOX US Equity
28/05/2018	28/05/2018	Lançamentos – Antecipação de Contratos	Alteração no comportamento das antecipações de derivativos com Redutor do Risco de Crédito, conforme divulgado no COMUNICADO EXTERNO 006/2018-VPC, 008/2018-VPC, 005/2018 – VPC e 012/2017 – DN.
29/01/2018	08/05/2018	Registro de Contrato – Pagamento Final	Melhoria da descrição do campo "Valor Base"
29/01/2018	08/05/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12327</b> EZU US Equity



Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/01/2018	08/05/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12411</b> PAC US Equity; <b>12387</b> SPOT US Equity; <b>12347</b> SUPV US Equity
29/01/2018	08/05/2018	Moedas	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12367</b> Cólón costarriquenho Melhoria da Descrição de Critério de Cálculo de PU ou de Fator e inclusão de Informações Necessárias.
29/01/2018	08/05/2018	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12427</b> LIGTBZ 7 ¼ 05/03/23 Corp – REGS
29/01/2018	16/04/2018	Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo Não Constante	Melhoria da descrição do campo "Data Vencimento" e "Data Operação".
29/01/2018	14/03/2018	Taxa de Juros Nacionais	Melhoria do Critério de Cálculo de PU ou de Fator
29/01/2018	14/03/2018	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipo/Classe: <b>12207</b> 6758 JT Equity; <b>12208</b> BBVS SM Equity; <b>12267</b> SQM US Equity; <b>12307</b> LTM US Equity; <b>12187</b> FCFE18 MM Equity; <b>12167</b> CAAP US Equity; <b>12166</b> ARCO US Equity.
29/01/2018	14/03/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12228</b> TPX Index
29/01/2018	14/03/2018	Cotas de Fundos de Investimento	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12247</b> HEJSA2J LX Equity
29/01/2018	05/03/2018	Taxas de Juros Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12227</b> Fator IPCA – BNDES e melhoria das informações necessárias.
29/01/2018	20/02/2018	Taxas de Juros Nacionais	Melhoria das informações necessárias.
29/01/2018	08/02/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12085</b> VXX US Equity, <b>12126</b> SPECFR6P e <b>12127</b> SP5LVI.
29/01/2018	08/02/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12165</b> PAGS US Equity e <b>12105</b> SFTBY US Equity
29/01/2018	29/01/2018	Registro de Contrato - Pagamento Final	Melhoria nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/01/2018	29/01/2018	Registro de Contrato - Pagamento Final Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo Não Constante Alteração de Contrato - Pagamento Final Alteração de Contrato - Fluxo Constante Alteração de Contrato - Fluxo não Constante	Alteração de tela de registro, melhoria da descrição do campo PU inicial/ cupom limpo e inclusão do campo Data de Cotação Final – Termo, conforme o comunicado 008/2017 – DN.
11/09/2017	16/01/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12044</b> FCAU UN Equity
11/09/2017	08/01/2018	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12125</b> GSHPBR 10 08/10/26
11/09/2017	04/01/2018	Ações Internacionais	Correção da Curva VCP <b>12044</b> .
11/09/2017	03/01/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12084</b> GICSAB MM Equity
11/09/2017	27/12/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12064</b> MAUA CAPITAL P FIM CP IE
11/09/2017	27/12/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11985</b> FIOH12 MM Equity
11/09/2017	27/12/2017	Taxa de Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12024</b> LIBOR – FRANCO SUIÇO
11/09/2017	27/12/2017	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12004</b> ITUB3
11/09/2017	27/12/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>12047</b> TCEHY US Equity, <b>12044</b> FCAU UN Equity, <b>12045</b> JD US Equity e <b>12046</b> TTWO US Equity.
11/09/2017	19/12/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>10941</b> BRAZIL REALTY FII
11/09/2017	19/12/2017	Commodity	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11984</b> LOAHDY LME Comdty e <b>11964</b> FUTURO DE PRATA
11/09/2017	05/12/2017	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11963</b> CMIGBZ 9 ¼ 12/05/24 Corp
11/09/2017	05/12/2017	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11923</b> SUZB3 BZ Equity e <b>11943</b> SAPR11 BZ Equity
11/09/2017	27/11/2017	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11903</b> SAPR4 BZ Equity
11/09/2017	27/11/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11883</b> ATTO US Equity e Melhoria nas informações necessárias.
11/09/2017	27/11/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11743</b> PINEEHA ID Equity
11/09/2017	10/11/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11863</b> GLO LN Equity e <b>11843</b> LOMA US Equity
11/09/2017	01/11/2017	Ações Internacionais	Correção do nome do Tipo/Classe <b>11783</b> .
11/09/2017	25/10/2017	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11803</b> AZULSA 5 7/8 10/26/24 Corp - REGS
11/09/2017	25/10/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11783</b> CDB US Equity
11/09/2017	25/10/2017	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11804</b> ECH US Equity
11/09/2017	09/10/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11744</b> FUNO11 MM Equity
11/09/2017	09/10/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11763</b> NFLX US Equity

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
11/09/2017	09/10/2017	Antecipação de Contratos	Melhoria da visão geral da função e melhoria da descrição dos campos Fator para Antecipação (Ponta1) e (Ponta 2)
11/09/2017	06/10/2017	Registro Fluxo de Caixa Não Constante	Melhoria da descrição do campo "Taxa Juros"
11/09/2017	19/09/2017	Registro Fluxo de Caixa Não Constante	Melhoria da descrição do campo "Taxa Amortização"
11/09/2017	12/09/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11684</b> SNH GY Equity e <b>11685</b> SNH GR Equity
11/09/2017	11/09/2017	Características de Contrato de Swap	Inclusão dos campos "Sistema Origem" e "Código IF Sistema Origem".
29/05/2017	01/09/2017	Índices Ações Nacionais	Melhoria das Informações Necessárias.
29/05/2017	30/08/2017	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11642</b> ODPV3 BZ Equiy
29/05/2017	14/08/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11623</b> VISTAA MM Equity e <b>11622</b> TRICOT CI Equity

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/05/2017	10/08/2017	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11602</b> ECELUP 8 5/8 06/16/21 Corp. – REGS
29/05/2017	07/08/2017	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11582</b> CAC Index
29/05/2017	07/08/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11542</b> AMZN US Equity
29/05/2017	02/08/2017	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11562</b> EMB US Equity
29/05/2017	21/07/2017	Commodity	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11502</b> FUTURO DE CARVÃO e <b>11522</b> FUTURO DE JET FUEL
29/05/2017	12/07/2017	Títulos Públicos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11483</b> NTN – A
29/05/2017	12/07/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11482</b> SNAP US Equity
29/05/2017	12/07/2017	Títulos Públicos Nacionais	Inclusão de Informações Necessárias.
29/05/2017	07/07/2017	Contratos com limitador	Inclusão de Contratos com limitador
29/05/2017	07/07/2017	Registro de Contrato - Pagamento Final Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo Não Constante Registro Fluxo de Caixa Não Constante	Inclusão das observações nos campos de limitador superior e inferior
29/05/2017	07/07/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11462</b> BABA US Equity e <b>11442</b> LYV US Equity
29/05/2017	22/06/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11382</b> FIDC ESMERALDA SUB1 (CETIP 2473417SJR)
29/05/2017	14/06/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11343</b> CIG US Equity; <b>11342</b> AZUL US Equity; <b>11402</b> BBAJIOO MM Equity; <b>11422</b> ILC CI Equity.
29/05/2017	30/05/2017	Taxas de Juros Internacionais	Melhoria nas Informações necessárias das Taxas de Juros Internacionais.
29/05/2017	29/05/2017	Pagamento Final Contratos com funcionalidades Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 1 Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2	Inclusão da curva EURO WMR e Franco Suíço WMR conforme o comunicado 024/17.
23/01/2017	19/05/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11322 NTES US Equity
23/01/2017	03/05/2017	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11201</b> CSMG3
23/01/2017	03/05/2017	Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11262</b> FUTURO DE JUROS EURODOLAR (CME: ED)
23/01/2017	03/05/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11282</b> ALPEKA MM Equity; <b>11302</b> BSAC US Equity; <b>11061</b> PINFRA MM Equity; <b>11261</b> VESTA MM Equity
23/01/2017	04/04/2017	Moedas Taxas de Juros Internacionais Índices	Melhoria da descrição do campo : “Descrição das Informações Necessárias”
Versão	Atualização em	Referência	Atualização

23/01/2017	04/04/2017	Registro de Contrato - Pagamento Final	Melhoria da descrição dos campos: "Variação Cambial" e "Data de Cotação – Variação Cambial"
23/01/2017	04/04/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11241</b> GS US Equity
23/01/2017	04/04/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11221</b> FIDC ANGA SABEMI CO VI SN 1 (2409916SEN)
23/01/2017	14/03/2017	Commodity	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11181</b> Iron Ore Futures (SGX Asiaclear)
23/01/2017	14/03/2017	Registro de Contrato - Pagamento Final Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo Não Constante Registro Fluxo de Caixa Não Constante Cessão de Contrato Atualização de PU/Fator Curvas Disponíveis para VCP (Consulta de Tipo Classe)	Alteração dos dados em complemento ao COMUNICADO CETIP 016/2017
23/01/2017	09/03/2017	Futuro de Taxas de Juros Futuro de Moedas Futuro de Mercadorias Futuro de Ativos Ativos Commodity	Melhoria da descrição das informações necessárias da curvas VCPs.
23/01/2017	09/03/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11161</b> BTGINTB KY Equity
23/01/2017	09/03/2017	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11141</b> XRT US Equity
23/01/2017	06/03/2017	Registro de Contrato - Pagamento Final	Melhoria da descrição do campo "Data Cotação".
23/01/2017	03/03/2017	Moedas	Alteração na formatação da descrição das Informações Necessárias.
23/01/2017	02/03/2017	Moedas	Melhoria na descrição da descrição das Informações Necessárias.
23/01/2017	02/03/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11121</b> DLTR US Equity e <b>11101</b> QSR US Equity
23/01/2017	21/02/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11081</b> EDN US Equity
23/01/2017	10/02/2017	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11041</b> VIX INDEX
23/01/2017	10/02/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11023</b> TGS US Equity
23/01/2017	10/02/2017	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11001</b> BCOBMG 8 7/8 08/05/20 Corp e <b>11022</b> SAENER 7.4943 04/15/24
23/01/2017	31/01/2017	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>11021</b> DXY Curncy
23/01/2017	31/01/2017	Registro de Fluxo de Datas de Verificação Alteração de Fluxo de Data de Verificação	Alteração da descrição do campo "Data de Verificação".
23/01/2017	30/01/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>10981</b> SMU CI Equity
23/01/2017	24/01/2017	Sumário	Correção da formatação do sumário.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
23/01/2017	23/01/2017	Registro de Contrato - Pagamento Final Registro de Contrato – Fluxo Constante Registro de Contrato – Fluxo não Constante	Alteração no label do bloco. De: Se Índice Termo “VCP” ou “DOLAR” Para: Se Índice Termo. E o Campo PU Inicial/Cupom Limpo no caso de Swap à Termo só deve ser preenchido quando Índice Termo for VCP, DOLAR ou EURO.
28/08/2016	18/01/2016	Índices	Inclusão dos Tipo/Classes: 10961 EWA US Equity
28/08/2016	18/01/2016	Taxas de Juros Internacionais	Alteração das Informações Necessárias.
28/08/2016	28/12/2016	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Exclusão dos Tipo/Classe: <b>10699</b> BOI US Equity e <b>10696</b> HTR US Equity
28/08/2016	27/12/2016	Registro de Contrato - Pagamento Final	Alteração da descrição do campo “Data Operação” e “Data Vencimento”.
28/08/2016	26/12/2016	Procedimentos Especiais para Liquidação Financeira	Exclusão da seção “Procedimentos Especiais para Liquidação Financeira”.
28/08/2016	26/12/2016	Conhecendo o Produto	Alteração na Observação do Swap com Agenda de Redutor de Risco Crédito.
28/08/2016	12/12/2016	Cotas de Fundos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>10901</b> RA US Equity
28/08/2016	06/12/2016	Moedas	Inclusão do Tipo/Classe: <b>10876</b> Dólar de Singapura - SGD
28/08/2016	06/12/2016	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>10898</b> Futuro Mini Russell 2000 e <b>10896</b> IRF-M
28/08/2016	28/11/2016	Taxas de Juros Internacionais	Complementar as informações necessárias sobre limitadores na descrição de curva VCP de taxas de juros internacionais.
28/08/2016	17/11/2016	Ativos 228	Inclusão do Tipo/Classe: <b>10813</b> BANBRA 6 1/4 10/29/49 Corp - REGS BANCO BRASIL CAYMAN (ISIN USG07402DP58)
28/08/2016	17/11/2016	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>10857</b> AIG US Equity AMERICAN INTERNATIONAL GROUP
28/08/2016	17/11/2016	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>10856</b> BRZU US Equity
28/08/2016	17/11/2016	Taxas de juros internacionais Índices Ações Internacionais Cotas de Fundos Nacionais	Alteração na descrição de curvas VCP.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/08/2016	08/11/2016	Taxas de Juros Internacionais Índices Ações Internacionais	Alteração na descrição de curvas VCP.
28/08/2016	31/10/2016	Registro de Contrato - Pagamento Final Registro de Contrato - Fluxo Não Constante Contratos com Funcionalidades Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2	Alterar a notação do cálculo da curva EURO/COM.EUROPEIA.
28/08/2016	27/10/2016	Atualizações da Versão Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2	Adequação da notação do cálculo das curvas EURO-BCE e FRANCO SUIÇO BCE.
29/08/2016	26/10/2016	Atualizações da Versão Registro de Contrato - Fluxo Constante Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2	Adequação da notação do cálculo das curvas EURO-BCE e FRANCO SUIÇO BCE.
29/08/2016	24/10/2016	Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo Não Constante Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2	Adequação da notação do cálculo das curvas EURO-BCE e FRANCO SUIÇO BCE.
29/08/2016	24/10/2016	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: <b>10793</b> PZE US Equity
29/08/2016	19/10/2016	Índices	Alteração na formatação necessária
29/08/2016	18/10/2016	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 10493 IVV US Equity
29/08/2016	18/10/2016	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 10637 RYA ID Equity
29/08/2016	10/10/2016	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: <b>10733</b> BNPI8DUF Index
29/08/2016	07/10/2016	Alteração de Contrato - Pagamento Final Alteração de Contrato - Fluxo Constante Alteração de Contrato - Fluxo não Constante	Retirada do trecho "Swap a Termo".
29/08/2016	21/09/2016	Índices	Alteração dos locais dos seguintes Tipo/Classe: <b>10753</b> VIXY US Equity e <b>10733</b> IWM US Equity
29/08/2016	15/09/2016	Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10734</b> WPPGY US Equity e <b>10756</b> COTY US Equity

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/08/2016	15/09/2016	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10757</b> CIF US Equity, <b>10755</b> EAD US Equity e <b>10754</b> VGI US Equity
29/08/2016	15/09/2016	Índices	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10753</b> VIXY US Equity e <b>10733</b> IWM US Equity
29/08/2016	13/09/2016	Histórico de Parâmetros Para Disparo de Reset	Correção do Menu.
29/08/2016	08/09/2016	Taxas de Juros Internacionais	Alteração nas informações adicionais do grupo "Taxa de Juros Internacionais" das curvas VCP.
29/08/2016	01/09/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10694</b> GOLLBZ 9 1/2 07/20/21 Corp.
29/08/2016	01/09/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10698</b> DSL US Equity, <b>10699</b> BOI US Equity, <b>10697</b> PCI US Equity e <b>10696</b> HTR US Equity.
29/08/2016	01/09/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10614</b> CMCSA US EQUITY, <b>10714</b> AGRO US Equity, <b>10713</b> FB US Equity e <b>10695</b> NG US Equity.
29/08/2016	01/09/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Taxa de juros Internacional	Alteração no texto informação necessária.
29/08/2016	29/08/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Alterações no texto informação necessárias.
29/08/2016	29/08/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10693</b> JPXN US Equity.
29/08/2016	29/08/2016	Futuro de Mercadorias	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10636</b> FUTURO DE RUBBER.
29/08/2016	29/08/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10634</b> VALEBZ 8 ¼ 01/17/34 Corp e <b>10653</b> BRASKM 7 1/8 07/22/41 Corp
29/08/2016	29/08/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10633</b> TAP US Equity, <b>10638</b> BHP US Equity e <b>10673</b> CHTR US EQUITY
29/08/2016	29/08/2016	Alteração de Contrato - Pagamento Final Alteração de Contrato – Fluxo Constante Alteração de Contrato – Fluxo Não Constante	Inclusão da informação referente à Swap a Termo.
25/01/2016	19/07/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10615</b> MSFT US Equity.
25/01/2016	19/07/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10616</b> EMBRBZ 5.05 06/15/25 Corp e <b>10617</b> BANBRA 5 7/8 01/19/23 Corp.



Versão	Atualização em	Referência	Atualização
25/01/2016	12/07/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10595</b> UKX INDEX
25/01/2016	12/07/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10596</b> SPGB 1.95 04/30/26 Corp e <b>10613</b> PETBRA 8 3/8 05/23/21 Corp.
25/01/2016	07/07/2016	Registro de Contrato - Fluxo Constante e Não Constante.	Inclusão na observação da Visão Geral das curvas TJMI e Libor.
25/01/2016	28/06/2016	Registro Fluxo de Caixa Não Constante	Melhoria no texto da observação 2).
25/01/2016	23/06/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10359</b> USO US Equity.
25/01/2016	23/06/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10582</b> ETB US EQUITY.
25/01/2016	23/06/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10583</b> ALTICE 8 1/8 01/15/24 Corp, <b>10584</b> FTR 10 ½ 09/15/22 Corp , <b>10593</b> USIM 7 1/4 01/18/18 Corp e <b>10594</b> ELEBRA 6 7/8 07/30/19 Corp.
25/01/2016	22/06/2016	Informações Adicionais	Inclusão do item; Formação dos Códigos do Instrumento Financeiro Swap.
25/01/2016	13/06/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10581</b> ETW US EQUITY.
25/01/2016	13/06/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10580</b> EWT US Equity.
25/01/2016	13/06/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10579</b> PETBRA 6.85 06/05/15 Corp.
25/01/2016	09/06/2016	Registro de Contrato - Pagamento Final Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo Não Constante Alteração de Contrato - Pagamento Final	Alteração na descrição do campo "Denominação".
25/01/2016	07/06/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10577</b> LQD US Equity
25/01/2016	07/06/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10574</b> Fut. de Título do Tesouro do Reino Unido, <b>10575</b> Futuro de Título do Tesouro Italiano e <b>10576</b> Futuro de Título do Tesouro Francês.
25/01/2016	07/06/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10573</b> VOTORA 7 1/4 04/05/41 Corp e <b>10578</b> PETBRA 8 ¾ 05/23/26 Corp.
25/01/2016	30/05/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10553</b> SCHA NO Equity.
25/01/2016	23/05/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Taxa de Juros Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10535</b> UMSELIC 143 e alteração na descrição das colunas "Critério de Cálculo de PU ou de Fator e Informações Necessárias".
25/01/2016	23/05/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10537</b> BEEFBZ 7 ¾ 01/31/23 Corp, <b>10536</b> BBDBCN 7 ¾ 03/15/20 Corp, <b>10533</b> GOLLBZ 9 1/4 07/20/20 Corp.
25/01/2016	05/05/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10513</b> TRUP US Equity
Versão	Atualização em	Referência	Atualização

25/01/2016	05/05/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ações nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10514</b> TUPY3 BZ Equity.
25/01/2016	02/05/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Retirada do Tipo/Classe <b>6238</b> , por motivo de bloqueio.
25/01/2016	28/04/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Exclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10358</b> HYPEBZ 6 1/2 04/20/21 Corp
25/01/2016	25/04/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10475</b> VALEBZ 6 7/8 11/21/36 Corp , <b>10476</b> GGBRBZ 4 3/4 04/15/23 Corp , <b>10477</b> SAMMIN 5 3/8 09/26/24 Corp e <b>10478</b> GGBRBZ 7 ¼ 04/16/44 Corp.
25/01/2016	19/04/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10473</b> GLD UP Equity.
25/01/2016	19/04/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10474</b> BANSAF 6 3/4 01/27/21 Corp.
25/01/2016	13/04/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10454</b> BNPID8UA Index e <b>10455</b> FAZ US Equity.
25/01/2016	13/04/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10453</b> ITCB US Equity .
25/01/2016	29/03/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10413</b> SLED4 BZ Equity.
25/01/2016	21/03/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10393</b> BRADES 6 3/4 09/29/19 Corp e <b>10394</b> BRASKM 5 3/4 04/15/21 Corp.
25/01/2016	14/03/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10382</b> GOOGL US Equity.
25/01/2016	11/03/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10380</b> AAA NA EQUITY.
25/01/2016	11/03/2016	Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10381</b> DBK GY Equity.
25/01/2016	09/03/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10379</b> BRASKM 7 3/8 10/29/49 Corp
25/01/2016	08/03/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10377</b> TAEEBZ Float 10/15/17 Corp e <b>10378</b> CAIXBR 7 1/4 07/23/24 Corp.
25/01/2016	02/03/2016	Conhecendo o Produto (Swap com Agenda de Redutor de Risco Crédito)	Inclusão da observação 1).
25/01/2016	02/03/2016	Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10375</b> UVE US Equity.
25/01/2016	02/03/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10376</b> SBSPBZ 6 1/4 12/16/20 Corp, <b>10374</b> EMBRBZ 6 3/8 01/24/17 Corp e <b>10373</b> BRAZIL 4 1/4 01/07/25 Corp.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
25/01/2016	18/02/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Taxa de Juros Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10360</b> FEDSOPEN.
25/01/2016	12/02/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10332</b> BCOPAN 8 ½ 04/23/20 Corp - REGS, <b>10353</b> BNDES 6.369 06/16/18 Corp , <b>10354</b> CAIXBR 4 ¼ 05/13/19 Corp e <b>10358</b> HYPEBZ 6 1/2 04/20/21 Corp.
25/01/2016	12/02/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ações nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10352</b> RUMO3 BZ Equity,
25/01/2016	12/02/2016	Registro de Contrato - Pagamento Final Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo Não Constante	Atualização da descrição do campo "Percentual".
25/01/2016	03/02/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5135</b> FX FIM CP - INVESTIMENTO NO EXTERIOR (CNPJ: 07.096.479/0001-50)
25/01/2016	03/02/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10355</b> ITAU 2.85 05/26/18 Corp - REGS.
25/01/2016	25/01/2016	Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo não Constante Alteração de Contrato - Pagamento Final Alteração de Contrato - Fluxo Constante Alteração de Contrato - Fluxo não Constante	Melhoria na descrição do texto do campo "Amortiza Sem troca de diferencial".
25/01/2016	25/01/2016	Antecipação de Contratos	Disponibilização para Operações de Antecipação em datas de eventos com amortização e decorrida em Datas de Eventos, conforme comunicado 132/15.
21/09/2015	08/01/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10312</b> VALEBZ 4 3/8 01/11/22 Corp.
21/09/2015	07/01/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10292</b> USO UP Equity.
21/09/2015	07/01/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10252</b> ITAU 5.65 03/19/22 Corp.
21/09/2015	06/01/2016	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Exclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10070</b> OO2FIM BZ EQUITY.
21/09/2015	30/12/2015	Moedas	Inclusão do subitem b) ao item 1.
21/09/2015	17/12/2015	Índices	Exclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5016</b> MOBI11.
21/09/2015	15/12/2015	Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10251</b> ITUB US Equity.
21/09/2015	25/11/2015	Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10211</b> ATVI US Equity e <b>10247</b> ELP US Equity.
21/09/2015	25/11/2015	Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10191</b> XLE US Equity.
21/09/2015	25/11/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10190</b> ADT 4 7/8 07/15/42 Corp.
21/09/2015	23/11/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10192</b> JEFFIN 7 3/8 04/01/20 Corp - 144ªe <b>10193</b> FMEGR 5 5/8 07/31/19 Corp - 144ª.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
21/09/2015	18/11/2015	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Alteração na descrição do texto no campo "Informações Necessárias".
21/09/2015	11/11/2015	Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10170</b> VOLARA MM EQUITY.
21/09/2015	09/11/2015	Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10150</b> SAMMIN 4 1/8 11/01/22 Corp – REGS e exclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5018</b> CSMO11.
21/09/2015	05/11/2015	Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10130</b> AAXJ UP Equity.
21/09/2015	05/11/2015	Contratos com Funcionalidades Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 1 Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2	Inclusão da observação: "FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]"
21/09/2015	05/11/2015	Registro de Contrato - Pagamento Final Registro de Contrato - Fluxo Constante	Inclusão do texto "FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]" nos campos: Índice Termo, Sinal +/-, Curva e +/-.
21/09/2015	29/10/2015	Índices	Melhoria no texto do campo "Informações Necessárias" entre os índices VCP <b>1018 - 5013</b> .
21/09/2015	22/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 10110 ELEBRA 5 3/4 10/27/21 Corp – REGS.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
21/09/2015	21/10/2015	Taxas de Juros Nacionais	Inclusão do item “a) Caso o fixing seja diferente do vencimento, informa-lo no campo “Denominação” (D-1,...,D-5)” no campo de informações necessárias.
21/09/2015	21/09/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>10090</b> BCOBMG 9.95 11/05/19 Corp e <b>10091</b> CSNABZ 6 7/8 09/21/19 Corp.
21/09/2015	13/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10070</b> OO2FIM BZ EQUITY.
21/09/2015	08/10/2015	Ações Internacionais	Inclusão do texto “Obs.:
21/09/2015	08/10/2015	Índices	Alteração no texto do campo “Informações necessárias” iniciadas no Tipo/Classe <b>5029</b> e <b>5019</b> .
21/09/2015	08/10/2015	Registro de Contrato - Pagamento Final (Terceira Curva)	Exclusão do índice IPCA no campo “Cupom Limpo”.
21/09/2015	05/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10051</b> PETBRA 4 7/8 03/17/20 Corp.
21/09/2015	05/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>2555</b> CFF 1204310F63 <b>10010</b> DOMC11 BZ EQUITY <b>10011</b> BTGPALP BZ EQUITY <b>10030</b> LSTGLB BZ Equity e <b>10031</b> KAPKFFF BZ EQUITY.
21/09/2015	05/10/2015	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Disponibilização da nova curva VCP.
21/09/2015	02/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>9990</b> PE&OLES* MM EQUITY, <b>9991</b> TSN US EQUITY, <b>9992</b> PPC US EQUITY, <b>9993</b> NEM US EQUITY e <b>9994</b> BVN US EQUITY.
21/09/2015	02/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>10050</b> MINI FUTURO DE OURO
21/09/2015	21/09/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>2556</b> ABCBBZ 7 7/8 04/08/20 Corp – REGS.
21/09/2015	21/09/2015	Atualização de PU/Fator	Disponibilização da opção Contrato a Termo no campo “Tipo de Atualização”.
21/09/2015	21/09/2015	Atualização de PU/Fator	Inclusão do campo “Valor Financeiro” na Tela de Confirmação.
21/09/2015	21/09/2015	Registro de Contrato - Pagamento Final (Terceira Curva)	Permissão do preenchimento do campo “Cupom Limpo” se informado curva IPCA, para que o sistema possa realizar o cálculo.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
21/09/2015	21/09/2015	Registro de Contrato - Pagamento Final (Cupom Limpo/ Data de Cotação)	O campo "Data de Cotação" não deve ser preenchido se curva escolhida for IPCA.
25/08/2014	16/09/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>2535</b> DAYCOV 5 ¼ 03/19/19 Corp – REGS e <b>2555</b> PETBRA 5 ¾ 01/27/21 Corp
25/08/2014	16/09/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>2535</b> DAYCOV 5 ¼ 03/19/19 Corp - REGS
25/08/2014	11/09/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>2515</b> CNV US EQUITY
25/08/2014	11/09/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>2495</b> INCMBZ 5 3/4 07/17/24 Corp – REGS
25/08/2014	08/09/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>2476</b> NVS US Equity.
25/08/2014	03/09/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>2456</b> BANBRA 8 1/2 10/29/49 Corp – REGS.
25/08/2014	02/09/2015	Índices	Inclusão do subitem "a) Caso o "Percentual" informado seja sobre a variação diária, favor informar "percentual diário" exclusivamente no campo "Denominação" no item 4.
25/08/2014	27/08/2015	Registro de Contrato - Pagamento Final Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo Não Constante Alteração de Contrato - Fluxo Constante Alteração de Fluxo de Caixa Não Constante	Inclusão do texto: Dentre as opções disponíveis, a que for selecionada também será considerada para o cálculo da cotação da moeda atrelada à mercadoria, no campo "Data de Cotação para Ajustes."
25/08/2014	26/08/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Alteração do texto no campo "Informações Necessárias".
25/08/2014	26/08/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9989</b> BRSRBZ 7 3/8 02/02/22 Corp - REGS
25/08/2014	13/08/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Exclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5135</b> FX FIM CP e <b>7161</b> DOMO.
25/08/2014	12/08/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5135</b> FX FIM CP e <b>7161</b> DOMO.
25/08/2014	07/08/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>9928</b> AAPL UQ Equity, <b>9929</b> AAPL UW Equity e <b>9948</b> OMAB MM EQUITY.
25/08/2014	07/08/2015	Cotas de Fundos de Investimentos	Exclusão do tópico, devido a bloqueio dos ativos Tipo/Classe: <b>5099, 5817, 7161, 7021, 7181, 9607, 5168, 5135, 7583, 6921, 5652, 8927, 5898, 7845, 5899, 7844, 5901, 8046, 8045, 5903, 5905, 5907, 7843 e 5897.</b>
25/08/2014	03/08/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9908</b> CAIXBR 2 3/8 11/06/17 Corp
25/08/2014	30/07/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9888</b> SJNK US EQUITY
25/08/2014	20/07/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9868</b> ASHR US Equity
25/08/2014	13/07/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9849</b> ML FP Equity
25/08/2014	13/07/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>9848</b> INTEL 7 ¼ 04/01/19 Corp e <b>9850</b> DVA 5 1/8 07/15/24 Corp
Versão	Atualização em	Referência	Atualização

25/08/2014	13/07/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>9828</b> INDA UP Equity e <b>9830</b> ISF LN Equity.
25/08/2014	07/07/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9809</b> EMBRBZ 5.15 06/15/22 Corp, <b>9810</b> PETBRA 7 7/8 03/15/19 Corp e <b>9811</b> BANBRA 5 7/8 01/26/22 Corp - REGS
25/08/2014	07/07/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9812</b> KHC US Equity
25/08/2014	03/07/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9792</b> LILA US Equity.
25/08/2014	02/07/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>9789</b> MDLZ US EQUITY e <b>9791</b> BAM US Equity.
25/08/2014	02/07/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9790</b> ITAU 5 1/2 08/06/22 – REGS
25/08/2014	24/06/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9768 CIELBZ 3 3/4 11/16/22 Corp - REGS
25/08/2014	17/06/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipos/Classes: <b>9747</b> INRETC1 PE EQUITY <b>9731</b> SUNE US Equity, <b>9730</b> SNY US Equity, <b>9729</b> PFE US Equity, <b>9728</b> CNA US Equity e <b>9727</b> ANTM US Equity.
25/08/2014	17/06/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9732 <b>BCOBMG 8 04/15/18 CORP.</b>
25/08/2014	11/06/2015	Cruzamento de Funcionalidades x Curva para Atualização – Tabela 2	Atualização na linha do <b>EURO-BCE.</b>
25/08/2014	29/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9667</b> ACWI US Equity
25/08/2014	28/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Mudança das curvas 9518, 9541 e 9589 para a lista de ETF.
25/08/2014	28/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9647</b> BRFSBZ 3.95 05/22/23 Corp - REGS
25/08/2014	27/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimento	Reabilitação de Tipo/Classe – <b>7181</b> FII Esmeralda.
25/08/2014	25/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Exclusão do tipo classe <b>8005</b> por motivo de bloqueio.
25/08/2014	25/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9627</b> UNIFINA MM Equity
25/08/2014	25/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimento	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9607</b> FIM CP CORAGEM – IE
25/08/2014	21/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9589</b> IYT US EQUITY
25/08/2014	21/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9588</b> EQTL3 BZ EQUITY
25/08/2014	21/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9587</b> GGBRBZ 5 3/4 01/30/21 Corp - REGS
25/08/2014	19/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão dos seguintes Tipos/Classes: <b>9518</b> MCHI US Equity, <b>9539</b> VGK UP Equity, <b>9540</b> SPY UP Equity e <b>9541</b> EWJ UP Equity
25/08/2014	19/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9559</b> CLNX SM Equity, <b>9582</b> VITROA MM Equity e <b>9584</b> TWC US Equity
25/08/2014	19/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipos/Classes: <b>9560</b> PETBRA 8 3/8 12/10/18 Corp, <b>9578</b> CSANBZ 8 1/4 11/29/49 Corp, <b>9579</b> BRMLBZ 8 1/2 01/29/49 Corp – REGS, <b>9583</b> TUPY 6 5/8 07/17/24 Corp, <b>9585</b> ITAU 5 ¾ 01/22/21 Corp e <b>9586</b> BRADES 5.9 01/16/21 Corp.
<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>

25/08/2014	18/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Atualização nas Informações Necessárias.
25/08/2014	12/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9581</b> SUZANO 5 7/8 01/23/21 Corp - REGS
25/08/2014	12/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9580</b> HYG US EQUITY.
25/08/2014	11/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Em Informações Necessárias, melhoria no texto do item 8.
25/08/2014	06/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9558</b> SEE 4 7/8 12/01/22 Corp - REGS
25/08/2014	05/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9543</b> STZ 4 1/4 05/01/23 Corp
25/08/2014	05/05/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9542</b> BACHOCOB MM Equity
25/08/2014	30/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9538</b> NLSN 5 04/15/22 Corp – REGS.
25/08/2014	30/04/2015	EURO/COM.EUROPEIA e EURO-BCE	Significado das curvas de Euro.
25/08/2014	29/04/2015	Registro Contrato com Curva VCP	Atualização da tabela referente a coluna “Preenchimento Denominação Contraparte”.
25/08/2014	27/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9498</b> LBRDA US Equity.
25/08/2014	24/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9478</b> QQQ US Equity
25/08/2014	24/04/2015	Nas Tabelas das Curvas para Atualização.	De: <b>Euro</b> Para: <b>EURO/COM.EUROPEIA.</b>
25/08/2014	24/04/2015	Registro de Contrato - Pagamento Final; Registro de Contrato - Fluxo Constante; e Registro de Contrato - Fluxo Não Constante.	No campo “Índice Termo” De: <b>Euro</b> Para: <b>EURO/COM.EUROPEIA.</b>
25/08/2014	23/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipos/Classes: <b>9458</b> DBRI 1 3-4 04 15 20 Corp e <b>9459</b> DBRI 0.1 04 15 23 Corp.



Versão	Atualização em	Referência	Atualização
25/08/2014	23/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9438</b> The FTSE/JSE Top 40 Index Future.
25/08/2014	23/04/2015	Contratos com Funcionalidades	Em Swap com Knock In, Knock Out ou Knock In-Out Forma de Verificação de Disparo Discreto, mudança De: Euro Para: <b>EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE.</b>
25/08/2014	23/04/2015	Registro de Contrato - Pagamento Final	Na Terceira Curva nos campos “Curva” e “+ / -”, mudança De: Euro Para: <b>EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE.</b>
25/08/2014	22/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>9417</b> POST US Equity, <b>9418</b> DHR US Equity, <b>9419</b> DFE US Equity e <b>9437</b> IBA US Equity.
25/08/2014	15/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9420</b> DVA 5 05/01/25 Corp
25/08/2014	09/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9396</b> STQ FP EQUITY
25/08/2014	09/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9395</b> The SGX Nifty Index Future
25/08/2014	07/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Exclusão do tipo classe <b>8846</b> por motivo de bloqueio.
25/08/2014	02/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9375</b> DUFSCA 5 1/2 10/15/20 Corp - REGS
25/08/2014	02/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9355</b> KRFT US EQUITY
25/08/2014	31/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9335</b> SHOW3 BZ EQUITY.
25/08/2014	26/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Exclusão do Tipo/Classe: <b>8606</b> por motivo de bloqueio.
25/08/2014	25/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9315</b> SX5EEX GY EQUITY
25/08/2014	25/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9316</b> PCLN US Equity
25/08/2014	23/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>9275</b> VGK US Equity, <b>9276</b> FJP US Equity e <b>9277</b> DAX Index.
25/08/2014	23/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>9235</b> STX US Equity, <b>9255</b> FCFS US Equity, <b>9278</b> ANN GY Equity, <b>9279</b> P1Z GY Equity, <b>9295</b> DWNI GY Equity, <b>9296</b> LEG GY Equity, <b>9297</b> TEG GY Equity e <b>9298</b> GFJ GY Equity.
25/08/2014	16/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9233</b> Rand
25/08/2014	16/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas de Juros Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9232</b> JIBA3M Index.
25/08/2014	13/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimento	Desabilitação do tipo classe <b>5902</b> - MAUA ORION FIQ FIM.
Versão	Atualização em	Referência	Atualização

25/08/2014	13/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9213</b> AAXJ UQ Equity
25/08/2014	12/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	No primeiro grupo de Índices em Informações Necessárias, inclusão do item 8.
25/08/2014	10/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9212</b> QSRCN 6 04/01/22 Corp - 144A
25/08/2014	06/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9211</b> USFOOD 8 1/2 06/30/19 Corp
25/08/2014	06/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9210</b> BCA US EQUITY.
25/08/2014	02/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9208</b> ANIM3 BZ Equity.
25/08/2014	27/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do item 8 referente a Tratamento de Proventos em Informações Necessárias.
25/08/2014	23/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira)	Alinhar descritivo do termo "spot" na informação necessária nº 2.
25/08/2014	23/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Alinhar descritivo do termo "spot" na informação necessária nº 2.
25/08/2014	23/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Alinhar descritivo do termo "spot" na informação necessária nº 2.
25/08/2014	23/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Alinhar descritivo do termo "spot" na informação necessária nº 4, para o Tipo/Classe: 5094.
25/08/2014	19/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9187</b> CME US Equity
25/08/2014	19/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Foi incluído novamente o Tipo/Classe <b>6238</b> .
25/08/2014	13/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9168</b> TPX US Equity
25/08/2014	13/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas de Juros Nacionais	Em Informações Necessárias, inclusão do item 3.
25/08/2014	12/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Retirada do Tipo/Classe <b>6238</b> , por motivo de bloqueio.
25/08/2014	11/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9149</b> CITHOL 10 ¾ 02/15/20 CORP - 144A
25/08/2014	11/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas de Juros Nacionais	Melhoria nos textos: Critério de Cálculo de PU ou de Fator e Informações Necessárias, para atender a demanda de mercado e tornar as curvas mais flexíveis.
25/08/2014	10/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9148</b> DLTR 5 ¾ 03/01/23 CORP – REGS
25/08/2014	02/02/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Cotas de Fundos de Investimentos	Exclusão do Tipo/Classe 5906, devido ao bloqueio em produção.
25/08/2014	30/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9127</b> FRES LN Equity
25/08/2014	27/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9087</b> VRSN US Equity
<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>

25/08/2014	27/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9067</b> ECL CI Equity
25/08/2014	21/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9047</b> PBR/A US Equity
25/08/2014	15/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8247</b> AGUAS/A CI Equity e <b>9027</b> SID US Equity.
25/08/2014	12/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>9007</b> GPC US Equity
25/08/2014	12/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas de Juros Nacionais	Em Informações Necessárias, inclusão do subitem ao item 5.a.
25/08/2014	09/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8987</b> COLBUN CI Equity.
25/08/2014	08/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8967</b> BSAN CI Equity e <b>8968</b> SMCHILEB CI Equity
25/08/2014	05/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Alteração do nome da curva e da descrição do Código 5156. <b>De:</b> Curva VCP: FUTURO DE IRON e Descrição da Curva VCP: FUTURO DE IRON <b>Para:</b> Curva VCP: FUTURO DE IRON ORE e Descrição da Curva VCP: FUTURO DE IRON ORE – MINÉRIO DE FERRO
25/08/2014	02/01/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Commodity	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8947</b> OTC Iron Ore Swap (SGX Asiaclear)
25/08/2014	31/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8927</b> LESTE GLOBAL FIC FIM – INV NO EXT.
25/08/2014	22/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8906</b> VRX US Equity
25/08/2014	22/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Alteração do texto do item 1 em Informações Necessárias.
25/08/2014	19/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8888</b> KO US Equity
25/08/2014	19/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8886</b> TDG 5 1/2 10/15/20 Corp e <b>8887</b> VRXCN 6 3/4 08/15/21 Corp (REGS).
25/08/2014	18/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão da letra “a” dentro item “1” em Informações Necessárias.
25/08/2014	17/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8866</b> BTGINTH KY Equity
25/08/2014	11/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8846</b> DLM 7 5/8 02/15/19 Corp - REGS
25/08/2014	11/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8828</b> RLOG3 BZ Equity
25/08/2014	09/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Taxas	Divisão do grupo Taxas em Taxas de Juros Nacionais e Taxas de Juros Internacionais.
25/08/2014	09/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Desabilitação do Tipo Classe <b>5900</b> MAUA FIX FIQ FIM em 03/12/2014.
25/08/2014	08/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8826</b> GGBR3 BZ Equity
<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>

25/08/2014	08/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Alteração da descrição da curva VCP código 8246.
25/08/2014	03/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8806</b> EWY US Equity
25/08/2014	01/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do item 7, na parte referente à curva 1018.
25/08/2014	01/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8766</b> IFS PE Equity e <b>8787</b> ESRX US Equity.
25/08/2014	27/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Mudança no nome e na descrição do Tipo/Classe <b>5200</b> .
25/08/2014	27/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Taxas	Em informações necessárias, inclusão do item 6.
25/08/2014	24/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Retirada do seguinte Tipo/Classe: <b>7121</b> - TSIP1062 Index, por motivo de bloqueio.
25/08/2014	24/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8726</b> MEXBOL Index.
25/08/2014	24/11/2014	Diversas funções	Alteração de tela (layout, forma e cor).
25/08/2014	18/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Mudança do nome da curva 8707 para T 2 ¾ 08/15/24 Govt.
25/08/2014	18/11/2014	Diversas funções	Alteração de tela (layout, forma e cor).
25/08/2014	12/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8708</b> BRK/A US Equity e <b>8709</b> ZTS US Equity.
25/08/2014	12/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8706</b> FRTR 1 ¼ 11/25/24 Corp e <b>8707</b> T 2 &#8540; 08/15/24 Govt.
25/08/2014	07/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8686</b> XLF US Equity.
25/08/2014	04/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8666</b> BSBR US Equity.
25/08/2014	30/10/2014	Atualizações da Versão	Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais nova para a mais antiga.
25/08/2014	30/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8646</b> ABRE3 BZ Equity.
25/08/2014	30/10/2014	Registro de Contrato com Pagamento Final; Registro de Contrato de Fluxo Constante e Registro de Contrato Fluxo Não Constante.	No campo Índice Termo, inclusão do código indexador <b>78</b> (FRANCO SUIÇO BCE).
25/08/2014	29/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8626</b> GAPB MM Equity, <b>8627</b> AMXL MM Equity, <b>8628</b> GMEXICOB MM Equity e <b>8629</b> PREC CB Equity.
25/08/2014	27/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadoria	Em informações necessárias, item 2 adicionar (exceto quando se tratar de um primeiro futuro), Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8586</b> FUTURO DE HEATING OIL.
25/08/2014	27/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8566</b> JEFFIN 7 1/2 04/15/21 Corp - 144A e <b>8606</b> DLM 7 5/8 02/15/19 Corp
25/08/2014	22/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8526</b> INTEL 8 1/8 06/01/23 Corp.
Versão	Atualização em	Referência	Atualização

25/08/2014	22/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8547</b> TERRA13 MM Equity.
25/08/2014	16/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Mudança na Descrição da Curva VCP <b>8406</b> . Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 8486 CCI 4 7/8 04/15/22 Corp, 8487 SBAC 5 5/8 10/01/19 Corp e 8488 CLF 3.95 01/15/18 Corp.
25/08/2014	13/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8448</b> PSH NA Equity
25/08/2014	10/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8426</b> BANBRA 9 06/29/49 Corp - REGS
25/08/2014	10/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8446</b> INAPACI LX Equity
25/08/2014	10/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8447</b> CBB 8 3/8 10/15/20 Corp
25/08/2014	07/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão da informação na descrição da curva de código 8347.
25/08/2014	07/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8386</b> RIG US Equity
25/08/2014	07/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8406</b> VRXCN 7 ½ 07/15/21 Corp (REGS) e <b>8407</b> VRXCN 7 ½ 07/15/21 Corp (144A).
25/08/2014	29/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8347</b> BKW 6 04/01/22 Corp – REGS e <b>8366</b> BKW 6 04/01/22 Corp – 144A
25/08/2014	29/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8367</b> ADM LN Equity.
25/08/2014	26/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP	Exclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5098, 5106, 5904, 7181, 7663 e 7883</b> .
25/08/2014	26/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8311</b> LBTYA US Equity
25/08/2014	26/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8326</b> AUTGIL 8 ¼ 05/24/21 Corp - REGS
25/08/2014	26/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8346</b> RIAL
25/08/2014	19/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8307</b> FIBRAMQ MM Equity
25/08/2014	19/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8308</b> DBPHLD 7 ¾ 10/15/20 Corp – REGS, <b>8309</b> DBPHLD 7 ¾ 10/15/20 Corp – 144A e <b>8310</b> AUTGIL 6 ¾ 01/15/23 Corp – REGS.
25/08/2014	16/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8087</b> GYI 7 10/15/20 Corp, <b>8088</b> NOKIA 5 3/8 05/15/19 Corp e <b>8286</b> GYI 7 10/15/20 Corp – REGS.
25/08/2014	16/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8246</b> STZ FP Equity
Versão	Atualização em	Referência	Atualização

25/08/2014	16/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8266 BCH US Equity</b>
25/08/2014	05/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8206 FXH US Equity</b> e <b>8229 CLICP Index</b> .
25/08/2014	05/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8226 Florim</b> e <b>8227 Zloty</b> .
25/08/2014	05/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8228 COOVIBR Index</b> .
25/08/2014	05/09/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8230 GPIXLX 10 01/29/49 Corp</b> .
25/08/2014	03/09/2014	Todo o manual.	Nas descrições dos campos, inclusão da informação se o preenchimento é obrigatório ou não.
25/08/2014	29/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8167 XLK US EQUITY</b>
25/08/2014	29/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8186 STS FP Equity</b>
25/08/2014	28/08/2014	Em Registro de Contrato de Fluxo Constante, Registro de Contrato com Pagamento Final, Registro de Contrato Fluxo Não Constante, Registro de Reset - Alterações e Registro de Atualização de PU / Fator.	Mudança no formato dos campos: Valor base, PU Inicial, Outros – Cotação e PU para Atualização. De: 10 inteiros Para: 14 inteiros. Conforme comunicados 054,067 e 088 de 2014.
10/02/2014	25/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Em Informações Necessárias, inclusão do item 8.
10/02/2014	21/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8146 ASURB MM Equity</b> , <b>8147 EMBONOB CI Equity</b> e <b>8148 SMSAAM CI Equity</b> .
10/02/2014	21/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Mudança na informação necessária do item 3 letra “c”.
10/02/2014	18/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8089 Shekel</b>
10/02/2014	18/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do item “2” em Informações Necessárias.
10/02/2014	13/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Em Informações Necessárias no item “2” inclusão da letra “b”.
10/02/2014	11/08/2014	Exercício de Opção	Mudança da nomenclatura conforme está no NoMe. DE: Knock In com Arrependimento e Knock Out com Arrependimento PARA: Knock In com Opção e Knock Out com Opção.
10/02/2014	06/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8049 PGN US Equity</b>
10/02/2014	05/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8046 MVP CAPITAL MACRO FI EM COTAS DE FIM</b>
10/02/2014	01/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8027 FMEGR 5 5/8 07/31/19 Corp</b>
10/02/2014	01/08/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>8045 MVP CAPITAL MACRO MASTER FIM</b>

<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>
10/02/2014	30/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>8005</b> DVA 6 5/8 11/01/20 Corp, <b>8025</b> INTEL 6 ¾ 06/01/18 Corp e <b>8026</b> SCI 4 1/2 11/15/20 Corp
10/02/2014	28/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Paridade de Moedas	Retirada da curva VCP 343 - Peso Argentino (ARS) EMTA
10/02/2014	25/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7986</b> RÚPIA
10/02/2014	25/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7663</b> MCABREF KY EQUITY Inclusão da letra “a” no item 2 das Informações Necessárias.
10/02/2014	24/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7985</b> ALTICE USL0179ZAA23
10/02/2014	23/07/2014	Todo o manual.	Inclusão do caminho completo da função no NoMe.
10/02/2014	21/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7984</b> OMAB US Equity
10/02/2014	15/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7943 Energia Elétrica PLD - CCEE
10/02/2014	11/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7923</b> GOL US Equity
10/02/2014	11/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7924</b> ASCMA 9 1/8 04/01/20 Corp
10/02/2014	07/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Alteração no nome da Curva VCP <b>7883</b> de 01/15/2021 para 02/15/2021.
10/02/2014	04/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7883</b> VECTOR GROUP LTD
10/02/2014	27/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>7843</b> QUEST YIELD FIC FI RF LP, <b>7844</b> MAUA INSTITUCIONAL FIC FIM e <b>7845</b> MAUA ABSOLUTO II FIC FI MULT.
10/02/2014	27/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7823</b> DVR US EQUITY
10/02/2014	27/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7824</b> CASCADES INC
10/02/2014	16/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Alteração no tópico 7 das informações necessárias para VCP de moedas.
10/02/2014	11/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7803</b> TCSA3 BZ EQUITY
10/02/2014	11/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7804</b> Futuro de Título do Tesouro Espanhol
10/02/2014	11/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7805</b> CIE SM Equity
10/02/2014	10/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7783</b> SAB LN EQUITY
10/02/2014	06/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7763</b> CNK 5 1/8 15/12/2022 Corp

<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>
10/02/2014	05/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>7743</b> ABRE11 BZ EQUITY e <b>7744</b> QGEP3 BZ EQUITY.
10/02/2014	03/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7703</b> SDRL US EQUITY
10/02/2014	03/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7704</b> GSHPBR 12 12/20/49 CORP
10/02/2014	19/05/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>7643</b> PFAVAL CB EQUITY e <b>7644</b> MEGACPO MM Equity.
10/02/2014	12/05/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índice	Atualização do texto em Informações Necessárias.
10/02/2014	07/05/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7623</b> GSHPBR 10 11/29/49 Corp
10/02/2014	30/04/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundo de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7604</b> BTGINTG KY EQUITY
10/02/2014	28/04/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7563</b> KLBN11 BZ EQUITY
10/02/2014	24/04/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7523</b> KIMBERA MM EQUITY
10/02/2014	22/04/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>7483</b> UGPA3 BZ EQUITY, <b>7484</b> ABEV3 BZ EQUITY, <b>7485</b> AEDU3 BZ EQUITY, <b>7486</b> ALLL3 BZ EQUITY, <b>7487</b> BBDC3 BZ EQUITY, <b>7488</b> BBSE3 BZ EQUITY, <b>7489</b> BRPR3 BZ EQUITY, <b>7490</b> OIBR4 BZ EQUITY, <b>7491</b> CESP6 BZ EQUITY, <b>7492</b> CPFE3 BZ EQUITY, <b>7493</b> CPLE6 BZ EQUITY, <b>7494</b> CRUZ3 BZ EQUITY, <b>7495</b> CSAN3 BZ EQUITY, <b>7496</b> CTIP3 BZ EQUITY, <b>7497</b> DASA3 BZ EQUITY, <b>7498</b> DTEX3 BZ EQUITY, <b>7499</b> ECOR3 BZ EQUITY, <b>7500</b> ELET6 BZ EQUITY, <b>7501</b> ELPL4 BZ EQUITY, <b>7502</b> ESTC3 BZ EQUITY, <b>7503</b> EMBR3 BZ EQUITY, <b>7504</b> ENBR3 BZ EQUITY, <b>7505</b> FIBR3 BZ EQUITY, <b>7506</b> ITSA4 BZ EQUITY, <b>7507</b> KROT3 BZ EQUITY, <b>7508</b> LIGT3 BZ EQUITY, <b>7509</b> QUAL3 BZ EQUITY, <b>7510</b> RENT3 BZ EQUITY, <b>7511</b> ITUB4 BZ EQUITY e <b>7512</b> SBSP3 BZ EQUITY.
10/02/2014	22/04/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Exclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5107</b> CELPBZ 10.
10/02/2014	22/04/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundo de Investimentos Internacionais	Exclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7001</b> CAZUKEX ID EQUITY



Versão	Atualização em	Referência	Atualização
10/02/2014	16/04/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>7463</b> ABCB4 BZ EQUITY, <b>7464</b> GSHP3 BZ EQUITY, <b>7465</b> EVEN3 BZ EQUITY e <b>7466</b> BTOW3 BZ EQUITY.
10/02/2014	09/04/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7442</b> FUTURO DE COFFEE
10/02/2014	08/04/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índices.	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>7422</b> NDDUE15 INDEX e <b>7423</b> M1APJ INDEX
10/02/2014	04/04/2014	Registro de Contrato – Fluxo Constante, Não Constante e Pagamento Final.	Em Curvas para Atualização no campo “Curva”. Inclusão na descrição da frase “A relação de curvas por categoria pode ser consultada no arquivo público “Indexadores Swap””.
10/02/2014	04/04/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índices.	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7421</b> EURO STOXX Banks Index Futures (FESB)
10/02/2014	26/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7401</b> WIN 7 1/2 04/01/23 CORP
10/02/2014	26/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7402</b> IBM US EQUITY
10/02/2014	21/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>7382</b> BRPRSA 9 10/29/49 CORP e <b>7383</b> FTR 7 1/8 01/15/23 Corp.
10/02/2014	20/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadoria	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7381</b> FUTURO DE SOYBEAN
10/02/2014	18/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>7343</b> BRAP4 e <b>7344</b> USIM3.
10/02/2014	18/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7361</b> BAP US EQUITY.
10/02/2014	18/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7362</b> SIEEXCE LX EQUITY.
10/02/2014	17/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7341</b> ADT 3 1/2 07/15/22 CORP
10/02/2014	17/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7342</b> GFI US EQUITY
10/02/2014	14/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7321</b> HABITAT CI EQUITY
10/02/2014	06/03/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7301</b> WAGTX US Equity.
10/02/2014	20/02/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7261</b> BVC CB EQUITY
10/02/2014	20/02/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7201</b> DIS US EQUITY
10/02/2014	20/02/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7281</b> BAP PE Equity.
10/02/2014	20/02/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7282</b> PFDVVND CB Equity.
10/02/2014	17/02/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7241</b> TBLE3 BZ EQUITY

<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>
10/02/2014	14/02/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Commodity	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7221</b> GCFPAMTP Index
10/02/2014	14/02/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7222</b> AAXJ US Equity.
10/02/2014	10/02/2014	Alteração de Contrato – Pagamento Final, Fluxo Constante e Fluxo Não Constante.	Em características, inclusão dos campos Valor Total Antecipado, Valor Base Atual e Valor Total Amortizado. Conforme comunicado 010/2014.
18/11/2013	31/01/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7181</b> FII Esmeralda
18/11/2013	28/01/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7161</b> DOMO - FII
18/11/2013	24/01/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7141</b> NE US EQUITY
18/11/2013	21/01/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7121</b> TSIPI062 Index
18/11/2013	16/01/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7061</b> AVH US EQUITY
18/11/2013	16/01/2014	Grupo Ações Internacionais	Inclusão de Informações necessárias: 4) Se utilizada a média de cotações: a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.
18/11/2013	13/01/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Alteração da Denominação da Curva VCP e Tipo Classe: <b>22</b> . De “Euro Spot” para “Euro”
18/11/2013	07/01/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7041</b> KLAB 12.24 01/08/19 Corp
18/11/2013	06/01/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Ativos	O Tipo/Classe: <b>6941</b> KLBN11 BZ EQUITY, foi desabilitado em 06/01/2014.
18/11/2013	06/01/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundo de Investimentos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7021</b> FI MULTI C.P. OO2 INV. – INV. NO EXT.
18/11/2013	27/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundo de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>7001</b> CAZUKEX ID EQUITY
18/11/2013	19/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Commodity	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6981</b> LMCADY LME Comdty.
18/11/2013	19/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6982</b> FORUS CI EQUITY
18/11/2013	17/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do trecho “ou Spot (cotação entre a mínima e máxima do dia)” no nº 2 de Informações necessárias.
18/11/2013	17/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Estratégia	Exclusão do trecho “(Código da Estratégia), a ser informado pelo(s) Registrador (es) no campo de descrição da curva VCP.”, no item “observação” da coluna “Critério de Cálculo de PU ou de Fator”.
<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>
18/11/2013	13/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundo de Investimentos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6921</b> INFLII BZ EQUITY

18/11/2013	13/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6941</b> KLBN11 BZ EQUITY
18/11/2013	09/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6901</b> CORPBANC CI EQUITY.
18/11/2013	04/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundo de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6881</b> POCFJIU ID EQUITY.
18/11/2013	27/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6841</b> AXP US EQUITY.
18/11/2013	18/11/2013	Swap com Reset	Permitir indicar o valor mínimo 0,00 para o campo "Valor".
18/11/2013	18/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6821</b> TSLA US EQUITY.
01/07/2013	14/11/2013	Registro de Contrato – Fluxo Não Constante	Mudança na descrição do campo Juros % a.a. em CURVAS PARA ATUALIZAÇÃO - Parte/Contraparte.
01/07/2013	12/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do item 7 na coluna referente às informações necessárias.
01/07/2013	12/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Inclusão do subitem c) no item 2, na coluna referente às informações necessárias.
01/07/2013	12/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadoria	Inclusão da frase "e "Praça" de negociação da mercadoria para referência de preço, se houver." <b>no item 2</b> na coluna referente às informações necessárias. Inclusão do subitem d) no item 3, na coluna referente às informações necessárias.
01/07/2013	11/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6781</b> BOND US EQUITY
01/07/2013	07/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6761</b> CIB US EQUITY, <b>6762</b> CL US EQUITY e <b>6763</b> RBGLY US EQUITY.
01/07/2013	06/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6721</b> GRUMAB MM EQUITY e <b>6722</b> CHDRAUIB MM EQUITY.
01/07/2013	06/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6741</b> MIGOEUH LX EQUITY.
01/07/2013	05/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6701</b> NKY INDEX - NIKKEI
01/07/2013	04/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Mudança no nome do Tipo/Classe 5154 De: DUFN SW EQUITY Para: DUFN VX EQUITY.
01/07/2013	04/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Mudança no texto numero 6 de Informações Necessárias.
01/07/2013	04/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Mudança no texto numero 3 de Informações Necessárias.
01/07/2013	29/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6681</b> Futuro de RUB
01/07/2013	18/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6660</b> CEMEX - CX US EQUITY
<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>
01/07/2013	18/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Mudança no nome do Tipo/Classe: <b>5977</b> .

01/07/2013	16/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6644</b> BNDES 5,75 26/09/2023
01/07/2013	16/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6645</b> LALAB MM EQUITY
01/07/2013	11/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6643</b> Futuro de Palm Oil.
01/07/2013	10/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Inclusão do item 2 das “Informações Necessárias”.
01/07/2013	10/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6641</b> EXX SJ EQUITY
01/07/2013	08/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6623</b> NKE US EQUITY
01/07/2013	04/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6622</b> BBHCOSI:LX
01/07/2013	03/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6620</b> PT US
01/07/2013	03/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6621</b> SCSGUSA:ID
01/07/2013	30/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6600</b> BRK/B US EQUITY
01/07/2013	26/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6580</b> HTZ:US
01/07/2013	25/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6560</b> FRI:US
01/07/2013	25/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6540</b> MMXM11
01/07/2013	20/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6500</b> GGB:US
01/07/2013	13/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6499</b> CCU US EQUITY
01/07/2013	12/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6479</b> ASR:SJ e <b>6480</b> ARI:SJ.
01/07/2013	06/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Mudança no texto de informações necessárias nº (3).
01/07/2013	06/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Commodity	Mudança no texto de informações necessárias <b>a)</b> e <b>b)</b> nº (3).
01/07/2013	06/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Mudança no texto de informações necessárias nº (3).
01/07/2013	03/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6459</b> XLI:US e <b>6460</b> XLY:US.
01/07/2013	29/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6440</b> PYG.
01/07/2013	29/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6439</b> ENI:US
01/07/2013	29/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do grupo: Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais
01/07/2013	29/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6441</b> FRTIEEQ:LX e <b>6442</b> NBUSU1A:ID

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
01/07/2013	27/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Exclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5002</b> Título do Tesouro Americano – 10 anos e <b>5024</b> Título do Tesouro Americano – 30 anos. Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6419</b> Títulos do Tesouro Americano. Atualização no texto de informações necessárias nº (2).
01/07/2013	22/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6399</b> DIRR3 e <b>6400</b> ARTR3.
01/07/2013	20/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6379</b> EEM:US e <b>6380</b> MXWO.
01/07/2013	20/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6381</b> BBAS3, <b>6382</b> ELET3 e <b>6383</b> NETC4.
01/07/2013	19/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Mudança no texto das Informações Necessárias nº (6).
01/07/2013	15/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6343</b> BMA:US, <b>6344</b> TEO:US, <b>6345</b> YPF:US e <b>6359</b> PHM:US.
01/07/2013	14/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6339</b> GGAL US EQUITY, <b>6340</b> IRS US EQUITY, <b>6341</b> MELI US EQUITY e <b>6342</b> LIVEPOLC MM EQUITY.
01/07/2013	13/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6319</b> OREXI08M INDEX
01/07/2013	08/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6305</b> FMG AU EQUITY
01/07/2013	07/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Taxas de Juros	Inclusão do Grupo: <b>Futuro de Taxas de Juros</b> e dos seguintes Tipo/Classe: <b>6300</b> Futuro de ISDAFIX - EURO (EUR), <b>6301</b> Futuro de ISDAFIX - JAPANESE YEN (JPY), <b>6302</b> Futuro de ISDAFIX - BRITISH POUND (GBP), <b>6303</b> Futuro de ISDAFIX - US DOLLAR (USD) e <b>6304</b> Futuro de ISDAFIX - SWISS FRANC (CHF).
01/07/2013	05/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6259</b> FTSE 100 INDEX FUTURE
01/07/2013	01/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>6257</b> VALE/P US EQUITY e <b>6258</b> FBR US EQUITY
01/07/2013	29/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6237</b> OGX AUSTRIA GMBH
01/07/2013	29/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6238</b> BTGP10SM INDEX

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
01/07/2013	29/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Mudança no texto das Informações Necessárias para os seguintes códigos Tipo/Classe: <b>75, 5009, 5030 e 6238.</b>
01/07/2013	24/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6217 GRAM US EQUITY</b>
01/07/2013	24/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6218 FSHOP13 MM EQUITY</b>
01/07/2013	22/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6177 DO US EQUITY</b>
01/07/2013	19/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6157 ORA FP EQUITY</b>
01/07/2013	19/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6158 Futuro de Título do Tesouro Americano</b>
01/07/2013	18/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6117 FUTURO DE FLORIM HÚNGARO</b>
01/07/2013	18/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6137 FXI US EQUITY</b>
01/07/2013	08/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6017 AA US EQUITY</b>
01/07/2013	05/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5977 CEMEX SAB CPO</b>
01/07/2013	05/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5997 FALAB CI EQUITY</b>
01/07/2013	04/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Inclusão do <b>numero 8</b> em Informações Necessárias.
01/07/2013	04/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Inclusão do <b>numero 5</b> em Informações Necessárias.
01/07/2013	01/07/2013	Registro de Contrato – Pagamento Final	Mudança no campo curva. Exclusão dos campos Tipo Libor – Moeda e Tipo Libor – Período. Inclusão do campo Código Identificador. Conforme comunicado 033 e 039/13.
01/07/2013	01/07/2013	Registro de Contrato – Fluxo Constante	Mudança no campo curva; Exclusão dos campos Tipo Libor – Moeda e Tipo Libor – Período; Inclusão do campo Código Identificador. Conforme comunicado 033 e 039/13.
01/07/2013	01/07/2013	Registro de Contrato – Fluxo Não Constante	Mudança no campo curva. Exclusão dos campos Tipo Libor – Moeda e Tipo Libor – Período. Inclusão do campo Código Identificador. Conforme comunicado 033 e 039/13.
10/12/2012	24/06/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do <b>numero 6</b> em Informações Necessárias.
10/12/2012	24/06/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5937 ABE SM EQUITY</b>
10/12/2012	20/06/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5917 UHRN SW EQUITY</b>
Versão	Atualização em	Referência	Atualização

10/12/2012	19/06/2013	Futuro de Moedas	<b>Critério de Cálculo de PU ou de Fator</b> - Inclusão do numero 3. Informações Necessárias - Inclusão do trecho "da Moeda negociada em Reais" no numero 2 e Exclusão do numero 5.
10/12/2012	19/06/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão dos Tipo/Classe com seguintes códigos: <b>5897, 5898, 5899, 5900, 5901, 5902, 5903, 5904, 5905, 5906 e 5907</b>
10/12/2012	14/06/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Correção do código <b>5626</b> para <b>5629</b> NIHD US EQUITY.
10/12/2012	06/06/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5877</b> FUTURO DE COROA NORUEGUESA
10/12/2012	04/06/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Ativos	Inclusão do Grupo: <b>Futuro de Ativos</b> e do seguinte Tipo/Classe: <b>5857</b> Futuro de Euro-Bund - RX COMDTY
10/12/2012	31/05/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5837</b> GOOG US EQUITY
10/12/2012	23/05/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5817</b> CAIXA FIP MZO LOGÍSTICA
10/12/2012	21/05/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5797</b> SORIANAB MM EQUITY e <b>5798</b> COMERUBC MM EQUITY.
10/12/2012	15/05/2013	Intermediação de Contrato	Inclusão das observações <b>3) e 4)</b> .
10/12/2012	14/05/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5777</b> UHR:VX
10/12/2012	13/05/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5757</b> DAXEX GY EQUITY,
10/12/2012	08/05/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5737</b> OHLMEX: MM Equity
10/12/2012	03/05/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira)	Inclusão do novo grupo e dos seguintes Tipo/Classe: <b>5735</b> GGBR4 (contínuo) e <b>5736</b> CSNA3 (contínuo).
10/12/2012	02/05/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5715</b> BRIN3 BZ EQUITY
10/12/2012	26/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5713</b> FUTURO DE CRUDE OIL
10/12/2012	26/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5714</b> COSAN LUXEMBOURG AS
10/12/2012	25/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5695</b> KOF US EQUITY e <b>5696</b> GFNORTEO MM EQUITY.
10/12/2012	25/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimento	<b>Inclusão</b> de descrição para "Critério de Cálculo de PU ou de Fator" <b>Exclusão</b> de informação no campo "Informações Necessárias" e <b>Inclusão</b> de CNPJ para cada fundo.
10/12/2012	25/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Commodity	<b>Inclusão</b> de descrição para "Critério de Cálculo de PU ou de Fator":

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
10/12/2012	24/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5693</b> FMX:US e <b>5694</b> WALMEXV:MM.
10/12/2012	18/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Atualização dos seguintes textos de informação necessária: 3) a) Na base 360 – Ações Internacionais; b) Na base 252 – Ações Nacionais, Exclusão dos seguintes textos de informação necessária: 6) a) a taxa, a sua expressão, a base e o período; ou b) a cotação, o tipo (compra ou venda) e a data da cotação que está sendo utilizado (D-0, D-1, D-2 ou D-3).
10/12/2012	18/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimento	Exclusão dos seguintes textos de informação necessária: 6) a) a taxa, a sua expressão, a base e o período; ou b) a cotação, o tipo (compra ou venda) e a data da cotação que está sendo utilizado (D-0, D-1, D-2 ou D-3).
10/12/2012	18/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5672</b> MT US EQUITY
10/12/2012	17/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>72</b> SOL PERUANO
10/12/2012	17/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	<b>Correção dos Tipo/Classe incluídos no dia 12/04/2013:</b> 5035 BICB4, 5036 BRKM5, 5037 AMAR3, 5038 DAYC4, 5039 PINE4, 5040 BEEF3, 5041 SMT03, 5043 SANB11, 5045 BBDC4, 5046 CSNA3, 5047 GGBR4, 5048 PETR4, 5049 VALE5 e 5096 CZZ US EQUITY.
10/12/2012	17/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimento	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5652</b> KAPITALO KAPPA FIN FIQ DE FIM
10/12/2012	12/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5651</b> STR FP EQUITY
10/12/2012	12/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5035</b> AMAR3, <b>5036</b> BEEF3, <b>5037</b> BICB4, <b>5038</b> BRKM5, <b>5039</b> CSNA3, <b>5040</b> CZZ US EQUITY, <b>5041</b> DAYC4, <b>5043</b> GGBR4, <b>5046</b> PETR4, <b>5047</b> PINE4, <b>5048</b> SANB11, <b>5049</b> SMT03 e <b>5096</b> VALE5.
10/12/2012	12/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Exclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>76</b> PETR4, <b>77</b> VALE5, <b>79</b> BBDC4, <b>222</b> ITUB4, <b>86</b> GGBR4 e <b>84</b> CSNA3.
10/12/2012	08/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Paridade de Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5630</b> CNY EMTA
10/12/2012	08/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5631</b> LAN CI EQUITY
Versão	Atualização em	Referência	Atualização
10/12/2012	08/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5632</b> IYR UP EQUITY



10/12/2012	05/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5609</b> RAL FP EQUITY e <b>5629</b> NIHD US EQUITY
10/12/2012	28/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5206</b> IENOVA * MM
10/12/2012	22/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5205</b> NG
10/12/2012	15/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5204</b> FXG US Equity
10/12/2012	12/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5202</b> TV US EQUITY e <b>5203</b> TSCO LN Equity
10/12/2012	08/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5201</b> EWZ US EQUITY
10/12/2012	04/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadoria	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5199</b> FUTURO DE COPPER e <b>5200</b> LIVE CATTLE FUTURES.
10/12/2012	01/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5198</b> MES INDEX - mini MSCI Emg Mkt
10/12/2012	27/02/2013	Informações Adicionais	Inclusão do tópico Procedimentos Especiais para Liquidação Financeira.
10/12/2012	26/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5196</b> DL NA EQUITY e <b>5197</b> TSCDY US EQUITY.
10/12/2012	25/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5190</b> SX5E INDEX
10/12/2012	25/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Títulos Públicos Nacionais	Inclusão da curva Títulos Públicos Nacionais e os seguintes Tipo/Classe: <b>5191</b> LTN, <b>5192</b> NTN-F, <b>5193</b> NTN-B e <b>5194</b> LFT
10/12/2012	25/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5195</b> AMX US EQUITY
10/12/2012	21/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Paridade de Moedas - Sem Cross Rate	Código <b>5008</b> , melhoria nas Informações Necessárias.
10/12/2012	21/02/2013	Campos com a descrição opcional.	Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
10/12/2012	21/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Commodity	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5186</b> SUGAR No.11, <b>5187</b> TIN = ESTANHO, <b>5188</b> ROUGH RICE = ARROZ e <b>5189</b> COFFEE "C" = CAFÉ.
10/12/2012	15/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5184</b> PRE CN EQUITY e <b>5185</b> BKW US EQUITY
10/12/2012	15/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Paridade de Moedas - Com Cross Rate	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5183</b> CNH-BRL
10/12/2012	08/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5181</b> GSANBOB1 MM EQUITY
10/12/2012	08/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5182</b> S&P 500 INDEX
10/12/2012	05/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5180</b> VALE US EQUITY.
<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>

10/12/2012	01/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5178</b> CULTIBAB MM EQUITY e <b>5179</b> BP US EQUITY
10/12/2012	30/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5176</b> PBR US EQUITY - PETRÓLEO
10/12/2012	30/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5177</b> IYR US EQUITY
10/12/2012	30/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Mudança do nome da curva 5124 de WNH3 Ultra T Bond para WN Ultra T Bond.
10/12/2012	29/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Commodity	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5171</b> WTI CRUDE FUTURE e <b>5172</b> CORN FUTURE.
10/12/2012	29/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5173</b> AS51 INDEX - S&P/ASX 200 INDEX
10/12/2012	29/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5174</b> JB COMB COMDTY - JPN 10Y BOND (TSE)
10/12/2012	29/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadoria	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5175</b> FUTURO DE CORN
10/12/2012	24/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5170</b> XLP US EQUITY
10/12/2012	21/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5163</b> PTC PL EQUITY; <b>5164</b> FTE FP EQUITY; <b>5165</b> TEF SM EQUITY; <b>5166</b> DTE GR EQUITY e <b>5167</b> TIT IM EQUITY.
10/12/2012	21/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimento	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5168</b> FIM CREDITO PRIVADO SIRIUS
10/12/2012	17/01/2013	Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização	Exclusão da funcionalidade Cesta de Garantias e inclusão da funcionalidade Commodity.
10/12/2012	14/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5160</b> OREXIO6M INDEX
10/12/2012	11/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5153</b> OREXIO3M INDEX;
10/12/2012	11/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5154</b> DUFN SW EQUITY
10/12/2012	11/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadoria	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5155</b> FUTURO DE GOLD; <b>5156</b> FUTURO DE IRON; <b>5158</b> FUTURO DE LEAD e <b>5159</b> FUTURO DE ALUMINUM.
10/12/2012	11/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Commodity	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5157</b> PLDMLNPM INDEX – PALLADIUM

<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>
10/12/2012	10/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Commodity	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5143</b> CT - COTTON NO.2 FUTR; <b>5144</b> LOCADY LME COMDTY – COPPER; <b>5148</b> LONIDY LME COMDTY – NICKEL; <b>5149</b> PLAT COMDTY – PLATINUM; <b>5150</b> SOYBEAN FUTURE – CBOT e <b>5151</b> LMZSDS03 LME COMDTY – ZINC.
10/12/2012	10/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5146</b> MEXCHEM* MM EQUITY; <b>5147</b> WFC US EQUITY e <b>5152</b> SIX US EQUITY.
10/12/2012	08/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5145</b> PAM US EQUITY
10/12/2012	07/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5136 CPA US EQUITY, 5138 TX US EQUITY, 5139 EC US EQUITY, 5141 LFL US EQUITY e 5142 NUE US EQUITY.
10/12/2012	07/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5137</b> PPLT US EQUITY e <b>5140</b> GLD US EQUITY
10/12/2012	04/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimento	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5135</b> FX FIM CP - INVESTIMENTO NO EXTERIOR
10/12/2012	02/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5131</b> LGO CN EQUITY
10/12/2012	02/01/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Commodity	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: <b>5133</b> SLVRLN INDEX e <b>5134</b> GOLDLNPM INDEX.
10/12/2012	27/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP - Taxas	Alteração da Informação Necessária nº3
10/12/2012	26/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5117</b> RADL3
10/12/2012	26/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5118</b> AHL US EQUITY e <b>5126</b> CO FP EQUITY.
10/12/2012	21/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Moedas	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5119 Futuro de CAD; 5120 Futuro de EURO; 5121 Futuro de GBP e 5122 Futuro de MXN.
10/12/2012	21/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5124</b> WNH3 Ultra T Bond.
10/12/2012	21/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP - Commodity	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>5125</b> Alumínio.
10/12/2012	21/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão da informação: Na base 365 – TJMI, LIBOR, EURIBOR ou Prefixado365;
10/12/2012	20/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Índices.	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5116 SPY US EQUITY
10/12/2012	17/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Moedas	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5108 Futuro de AUD e 5110 Futuro de JPY
<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>

10/12/2012	14/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5111 GM US EQUITY; 5112 BUD US EQUITY e 5113 RIO US EQUITY.
10/12/2012	13/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5109 JCP US EQUITY
10/12/2012	12/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5102 BOLSAA MM EQUITY; 5103 PEN NO EQUITY; 5104 BSMX US EQUITY; 5105 AVP US EQUITY;
10/12/2012	12/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5106 LUPA 9 e 5107 CELPBZ 10
10/12/2012	11/12/2012	Registro e Alteração de Fluxo de Data de Verificação	Melhoria nas descrições.
10/12/2012	11/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do grupo Ações Internacionais com o seguinte Tipo/Classe: 5101 AAPL US EQUITY
10/12/2012	10/12/2012	> Registro e Alteração de Contrato de Pagamento Final, > Fluxo Constante, e > Não Constante.	> Exclusão dos campos Cesta garantia parte e Cesta garantia contraparte; > Inclusão do índice /parâmetro de atualização do contrato da Parte e da Contraparte 80 (COMMODITY); > Inclusão das datas de cotações em 04 (D-4) e 05 (D-5) para Parte e Contraparte Exclusivo para curva "Libor"; > Inclusão dos campos Data da Cotação - Variação Cambial – Parte e Contraparte; > Inclusão dos campos Exclusivo para Commodity. Conforme comunicado 96/12.
10/12/2012	10/12/2012	Registro e Alteração de Fluxo de Data de Verificação	Função nova.
23/07/2012	10/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Exclusão dos seguintes Tipo/Classe por motivo de bloqueio: 30 Commodity Agric, 31 Commodity Metal e 32 Commodity Ener.
23/07/2012	10/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Índices.	Inclusão do Tipo/Classe: 5100 EWW US EQUITY
23/07/2012	06/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5098 BTG ALPHA CAPITAL MASTER FIC DE FIA e 5099 BTG ALPHA MASTER FIC DE FIA
23/07/2012	05/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Exclusão dos seguintes Tipo/Classe por motivo de bloqueio: 38 Ações Inter, 37 Ações Nac., 39 Atvs Priv Nac., 40 Atvs Priv Inter, 41 Atvs Pub Nac., 42 Atvs Pub Inter, 43 Cts Fdos Nac., 44 Cts Fdos Inter, 88 ETF Nacional e 89 ETF Internacional.
<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>

23/07/2012	05/12/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão dos Tipo/Classe: 5095 PMAM3; 5096 CZZ US EQUITY e 5097 EURO-OAT FUTURO.
23/07/2012	14/11/2012	Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 1	Exclusão da coluna cesta de garantia
23/07/2012	09/11/2012	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do Tipo Classe 5094 - Unidade de Fomento (UF) - Chile
23/07/2012	06/11/2012	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão das Informações Necessárias 1 e 4 para IPCA, IGPM, INPC, IGP-DI, INCC e IPC.
23/07/2012	25/10/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão do Tipo Classe SUZB5 SUZANO PAPEL PNA
23/07/2012	11/10/2012	Liquidação Financeira de Prêmios	Melhoria no texto.
23/07/2012	11/10/2012	Cupom Limpo/Outros – Cotação	Exclusão da opção DI.
23/07/2012	05/10/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão do Tipo Classe TRIUNFO PART ON
23/07/2012	02/10/2012	Data de Cotação. Curvas Disponíveis para VCP	Melhoria no texto da descrição do campo.
23/07/2012	18/09/2012	Cupom Limpo e Data de Cotação	Melhoria no texto da descrição dos campos.
23/07/2012	17/09/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão do tipo/classe TARPON INV ON
23/07/2012	06/09/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão do tipo/classe BOVESPA INDEX FUT
23/07/2012	04/09/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão do tipo/classe HYPE3 e VIVT4.
23/07/2012	30/08/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão do tipo/classe ASX SPI 200 FUTURES
23/07/2012	29/08/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão de Ações Nacionais.
23/07/2012	29/08/2012	Antecipação de Contratos	Possibilidade de Antecipação nos Contratos com Fluxo Constante e Não Constante
23/07/2012	09/08/2012	Registro Documentacional	Disponibilizado para todos os VCPs.
23/07/2012	08/08/2012	Registro de Contrato	Observação no Fluxo Constante e Fluxo Não Constante.
23/07/2012	06/08/2012	Registro Fluxo de Caixa Não Constante	De: Existe a limitação de 120 datas de eventos por registro, incluindo o resgate. Para: Existe a limitação de 180 datas de eventos por registro, incluindo o resgate
23/07/2012	23/07/2012	Registro/Emissão	Disponibilização do uso de limitador superior e inferior no fluxo não constante para DI
23/07/2012	23/07/2012	Antecipação de Contratos	Inclusão de texto sobre antecipação na data de evento de juros.
23/07/2012	23/07/2012	Registro – Pagamento Final	Inclusão de novo indexador "IBOVESPA Fechamento" como curvas para atualização.
23/07/2012	23/07/2012	Contrato com Funcionalidades	Inclusão de texto sobre o Registro Documentacional.
01/07/2012	17/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6097</b> JHSF3
01/07/2012	17/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6077</b> OREXI09M INDEX
<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>

01/07/2012	16/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do <b>numero 7</b> em Informações Necessárias.
01/07/2012	12/07/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: <b>6057</b> TIIE
19/03/2012	13/06/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Alteração do nome do VCP 75 de Ibovespa para Ibovespa de Liquidação; Inclusão do VCP 5030 Ibovespa e Inclusão do VCP 5031 - Futuro de FTSE/MIB Index.
19/03/2012	01/06/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Melhoria no texto das informações necessárias dos VCPs: Moedas – item 7, Taxas – item 4, Commodities – item 6 e 7, Índices – item 3, Índices - MXBR0CS – Item 4 e 5, Índices – ETF Nacional – Item 4, Índices – ETF Internacional – item 4 e 5, Índices – Item 4 e 5, Ações – item 6, Ativos – item 4 e 5, Paridade de Moedas – Sem , Cross Rate - item 5, Paridade de Moedas – Sem Cross Rate – US\$ EMTA – item 3, Paridade de Moedas – Sem Cross Rate – PESO ARGENTINO (ARS) EMTA – item3 e Paridade de Moedas – Sem Cross Rate – Razão entre paridades – item 3.
19/03/2012	21/05/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão dos Tipo/Classe: MXBR0CS – Brazil Consumer Staples Index – 5.029
19/03/2012	15/05/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão dos Tipo/Classe: Futuro de OMXS30 - 5028
19/03/2012	15/05/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Melhoria no texto, item "Paridade de Moedas sem Cross Rate".
19/03/2012	11/05/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão do item 4 das observações
19/03/2012	11/05/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Ações: Inclusão do texto explicando a possibilidade de tratamento de proventos pagos ex e de tratamento proporcional no caso de médias asiáticas (no caso, valor base x dias restantes da média/ dias da média asiática)
19/03/2012	07/05/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão dos Tipo/Classe: Futuro de IBEX 35 - 5027
19/03/2012	02/05/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão dos Tipo/Classe: Futuro de Pulp Europe NBSK
19/03/2012	19/04/2012	Informações Necessárias- Commodities	Melhoria no texto
19/03/2012	19/04/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão dos Tipo/Classe: ·Título do Tesouro Americano-30 anos – 5024
19/03/2012	02/04/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão dos Tipo/Classe: · Futuro CAC40 – 5.014
19/03/2012	27/03/2012	Curvas Disponíveis para VCP (Consulta de Tipo Classe)	Inclusão da Regra: É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.

<b>Versão</b>	<b>Atualização em</b>	<b>Referência</b>	<b>Atualização</b>
19/03/2012	20/03/2012	> Registro Contrato Fluxo Constante > Registro Contrato Fluxo não Constante > Registro Contrato Pagamento Final	Inclusão da informação da cotação que é utilizada para Índice Termo = VCP ou Dólar
19/03/2012	19/03/2012	Características de Contrato de Swap	Na consulta Características de Contrato de Swap. É possível visualizar o agente de Cálculo ou Aceleração.
06/02/2012	05/03/2012	Curvas Disponíveis para VCP (Consulta de Tipo Classe)	Informações necessárias - Inclusão das indicações para os itens Cotação Inicial e Câmbio para Conversão.
06/02/2012	02/03/2012	Registro de Contrato - Pagamento Final	No Campo Observação - Inclusão da Regra: É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.
06/02/2012	01/03/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão dos Tipo/Classe: INPC – 5.010, IGPDI – 5.011, INCC – 5.012 e IPC – 5.013.
06/02/2012	28/02/2012	Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão dos Tipo/Classe: Razão entre paridade PTAX e EMTA BRL – 5.008 e IBrX50 – 5.009.
06/02/2012	16/02/2012	Item – Curvas Disponíveis para VCP	Inclusão dos Tipo/Classe: Futuro Mini S&P – 5.004, Futuro Nikkei 225 (USD) – 5.005, Futuro Mini Nasdaq – 5.006 e Futuro Mini Dow – 5.007.

# Introdução ao Swap

---



---

## Conhecendo o Produto

### Swap Fluxo de Caixa

São contratos cujas contrapartes trocam, em determinado período de tempo, diferenciais de pagamentos de juros ao final do contrato ou periodicamente, podem trocar também, diferenciais de principal. (Veja detalhes em Informações Adicionais, tópico Códigos dos Contratos).

O objetivo a ser alcançado pelas instituições registradoras é adequar as estruturas de hedge às características daquelas operacionalizadas no mercado internacional, com a correção de distorções de natureza operacional e de alocação de capital, advindas do registro de vários contratos de Swap, um para cada evento de troca de juros e/ou amortizações de principal.

#### Registro de Contrato

No registro é definido o Valor Base (Notional), as curvas de atualização e seus parâmetros, bem como, as datas para a troca de diferenciais de juros/amortizações. Admite-se contrato em que ocorra somente troca de diferenciais de juros, sem troca de diferenciais de amortizações, ou com estas ocorrendo apenas no vencimento do contrato (Amortização Final).

Para curvas referenciadas em Libor ou Taxa de Juros Mercado Internacional, há a possibilidade dos Participantes incluírem as despesas referentes a Imposto de Renda sobre a remessa de juros. Com estes parâmetros também é permitido o estabelecimento de limites de variação – cap e floor.

O Swap de Fluxo de Caixa está habilitado a acatar o registro dos seguintes tipos de contratos:

- À vista, onde Data Início = Data Atual;
- Decorrido (contrato que envolva cliente 1), onde Data Início < Data Atual; e.
- Termo, onde Data Início > Data Atual.

#### Troca de diferenciais de Juros

Nas datas previstas nos fluxos para pagamento do evento, o sistema efetua a atualização do Valor Base, segundo os critérios definidos para cada parte do contrato, realizando o cálculo dos juros, e procedendo ao pagamento da diferença resultante entre os valores da parte e contraparte.

#### Troca de diferenciais de Amortizações

Nas datas definidas para os eventos, o sistema efetuará os cálculos das amortizações, na forma definida no registro do contrato, e realizará o pagamento da diferença resultante entre as curvas.

Embora admitidos intervalos diferentes entre pagamento de diferencial de principal e de juros, as datas dos eventos de pagamento de diferencial de principal, quando houver, devem ser coincidentes com as datas de pagamento de diferencial de juros. É efetuado primeiramente o cálculo dos juros, e somente depois o cálculo das amortizações.

#### Agenda de Eventos

O módulo dispõe de tela onde são visualizados todos os eventos do contrato, pagamento de diferencial de juros/amortizações.

Nesta modalidade também é permitido o registro de contratos de Swap com pagamento final, onde existe também a possibilidade de indicação de pagamento de ajustes, apurados com base na metodologia de marcação a mercado (Swap com Reset).

---

Outra funcionalidade disponível é a previsão de pagamento de prêmios.

### **Swap Pagamento Final**

Modalidade em que é permitido o registro de contratos de **Swap com pagamento final**.

São contratos cujas contrapartes trocam, na data de vencimento, diferenciais de pagamentos de juros e de principal.

O objetivo a ser alcançado pelas instituições registradoras é adequar as estruturas de hedge às características daquelas operacionalizadas no mercado.

#### **Observação:**

---

Nos contratos de Swap Pagamento Final ou com Fluxo que envolvam clientes do tipo 1:

- 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 vai alterar a situação do evento para Retirado por Inadimplência.

---

### **Swap com Reset**

Nesta modalidade são permitidos os registros de Contratos à Vista e a Termo, **com previsão exclusiva de pagamento final**.

#### Condições para pagamento de ajustes periódicos

O pagamento do ajuste poderá ser acionado no sistema através dos seguintes critérios, a escolha do (s) contratante (s):

- Data: permite somente o pagamento de ajuste na data(s) informada(s);
- Valor: o pagamento é permitido quando a diferença das curvas marcadas a mercado for maior que o valor informado neste parâmetro;
- Disparo por data ou valor: permite a utilização conjunta dos dois parâmetros anteriores; e.
- Disparo por data e valor: o disparo do ajuste ficará condicionado a data(s) pré-determinada(s) e nos casos em que a diferença das curvas marcadas a mercado ultrapasse determinado valor.

---

**Observação:** Mesmo sendo verificadas as condições para pagamento do ajuste, as partes poderão optar pela não liquidação financeira do mesmo.

---

#### Responsabilidade da informação das curvas marcadas a mercado

Os contratantes definem por ocasião do registro do contrato quem é o responsável pela atualização das curvas marcadas a mercado através dos seguintes critérios:

- Atualizado através de informação da parte;
- Atualizado através de informação da contraparte; e.
- Atualizado por duplo comando da parte / contraparte.

---

### Campos passíveis de redefinição

Por ocasião do pagamento de ajuste, e em função da marcação a mercado, é permitida a alteração dos seguintes parâmetros:

- Valor base do contrato;
- Cupom de juros;
- Percentual do índice de atualização;
- Cotação base da moeda para valorização cambial - Cupom limpo; e.
- Limites de alta e baixa para curvas de atualização.

**Observação:** O descumprimento em efetuar as atualizações dos indicadores econômicos não disponibilizados pela Cetip nas datas previstas para liquidação financeira das diferenças relativas aos juros e/ou amortizações incidentes sobre o valor base da operação também caracteriza a inadimplência regulamentar do Participante, o que não se aplica caso o contrato tenha sido firmado entre o Participante e seus Clientes 1 (um) e 2 (dois) ou entre Clientes 1 (um) de um mesmo Participante.

### **Swap com Agenda de Redutor de Risco Crédito**

É possível registrar no Módulo de Informações de Derivativos os eventos e as condições de agenda de Redutor de Risco de Crédito, para os seguintes contratos de Swap:

Contratos de Swap de Pagamento Final ou com Fluxo de Pagamento (Constante e Não Constante). Os contratos com Reset não serão passíveis de indicação desta modalidade.

A agenda de redutor de risco de crédito poderá ser incluída no MID a partir da finalização do registro do derivativo original, bem como a indicação de agente de cálculo para o referido contrato.

Entende-se por evento de redutor de risco de crédito o momento em que o contrato de derivativo é avaliado e para qual deve ser informado seu preço de mercado (MtM).

Cada preço de mercado (MtM) informado terá uma liquidação financeira, desde que as condições do acordo de redutor de risco de crédito sejam atingidas. Em decorrência da liquidação financeira desses eventos existirá um saldo (teórico) atualizado por um indexador, arbitrado no ato da inclusão dos eventos de redutor de risco de crédito.

Os cancelamentos dos contratos originais, inclusive os decorrentes de funcionalidades, cancelarão automaticamente as agendas de eventos de Derivativos com Redutor de Risco de Crédito do MID.

### **Observação:**

- 1) SWAP com redutor de risco de crédito não pode ser gravado no módulo de Registro de Contrato de Garantia.

---

## Ações dos botões das telas

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

Botão	Funcionalidade
Enviar	Processa as informações, levando para a tela de confirmação.
Limpar Campos	Limpa os campos já preenchidos.
Desistir	Não processa as informações, saindo da tela e voltando à página do NoMe.
Prosseguir	Prossegue com a ação indicada na tela.
Pesquisar	Realiza pesquisa de acordo com dados inseridos na tela filtro.
Voltar	Volta à tela anterior com os últimos dados digitados.
Confirmar	Confirma os dados apresentados em tela.
Corrigir	Retorna a tela anterior com os dados editados para possível correção.
Atualizar	Reexecuta a consulta a partir dos filtros informados na tela de filtro.

---

# Lançamento

---

## Registro de Contrato - Pagamento Final

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Contrato – Pagamento Final

### Visão Geral

Através desta função, é possível registrar um contrato de pagamento final. O Participante devedor vai arcar com o diferencial da curva contábil na data de vencimento do mesmo.

### Tela Registro de Contrato - Pagamento Final

Registro de Contrato - Pagamento Final			
Parte [ ][ ][ ]	Contraparte [ ][ ][ ]	CPF/CNPJ Cliente Parte [ ][ ][ ][ ][ ][ ]	CPF/CNPJ Cliente Contraparte [ ][ ][ ][ ][ ][ ]
Meu Número [ ][ ][ ][ ][ ][ ][ ][ ][ ]		Comissão Parte [ ][ ], [ ][ ][ ]	Comissão Contraparte [ ][ ], [ ][ ][ ]
Características			
Data Inicio [ ][ ][ ][ ]	Data Vencimento [ ][ ][ ][ ]	Valor Base [ ][ ][ ][ ][ ][ ]	
Funcionalidades [ ]	Adesão a Contrato [ ]	Agenda de Prêmio [ ]	Reset [ ]
	Amortiza sem troca de diferencial [ ]	Código Identificador [ ][ ][ ][ ][ ][ ]	Código Estratégia [ ][ ][ ][ ][ ][ ]
Exclusivo para Contrato à Termo			
Data Operação [ ][ ][ ][ ]	Índice Termo [ ]	Perc. Termo [ ][ ], [ ][ ][ ]	
Se Índice Termo			
PU Inicial/Cupom Limpo [ ][ ][ ][ ]	Data de Cotação Final - Termo [ ]	Tipo/Classe [ ]	Denominação [ ]
Curvas para Atualização			
Parte			Contraparte
Percentual [ ][ ], [ ][ ][ ]	Categoria [ ]	Curva [ ]	Percentual [ ][ ], [ ][ ][ ]
TR Escolhida [ ][ ][ ][ ]	+/- [ ]	Juros(% aa) [ ][ ], [ ][ ][ ]	TR Escolhida [ ][ ][ ][ ]
	Lim. Inferior (Floor) [ ][ ][ ], [ ][ ][ ][ ]	Lim. Superior (Cap) [ ][ ][ ][ ], [ ][ ][ ][ ]	
			Lim. Inferior (Floor) [ ][ ][ ][ ], [ ][ ][ ][ ]
			Lim. Superior (Cap) [ ][ ][ ][ ][ ], [ ][ ][ ][ ][ ]
Terceira Curva			
Parte/Contraparte [ ]	Cupom Limpo [ ][ ][ ][ ]	Percentual [ ][ ][ ][ ]	Curva [ ]
		+/- [ ]	Juros(% aa) [ ][ ][ ][ ]
			Limitador [ ]
Se Curva(s) = "VCP":			
Parte		Contraparte	
PU [ ][ ][ ][ ]	Tipo/Classe [ ]	PU [ ][ ][ ][ ]	Tipo/Classe [ ]
Denominação [ ]		Denominação [ ]	
Cupom Limpo/Data Cotação			
Parte		Contraparte	
Cupom Limpo [ ][ ][ ][ ]	Data de Cotação [ ]	Cupom Limpo [ ][ ][ ][ ]	Data de Cotação [ ]
Exclusivo para curva "Libor"			
Parte		Contraparte	
Data de Cotação - Libor [ ]	Variação Cambial [ ]	Data de Cotação - Libor [ ]	Variação Cambial [ ]
Tipo Classe [ ]	Data da Cotação - Variação Cambial [ ]	Tipo Classe [ ]	Data da Cotação - Variação Cambial [ ]
Cupom Limpo / Outros - Cotação [ ][ ][ ][ ]	Aliquota IR [ ][ ][ ][ ]	Cupom Limpo / Outros - Cotação [ ][ ][ ][ ]	Aliquota IR [ ][ ][ ][ ]
Limite Inferior (Floor) - Perc. [ ][ ][ ][ ]	Limite Superior (Cap) - Perc. [ ][ ][ ][ ]	Limite Inferior (Floor) - Perc. [ ][ ][ ][ ]	Limite Superior (Cap) - Perc. [ ][ ][ ][ ]

Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional"			
<b>Parte</b>		<b>Contraparte</b>	
Taxa Juros <input type="text"/>	Variação Cambial <input type="text"/>	Taxa Juros <input type="text"/>	Variação Cambial <input type="text"/>
Tipo Classe <input type="text"/>	Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/>	Tipo Classe <input type="text"/>	Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/>
Aliquota IR <input type="text"/>	Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/>	Aliquota IR <input type="text"/>	Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/>
Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/>		Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/>	
Exclusivo para Commodity			
<b>Parte</b>		<b>Contraparte</b>	
Cotação Inicial <input type="text"/>	Codigo da Commodity <input type="text"/>	Média Asiática Verificação <input type="text"/>	Data da Cotação para Ajuste <input type="text"/>
Funcionalidades			
<b>Trigger in</b>		<b>Trigger out</b>	
Parte/Contraparte <input type="text"/>	Fator/Valor/Taxa <input type="text"/>	Verificação <input type="text"/>	
<b>Titular da Funcionalidade/Prêmio</b>		<b>Prêmio(1) de Funcionalidade</b>	
Titular <input type="text"/>	Valor R\$ <input type="text"/>	Rebate R\$ <input type="text"/>	
	Liquidação do Rebate <input type="text"/>	Dias Úteis após o Trigger Out <input type="text"/>	
		<b>Prêmio(2) de Funcionalidade</b>	
	Valor R\$ <input type="text"/>	Data Exercício <input type="text"/>	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

(fim)

Ao selecionar o botão **Enviar**, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão **Confirmar**, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o contrato está aguardando lançamento da contraparte. Nesta tela é exibido os botões **Prosseguir**, que dá continuidade ao registro, e **Desistir**, que cancela a operação.

Clicando no botão **Prosseguir** é apresentada a tela para que o Participante informe os Parâmetros de Reset (o sistema exibe para contratos com previsão de Agenda de Prêmios e/ou Reset).

### Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato - Pagamento Final

Campo	Descrição
Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, registrando o contrato. Conta deve ser do tipo 00, 10, 20 ou 70 a 88.

<b>Campo</b>	<b>Descrição</b>
Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro com quem é efetuado o contrato. Conta deve ser do tipo 00, 10, 20 ou 70 a 88.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído à operação de Swap com Pagamento Final. Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.
CPF/CNPJ Cliente Parte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC Identificação do CPF/CNPJ do Cliente do Participante. Há necessidade de matching das informações.
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Identificação do CPF/CNPJ do Cliente da Contraparte. Há necessidade de matching das informações.
Comissão Parte	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor percentual que será aplicado sobre o Valor Base inicial da operação, sob a forma de comissão a ser paga a Parte. Informado com até 2 (dois) inteiros e 8 (oito) decimais.
Comissão Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor percentual que será aplicado sobre o Valor Base inicial da operação, sob a forma de comissão a ser paga a Contraparte. Informado com até 2 (dois) inteiros e 8 (oito) decimais.
<b>CARACTERÍSTICAS – Características básicas do contrato</b>	
Data Início	Campo de preenchimento obrigatório. Data a partir da qual as curvas do contrato passam a ser atualizadas. Não pode ser menor do que a Data de Registro, exceto quando operação realizada com Cliente 1, limitado a D-2.
Data Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Data na qual a operação de Swap vence. Deve ser maior que Data Início. O período máximo é de 9.999 dias úteis a partir da data informada em “Data Início”.



Valor Base	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor Base inicial da operação a partir do qual os parâmetros definidos para o contrato ou para a correção das operações a termo irão incidir. Em R\$.</p> <p>Com 14 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais.</p>
Funcionalidades	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a funcionalidade do contrato. Caixa de Seleção com as opções: <b>Sem Funcionalidade, Knock In, Knock Out, Knock In/Out, Swaption, Compound, Opção de Arrependimento, Knock In com Opção, Knock Out com Opção e Swap com Prêmio.</b> (Ver <b>Contratos com Funcionalidades</b>)</p>
Adesão a Contrato	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: <b>CGD, CGD/CSA, CSA</b> ou <b>Sem Adesão</b>. Indica a existência, ou não, de adesão a contrato padronizado de Derivativos.</p>
Agenda de Prêmio	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: <b>SIM</b> e <b>NÃO</b>. Indica se no contrato que está sendo registrado existirá o pagamento de prêmio.</p>
Com Reset	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: <b>SIM</b> e <b>NÃO</b>. Indica se irão existir ajustes periódicos nesse contrato de Swap com pagamento final.</p>
Código Estratégia	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informar o código da estratégia, cadastrada e habilitada para o Participante pela Cetip, que se deseja vincular ao contrato.</p>
Amortiza sem troca de diferencial	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Sim ou Não</p> <p>Quando Seleccionada a opção Sim, se uma das curvas for moeda ou índice de preços registrar a(s) mesma(s) como VCP.</p>
Código Identificador	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Código de controle interno do participante.</p>

---

**Exclusivo para Contrato à Termo**


---

Data Operação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Pode ser a própria data de registro ou D-2 da data de registro, se for com cliente 1. Data início da operação a termo.</p> <p>Não há limite de prazo para o período a termo.</p>
Índice Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Se este campo não for preenchido, o sistema considera que o Valor Base não será corrigido, a partir da Data Operação (que deve estar preenchida) até a Data Início. Os participantes pactuam um único índice para atualização do Valor Base.</p> <p>Indica o parâmetro com o qual deve ser atualizado o Valor Base inicial, a partir da Data Operação até a data de efetivação do termo (Data Início), exclusive. Indexadores permitidos para atualização do Valor Base, quando contrato a termo: DI, SELIC, DOLAR, EURO/COM.EUROPEIA, EURO-BCE, IENE, LIBRA, FRANCO SUICO, PESO MEXICANO, OURO, TR, TJLP, FRANCO SUIÇO BCE e VCP.</p> <p><b>Observações:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>➤ No registro retroativo de contrato a termo com Cliente 1, não é permitido índice termo quando data de registro maior que data de início do contrato.</li> <li>➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)</li> <li>➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)</li> <li>➤ FRANCO SUIÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]</li> </ul>

Perc. Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório se o <b>Índice Termo</b> for preenchido.</p> <p>Informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais. Valor percentual do Índice Termo que corrige o Valor Base inicial da operação a partir da Data Operação até a data de efetivação do termo (Data Início).</p>
-------------	---

---

**Se Índice Termo**


---

PU Inicial/ Cupom limpo	<p>Campo de preenchimento obrigatório apenas na data de registro do Swap. Caso não seja preenchido, o Valor Base é atualizado pelo Fator (campo abaixo).</p> <p>No caso de Swap à Termo, só deve ser preenchido quando <b>Índice Termo</b> for VCP, DOLAR ou EURO.</p> <p>PU inicial para atualização do Valor Base. Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser <b>00 - VCP</b>.</p> <p>Cupom Limpo, exclusivo para utilização em caso de índice Termo = dólar.</p> <p>Utilizado para informar o valor da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor inicial para valorização da curva do contrato quando código de registro igual a Dólar (Cupom Limpo).</p>
----------------------------	--

Data de Cotação Final – Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório para quando o campo “Índice termo” seja qualquer moeda disponível em seu domínio.</p> <p>Utilizado para informar o deslocamento da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor final para valorização da curva do contrato quando índice termo for moeda.</p> <p>Possíveis valores: (01) D-1; (02) D-2; (03) D-3; (04) D-4; (05) D-5;</p>
Tipo/Classe	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções descritas no tópico <b>Consulta de Tipo de Classe</b>. Não é permitida a indicação de Tipo/Classe 73 (Estratégia).</p> <p>Tipo do Índice <b>VCP</b> que atualiza o Valor Base do contrato a termo.</p>
Denominação	<p>Campo de preenchimento obrigatório no caso do Termo = <b>VCP</b></p> <p>Descrição do parâmetro escolhido como <b>VCP</b> para atualização do Valor Base do contrato a termo. Texto livre com 320 posições.</p> <p>Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo “Tipo/Classe”. Para maiores consultar a seção “Consulta Tipo Classe”.</p>
<b>CURVAS PARA ATUALIZAÇÃO – Parte/Contraparte</b>	
<b><i>Curvas do Swap, para atualização conforme os parâmetros definidos.</i></b>	
Percentual	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor percentual do parâmetro com que o participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva.</p> <p>Informado com até 3 (três) inteiros e 2 (dois) decimais.</p> <p>O percentual pode ser menor, igual ou maior que 100%, com exceção da curva Libor, havendo ou não taxa de juros. Curvas iguais ou diferentes, inclusive VCP:</p> <p>Se os campos "Curva", "Percentual" e "Juros %a.a." forem idênticos -&gt; Uma das pontas do contrato deve ter um Limitador Fator; e.</p> <p>Se os campos "Curva" forem iguais e contrato sem Limitador Fator -&gt; Os campos "Percentual" e/ou "Juros %a.a." deverão ser diferentes.</p>
Categoria	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: COMMODITIES, INDICES, INDICES DE PREÇOS, JUROS, JUROS INTERNACIONAIS, TAXAS DE CÂMBIO E VCP.</p>
Curva	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>A caixa de opções abrirá de acordo com a categoria escolhida. A relação de curvas por categoria pode ser consultada no arquivo público “Indexadores Swap”.</p>
TR Escolhida	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Formato: DDMMAAAA.</p>
Sinal + / -	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p>

Preencher em conjunto com **Juros**. Somente os registros de contratos pactuados com base no **DI, DI 360 d, SELIC, Prefixado 252 d, Prefixado 360 d, Dólar, Dólar Com. Exp., Franco Suíço, Franco Suíço WMR, EURO/COM.EUROPEIA, Euro-BCE, Euro-WMR, Iene, Peso Mexicano, LIBOR, TJMI e Ibovespa Liquidação e Ibovespa Liquidação Contínuo** (exclusivo para contrato com funcionalidade que envolva trigger). Aceitam taxas de juros negativas.

Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa.

**Observações:**

- EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)
- EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)
- EURO-WMR = Paridade USD/EUR (WMR) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)
- FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
- FRANCO SUÍÇO WMR = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (WMR) / Paridade USD/EUR (WMR)]

Juros % a.a. Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.  
Preencher em conjunto com **Sinal**. Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.  
É a taxa de remuneração que, agregada ao parâmetro, atualiza o Valor Base.

Lim. Inferior (Floor) Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.  
Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais. Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o módulo usa o limite para corrigir a curva.  
Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.

Lim. Superior (Cap) Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.  
Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais. Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o módulo usa o limite para corrigir a curva.  
Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.

**Terceira Curva – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.**

Parte/Contraparte Caixa de Seleção com as opções: Parte e Contraparte.

Cupom Limpo	<p>Na utilização de Terceira Curva, exclusivamente para os parâmetros baseados em Moeda e Ibovespa de Liquidação, de comum acordo entre as partes, que o módulo usa como valor inicial para valorização da curva do contrato.</p> <p>Informado com até 8 (oito) números inteiros e 7 (sete) decimais.</p>
Percentual	<p>Valor percentual do parâmetro de atualização da Terceira Curva do Swap, usada como Limite Inferior ou Superior.</p> <p>Informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais.</p>
Curva	<p>Na utilização de Terceira Curva que o módulo necessita para atualização do contrato.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: <b>DI, Selic, Dólar, Dólar Com. Exponencial, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, Franco Suíço, Iene, Peso Mexicano, IGP-M, IGP-DI, INPC, TR, TJLP e Ouro.</b></p> <p><b>Observações:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)</li> <li>➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220)</li> <li>➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]</li> </ul>
+ / -	<p>Indica se o juro a ser agregado ao parâmetro de atualização é positivo ou negativo. Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, SELIC, Dólar, Dólar Com. Exp., Franco Suíço, <b>EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE</b>, Iene e Peso Mexicano, aceitam taxas de juros negativas.</p> <p><b>Observações:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)</li> <li>➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220)</li> <li>➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)].</li> </ul>
Juros (% aa)	<p>Taxa de Juros que, agregada ao parâmetro escolhido para terceira curva, atualiza o valor base. Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.</p>
Limitador	<p>Caixa de Seleção com as opções: Limite Inferior e Limite Superior.</p>
<p><b>Se Curva (s) = VCP - Parte/Contraparte – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.</b></p>	
PU	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando curva 00 ou contrato à vista ou decorrido.</p>

	<p>Valor unitário do índice na data de contratação do Swap em que a variação do parâmetro não disponibilizado pela Cetip é aplicada. É o PU inicial quando a Curva escolhida for <b>00 - VCP</b>.</p> <p>Pode ser atualizado pela função <b>Atualização de PU / Fator</b> até a data do vencimento.</p>
Tipo/Classe	<p>Tipo do Índice <b>VCP</b> para a(s) curva(s) do(s) Participante e da Contraparte, caso seja(m) do tipo <b>VCP</b>.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções descritas no tópico Consulta de Tipo de Classe.</p>
Denominação	<p>Campo <b>não</b> deve ser preenchido quando a ponta do contrato for Curva VCP e Tipo/Classe 73 (Estratégia).</p> <p>Descrição do parâmetro escolhido como VCP para a(s) curva(s) do(s) Participante e da Contraparte, caso seja(m) do tipo VCP.</p> <p>Texto livre com 320 posições.</p> <p>Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo "Tipo/Classe". Para maiores consultar a seção "Consulta Tipo Classe".</p>
<p><b>Cupom Limpo/Data Cotação - Parte/Contraparte – Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</b></p>	
Cupom Limpo	<p>Campo utilizado para Índice Ibovespa, Moedas e VCP.</p> <p>Cotação inicial informada pelas partes para valorização da curva do contrato.</p> <p>Caso não seja informada a cotação inicial, será utilizada a cotação capturada automaticamente pelo Módulo conforme indicado no campo "Data de Cotação".</p> <p>Nos casos em que a cotação inicial será diferente daquela capturada automaticamente pelo Módulo, esta deve ser indicada exclusivamente por meio deste campo, não devendo ser informada no campo "Denominação".</p>
Data de Cotação	<p>Data de Cotação a ser utilizada no <b>início</b> e no <b>vencimento</b> do contrato.</p> <p>Para <b>curvas calculadas</b>, são permitidas 3 (três) opções de datas de cotação: D-1, D-2 e D-3. Não preencher se curva escolhida for IPCA.</p> <p>Para <b>curvas VCP</b>, são permitidas 5 (cinco) opções de datas de cotação: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.</p> <p>Caso a Data de Cotação seja D0, indicar esta informação no campo "Denominação", não sendo permitido a indicação no campo "Data de Cotação".</p>
<p><b>EXCLUSIVO PARA CURVA LIBOR - Parte/Contraparte – Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Libor.</b> Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p>	
Data de Cotação - Libor	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>São as opções disponíveis para captura da Taxa Libor.</p>

	Caixa de Seleção com 5 opções de datas: Data do Evento, D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5 do evento.
Variação Cambial	São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à Taxa Libor. Caixa de Seleção com as opções: <b>DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA e VCP</b> . Preenchimento obrigatório.
Tipo Classe	Caixa de seleção com as opções: US\$ Austrália, US\$ Canada e Franco Suíço.
Data de Cotação – Variação Cambial	Data da Cotação - Variação Cambial da Parte. As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda. Possíveis Valores: <b>01</b> (D-1), <b>02</b> (D-2), <b>03</b> , (D-3), <b>04</b> (D-4), <b>05</b> (D-5).
Cupom Limpo/Outros - Cotação	Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes. Somente deve ser preenchido: Se desejar utilizar o <b>Cupom Limpo</b> para uma das opções de variação cambial: <b>DÓLAR, EURO, IENE</b> ou <b>LIBRA</b> ; Cotação inicial da moeda quando indicada a opção <b>VCP</b> para variação cambial.
Alíquota IR	Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros ou vencimento do contrato.
Limite Inferior (Floor)	Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.  Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.  Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.
Limite Superior (Cap)	Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.  Taxa arbitrada como Limite Superior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.  Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.
<b>EXCLUSIVO PARA TAXA JUROS MERCADO INTERNACIONAL - Parte/Contraparte - Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Taxa Juros Mercado Internacional.</b>	
Taxa Juros	Campo de preenchimento obrigatório.

	Taxa de Juros informada para o período determinado no campo <b>Troca de Fluxo</b> . Informar com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.
Variação Cambial	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à TJMI. As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: <b>DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA e VCP</b>.</p>
Tipo Classe	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: US\$ Austrália, US\$ Canada e Franco Suíço.</p>
Cupom Limpo / Outros - cotação	<p>Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes. Somente deve ser preenchido:</p> <p>Se desejar utilizar o <b>Cupom Limpo</b> para uma das opções de variação cambial: <b>DÓLAR, EURO, IENE</b> ou <b>LIBRA</b>;</p> <p>Cotação inicial da moeda quando indicada a opção <b>VCP</b> para variação cambial.</p>
Alíquota IR	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros ou vencimento do contrato.</p>
Limite Inferior (Floor) - Perc.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.</p> <p>Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
Limite Superior (Cap) - Perc.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Superior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.</p> <p>Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
<b>EXCLUSIVO PARA COMMODITY - Parte/Contraparte</b>	
Cotação Inicial	Campo de preenchimento obrigatório.



	Cotação Inicial da Parte/Contraparte.
Código da Commodity	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código da Commodity da Parte/Contraparte.</p> <p>Esse campo deverá ser preenchido através do RIC. Esta informação já existe nos arquivos públicos relacionados à Mercadoriarics.</p>
Média Asiática Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Branco (quando opção não for Asiática), SIMPLES ou PONDERADA.</p>
Data da Cotação para Ajustes	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Data de Cotação para Ajuste da Parte/Contraparte. Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 5 (D-5).</p> <p>Dentre as opções disponíveis, a que for selecionada também será considerada para o cálculo da cotação da moeda atrelada à mercadoria.</p>
<b>Funcionalidades - Campos exclusivos Trigger in / Trigger out – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.</b>	
Parte / Contraparte	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Define a Parte/Contraparte do Trigger. Caixa de Seleção com as Opções: Parte e Contraparte.</p>
Fator / Valor / Taxa	<p>Magnitude do parâmetro que determina a efetivação (Trigger In) ou rescisão (Trigger Out) do Swap. Informado com até 8 (oito) inteiros e 8 (oito) decimais.</p> <p>Fator - informar com 8 (oito) casas decimais, se parâmetro informado for <b>IGP-M, IGP-DI, INPC, TR</b> ou qualquer outro parâmetro aceito como trigger, cuja verificação seja final.</p> <p>Taxa - informar com 2 (duas) casas decimais, se parâmetro informado for <b>DI, SELIC</b> ou <b>TJLP</b>.</p> <p>Valor - informar com 4 (quatro) casas decimais, se parâmetro informado for <b>Dólar, Dólar Comercial Exponencial</b> ou <b>Ouro</b>. Informar com 5 (cinco) decimais, se parâmetro informado for <b>Franco Suíço</b> ou <b>Euro</b>. Informar com 6 (seis) decimais, se parâmetro informado for <b>Iene</b> ou <b>Peso Mexicano</b>. Informar com 8 (oito) decimais, se parâmetro informado for <b>Ibovespa de Liquidação</b>.</p>
Verificação	<p>Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Diária e Final. Consulte Capítulo Informações Adicionais – Item <i>Contratos com Funcionalidades</i>.</p>
<b>Titular da Funcionalidade / Prêmio – Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</b>	
Titular	<p>Define se o titular é a Parte ou a Contraparte. Indica o Participante que pagará o prêmio.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Parte e Contraparte.</p>

**Prêmio (1) de Funcionalidade – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.**

Valor (R\$)	Valor do prêmio. Pode ser informado como “0” (zero).
Rebate (R\$)	Define o valor da devolução do prêmio, pago no registro, ao titular do contrato, caso o contrato vença e não seja efetivado ou rescindido. O valor do rebate pode ser menor, igual ou maior que o valor do prêmio de funcionalidade.  Pode ocorrer desde que, até a data de vencimento, não dispare o <b>Trigger de Knock In</b> ou dispare o <b>Trigger de Knock Out</b> .  Válido somente para as funcionalidades: Knock In; Knock Out; Knock In-Out; e Knock Out com Opção de Arrendimento.
Liquidação do Rebate	Caixa de Seleção com as opções Vencimento, Trigger Out e Após Número de Dias.
Dias Úteis Após o Trigger Out	Identifica a quantidade de dias úteis, após ocorrer o Knock Out, que é pago o Rebate.  Não pode ultrapassar o dia do vencimento original do Swap.

**Prêmio (2) de Funcionalidade – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.**

Valor (R\$)	Valor do prêmio. Pode ser informado como “0” (zero).
Data Exercício	Data em que o titular paga prêmio para exercer a opção de permanência no contrato.  Preencher somente para a modalidade Compound Swaption.

**Observações:**

- a) O campo **Juros (% aa)**, quando a curva selecionada for **Prefixada 252 d** ou **Prefixada 360 d** permite o preenchimento com a informação menor, igual ou maior que zero.
- b) As solicitações de cadastramento para novas opções de informações nos campos tipo "Combo Box" devem ser enviadas para a Área Operacional da Cetip através do e-mail opesp@cetip.com.br
- c) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.

**Tela Registro de Pagamento de Prêmio****Registro de Pagamento de Prêmio**

Código do Contrato	<input type="text" value="14K00079310"/>
Forma de Pagamento	<input type="text" value="DEFINIR FLUXO"/> ▼
Quantidade de Prêmios	<input type="text" value="2"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Nos contratos com previsão de Agenda de Prêmios e/ou Reset é apresentado a tela para **Registro de Pagamento de Prêmio**.

Para maiores informações sobre o **Pagamento de Prêmio** acesse o tópico **Registro de Pagamento de Prêmio**.

### Tela Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

**Registro de Parâmetros para Disparo de Reset**

Código do Contrato

Forma de Disparo

Quantidade de Datas

Ao clicar no botão **Prosseguir** (tela de Registro de Contrato), em contratos com previsão de Agenda de Prêmios e/ou Reset, o sistema exibe tela para que o Participante informe os Parâmetros de Reset.

Se o Participante não desejar informar os parâmetros do Reset nesse momento e clicar no botão **Desistir**, posteriormente deve realizar essa operação através da função **Registro de Parâmetros para Disparo de Reset**.

Se no registro do contrato o Participante informar que há Reset, mas não informá-lo até o horário de fechamento da grade **Sem Modalidade** neste mesmo dia, o registro desse contrato é cancelado.

Para maiores informações sobre **Parâmetros de Reset** acesse o tópico **Registro de Parâmetros para Disparo de Reset**.

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	Sim

## Registro de Contrato - Fluxo Constante

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Contrato – Fluxo Constante

### Visão Geral

Através desta função, o Participante pode registrar um contrato de fluxo de pagamentos periódicos.

**Observação:** Para as curvas Prefixado 252du, Prefixado 360 d, DI, TJMI e Libor há a possibilidade de indicação de limitadores, inferior e superior, para cada uma das datas de pagamento de diferencial para os contratos de Swap Fluxo de Caixa Constante e Não Constante.

### Tela Registro de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Registro de Contrato - Fluxo de Caixa Constante			
Parte	Contraparte	CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Meu Número			
<input type="text"/>			
Características			
Data Início	Data Vencimento	Adesão a Contrato	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Valor Base	Agenda de Prêmio	Código Estratégia	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
	Amortiza sem troca de diferencial	Codigo Identificador	
	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Exclusivo para Contrato à Termo			
Data Operação	Índice Termo	Perc. Termo	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Se Índice Termo			
PU Inicial/Cupom Limpo	Data de Cotação Final - Termo	Tipo/Classe	Denominação
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
FLUXO DE JUROS e AMORTIZAÇÕES			
Juros a cada	Período	Data Início Pagto Juros	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Amort a cada	Período	Data Início Pagto Amort.	Tipo Amortização
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

(continua)

Curvas para Atualização					
Parte			Contraparte		
Percentual [ ] , [ ]	Categoria [ ]		Percentual [ ] , [ ]	Categoria [ ]	
Curva [ ]	+/- [ ]		Curva [ ]	+/- [ ]	
Juros(% aa) [ ] , [ ]	Lim. Inferior (Floor) [ ] , [ ]		Juros(% aa) [ ] , [ ]	Lim. Inferior (Floor) [ ] , [ ]	
Lim. Superior (Cap) [ ] , [ ]			Lim. Superior (Cap) [ ] , [ ]		
Se Curva(s) = "VCP":					
Parte			Contraparte		
PU [ ] , [ ]	Tipo/Classe [ ]		PU [ ] , [ ]	Tipo/Classe [ ]	
Denominação [ ]			Denominação [ ]		
Cupom Limpo/Data Cotação					
Parte			Contraparte		
Cupom Limpo [ ] , [ ]	Data de Cotação [ ]		Cupom Limpo [ ] , [ ]	Data de Cotação [ ]	
Exclusivo para curva "Libor"					
Parte			Contraparte		
Data de Cotação - Libor [ ]	Variação Cambial [ ]		Data de Cotação - Libor [ ]	Variação Cambial [ ]	
Tipo Classe [ ]	Data da Cotação - Variação Cambial [ ]		Tipo Classe [ ]	Data da Cotação - Variação Cambial [ ]	
Cupom Limpo / Outros - Cotação [ ] , [ ]	Alíquota IR [ ] , [ ]		Cupom Limpo / Outros - Cotação [ ] , [ ]	Alíquota IR [ ] , [ ]	
Limite Inferior (Floor) - Perc. [ ] , [ ]	Limite Superior (Cap) - Perc. [ ] , [ ]		Limite Inferior (Floor) - Perc. [ ] , [ ]	Limite Superior (Cap) - Perc. [ ] , [ ]	
Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional"					
Parte			Contraparte		
Taxa Juros [ ] , [ ]	Troca de Fluxo [ ]		Taxa Juros [ ] , [ ]	Troca de Fluxo [ ]	
Variação Cambial [ ]	Tipo Classe [ ]		Variação Cambial [ ]	Tipo Classe [ ]	
Cupom Limpo / Outros - Cotação [ ] , [ ]	Alíquota IR [ ] , [ ]		Cupom Limpo / Outros - Cotação [ ] , [ ]	Alíquota IR [ ] , [ ]	
Limite Inferior (Floor) - Perc. [ ] , [ ]	Limite Superior (Cap) - Perc. [ ] , [ ]		Limite Inferior (Floor) - Perc. [ ] , [ ]	Limite Superior (Cap) - Perc. [ ] , [ ]	
Exclusivo para Commodity					
Parte			Contraparte		
Cotação Inicial [ ] , [ ]	Codigo da Commodity [ ]	Data da Cotação para Ajuste [ ]	Cotação Inicial [ ] , [ ]	Codigo da Commodity [ ]	Data da Cotação para Ajuste [ ]
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>					

(fim)

Ao selecionar o botão **Enviar**, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão **Confirmar**, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o contrato está aguardando lançamento da contraparte. Nesta tela são exibidos os botões **Prosseguir**, que dá continuidade ao registro, e **Desistir**, que cancela a operação.

## Exemplo - Contrato aguardando lançamento de contraparte

### Registro de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Registro do contrato 14K00079315 sob o No. CETIP 2014111417128790 aguardando lançamento da contraparte  
Clique em 'PROSSEGUIR' para informar os eventos de pagamento de prêmio



Clicando no botão **Prosseguir**, o sistema apresenta tela para que o Participante faça o registro de pagamento de prêmio (detalhado abaixo).

### Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato

Campo	Descrição
Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro que está registrando o contrato. Conta deve ser do tipo 00, 10, 20 ou 70 a 88.
Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro com quem é efetuado o contrato. Conta deve ser do tipo 00, 10, 20 ou 70 a 88.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído à operação de registro. Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.
CPF/CNPJ Cliente Parte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Identificação do Cliente do Participante. Há necessidade do matching das informações.
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Identificação do Cliente da Contraparte. Há necessidade do matching das informações

### CARACTERÍSTICAS- Características básicas do contrato, pertinentes à qualquer tipo de fluxo de caixa.

Data Início	Campo de preenchimento obrigatório. Data a partir da qual as curvas do contrato passam a ser atualizadas. Não pode ser menor do que a Data Operação, exceto quando operação realizada com Cliente 1, limitado a D-2.
-------------	---

Campo	Descrição
Data Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data de vencimento do contrato de Swap. Deve ser maior que Data Início.</p> <p>O período máximo é de 9.999 dias úteis a partir da data informada em "Data Início".</p>
Adesão a Contrato	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: CGD, CGD/CSA, CSA ou Sem Adesão. Indica a existência, ou não, de adesão a contrato padronizado de Derivativos.</p>
Valor Base	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor Base inicial da operação a partir do qual os parâmetros definidos para o contrato ou para a correção das operações a termo irão incidir. Em R\$ (14 inteiros e 2 decimais).</p>
Agenda de Prêmio	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar se no contrato que está sendo registrado terá o pagamento de prêmio. Caixa de Seleção com as opções: <b>Vazio, SIM e NÃO.</b></p>
Código Estratégia	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informar o código da estratégia, cadastrada e habilitada para o Participante pela Cetip, que se deseja vincular ao contrato.</p>
Amortiza sem troca de diferencial	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Sim ou Não.</p> <p>Quando Seleccionada a opção Sim, se uma das curvas for moeda ou índice de preços registrar a(s) mesma(s) como VCP.</p>
Código Identificador	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Código de controle interno do participante.</p>
<b>Exclusivo para Contrato à Termo</b>	
Data Operação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Data início da operação a termo. Pode ser a própria data de registro ou D-2 da data de registro, se for com cliente 1.</p> <p>Não há limite de prazo para o período a termo.</p>

Campo	Descrição
Índice Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso este campo não esteja preenchido, o sistema deve considerar que o Valor Base <b>não</b> será corrigido, a partir da Data Operação (que deve estar preenchida) até a Data Início do contrato de Swap. Os participantes pactuam um único índice para atualização do Valor Base.</p> <p>Para que o sistema atualize o valor base quando indicada a opção <b>VCP</b>, o participante deve utilizar a função <b>Atualização de PU/Fator</b>.</p> <p>Indica o parâmetro com o qual deve ser atualizado o Valor Base inicial, a partir da Data Operação até a data do contrato de Swap, exclusive.</p> <p>Indexadores permitidos para atualização do Valor Base, quando contrato a termo: DI; Selic; Dólar; EURO/COM.EUROPEIA, EURO-BCE, Iene; Libra; FRANCO SUÍÇO BCE e VCP.</p> <p><b>Observações:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>➤ No registro retroativo de contrato a termo com Cliente 1, não é permitido índice termo quando data de registro maior que data de início do contrato.</li> <li>➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 978)</li> <li>➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)</li> <li>➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)].</li> </ul>
Perc. Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório se o campo <b>Índice Termo</b> for informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais.</p> <p>Valor percentual do Índice Termo que corrige o Valor Base inicial.</p>
<b>Se Índice Termo</b>	
PU Inicial/Cupom Limpo	<p>Campo deve ser preenchido apenas na data de registro do Swap.</p> <p>Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser <b>00 - VCP</b>.</p> <p>No caso de Swap à Termo, só deve ser preenchido quando <b>Índice Termo</b> for VCP, DOLAR ou EURO.</p> <p>PU inicial para atualização do Valor Base. O Participante deve informar o PU que servirá para iniciar a atualização do valor base do contrato a termo.</p> <p>Cupom Limpo, exclusivo para utilização em caso de índice Termo = dólar.</p> <p>Utilizado para informar o valor da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor inicial para valorização da curva do contrato quando código de registro igual a Dólar (Cupom Limpo).</p>



Campo	Descrição
Data de Cotação Final – Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório para quando o campo “Índice termo” seja qualquer moeda disponível em seu domínio.</p> <p>Utilizado para informar o deslocamento da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor final para valorização da curva do contrato quando índice termo for moeda.</p> <p>Possíveis valores: (01) D-1; (02) D-2; (03) D-3; (04) D-4; (05) D-5;</p>
Tipo/Classe	<p>Campo de preenchimento obrigatório exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser <b>00 - VCP</b>.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções descritas o tópico Consulta de Tipo de Classe. Não é permitida a indicação de Tipo/Classe 73 (Estratégia).</p> <p>Tipo do Índice <b>VCP</b> que atualiza o Valor Base do contrato a termo.</p>
Denominação	<p>Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser <b>00 - VCP</b>.</p> <p>Texto livre com 320 posições. Há necessidade de <i>matching</i> das informações. Descrição do parâmetro escolhido como <b>VCP</b> para atualização do Valor Base do contrato a termo.</p> <p>Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo “Tipo/Classe”. Para maiores consultar a seção “Consulta Tipo Classe”.</p>
<p><b>FLUXO DE JUROS E AMORTIZAÇÕES - Periodicidade e Datas iniciais das trocas de fluxo de caixa * Ver observação no final dessa Tabela</b></p>	
Juros a cada	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo numérico com até 10 dígitos numéricos. Periodicidade do pagamento de juros, expressa no formato definido no campo <b>Período</b>.</p>
Período	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com 3 formatos de informação: Dias Úteis, Dias Corridos e Meses. Prazo mínimo em dias úteis - 1 dia. Prazo mínimo em dias corridos - 5 dias.</p>
Data Início Pagto Juros	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Define a data do primeiro pagamento de juros, que pode ter ocorrido antes do registro do contrato. Tendo como data limite anterior 01/01/2004.</p>
Amortização a cada	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Periodicidade da amortização, expressa no formato definido no campo <b>Período</b>. Até 10 dígitos numéricos.</p>
Período	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: <b>Dias Úteis, Dias Corridos, Meses, Na Data de Vencimento e Sem troca de amortização</b>. Prazo mínimo em dias úteis - 1 dia. Prazo mínimo em dias corridos - 5 dias.</p>

Campo	Descrição
Data Início Pagto Amort.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Define a Data da primeira troca de amortização.</p> <p>Embora admitidos fluxos diferentes entre troca de principal e de juros, as datas dos eventos de troca de principal, quando houver, devem ser coincidentes com as datas de trocas de juros. Será efetuado primeiramente o cálculo dos juros, e somente depois o cálculo das amortizações.</p>
Tipo Amortização	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Indica o tipo de amortização escolhido. Caixa de Seleção com as opções: <b>Vazio</b>, <b>Sobre valor Base original (valor base da data do início do contrato)</b> ou <b>Sobre valor Base Remanescente (valor base original decrescido das amortizações já efetuadas)</b>.</p>
<p><b>CURVAS PARA ATUALIZAÇÃO - Parte/Contraparte - Curvas do Swap, para atualização conforme os parâmetros definidos - Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.</b></p>	
Percentual	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor percentual do parâmetro com que o participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva.</p> <p>Até 3 inteiros e 2 decimais. O percentual pode ser menor, igual ou maior que 100%, com exceção da curva Libor, havendo ou não taxa de juros. Curvas iguais ou diferentes, inclusive VCP:</p> <p>Se os campos "Curva" forem iguais -&gt; Os campos "Percentual" e/ou "Juros %a.a." deverão ser diferentes; e</p> <p>Não é permitido a indicação dos campos "Curva", "Percentual" e "Juros %a.a." idênticos.</p>
Categoria	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: COMMODITIES, JUROS, JUROS INTERNACIONAIS, TAXAS DE CÂMBIO E VCP.</p>
Curva	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>A caixa de opções abrirá de acordo com a categoria escolhida. A relação de curvas por categoria pode ser consultada no arquivo público "Indexadores Swap".</p>
+ / -	<p>Preencher em conjunto com <b>Juros</b>. Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, Moeda, Libor e TJMI aceitam taxas de juros negativas.</p> <p>Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa.</p>

Campo	Descrição
Juros % a.a.	<p>Preencher em conjunto com <b>Sinal</b>. Informar com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.</p> <p>É a taxa de remuneração que, agregada ao parâmetro, atualiza o Valor Base.</p>
Lim. Inferior (Floor)	<p>Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais. Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o módulo usa o limite para corrigir a curva.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
Lim. Superior (Cap)	<p>Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais. Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o módulo usa o limite para corrigir a curva.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
<b>Se Curva (s) = VCP - Parte/Contraparte</b>	
PU	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando contrato à vista ou decorrido.</p> <p>Define o PU base de valorização da curva referenciada em <b>VCP</b>.</p> <p>Pode ser atualizado pela função <b>Registro de PU / Fator</b> até a data do evento de juros/amortização. Informado com até 6 (seis) números inteiros e 6 (seis) decimais.</p>
Tipo/Classe	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Qualificação da curva <b>VCP</b>. Caixa de Seleção com as opções descritas no tópico Consulta de Tipo de Classe.</p>
Denominação	<p>Campo <b>não</b> deve ser preenchido quando a ponta do contrato for <b>Curva VCP</b> e <b>Tipo/Classe 73</b> (Estratégia).</p> <p>Descrição do parâmetro escolhido como <b>VCP</b> para a(s) curva(s) do(s) Participante e da Contraparte, caso seja(m) do tipo <b>VCP</b>. Texto livre com 320 posições.</p> <p>Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo “Tipo/Classe”. Para maiores consultar a seção “Consulta Tipo Classe”.</p>
<b>Cupom Limpo/Data Cotação - Parte/Contraparte</b>	

Campo	Descrição
Cupom Limpo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Utilizado para Índice Ibovespa, Moedas e VCP.</p> <p>Cotação inicial informada pelas partes para valorização da curva do contrato. Caso não seja informada a cotação inicial, será utilizada a cotação capturada automaticamente pelo Módulo conforme indicado no campo “Data de Cotação”.</p> <p>Nos casos em que a cotação inicial será diferente daquela capturada automaticamente pelo Módulo, esta deve ser indicada exclusivamente por meio deste campo, não devendo ser informada no campo “Denominação”.</p>
Data de Cotação	<p>Campo de preenchimento obrigatório para <b>curvas calculadas e VCP</b>, independentemente da indicação de “Cupom Limpo”.</p> <p>Data de Cotação a ser utilizada no <b>início</b> e no <b>vencimento</b> do contrato.</p> <p>Para <b>curvas calculadas</b>, são permitidas 3 (três) opções de datas de cotação: D-1, D-2 e D-3.</p> <p>Para <b>curvas VCP</b>, são permitidas 5 (cinco) opções de datas de cotação: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.</p> <p>Caso a Data de Cotação seja D0, indicar esta informação no campo “Denominação”, não sendo permitido a indicação no campo “Data de Cotação”.</p>
<b>EXCLUSIVO PARA CURVA LIBOR - Parte/Contraparte</b>	
<b><i>Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Libor</i></b>	
Data da Cotação - Libor	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Define a data da cotação da taxa Libor a ser utilizada no evento. Sua cotação será disponibilizada pelo SISBACEN. Caixa de Seleção com 6 opções de datas de cotação: D, D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5 do evento.</p>
Variação Cambial	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à Taxa Libor.</p> <p>As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda, cotação de D-1. Caixa de Seleção com as opções: <b>Vazio, DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA e VCP</b>.</p>
Tipo classe	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: US\$ Austrália, US\$ Canada e Franco Suíço.</p>
Data da Cotação Variação Cambial	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data da Cotação - Variação Cambial da Parte. Possíveis Valores: <b>01</b> (D-1), <b>02</b> (D-2), <b>03</b>, (D-3), <b>04</b> (D-4), <b>05</b> (D-5).</p>

Campo	Descrição
Cupom Limpo / Outros - cotação	<p>Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes. Somente deve ser preenchido:</p> <p>Se desejar utilizar o <b>Cupom Limpo</b> para uma das opções de variação cambial: <b>DÓLAR, EURO, IENE ou LIBRA</b>;</p> <p>Cotação inicial da moeda quando indicada a opção <b>VCP</b> para variação cambial;</p>
Alíquota IR	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros.</p>
Limite Inferior (Floor) - Perc.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso a Libor seja menor que o valor informado no limite inferior, o sistema utilizará esse valor para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Inferior da Libor apurada para o evento de juros/amortização.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
Limite Superior (Cap) - Perc.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso a Libor seja maior que o valor informado no limite superior, o sistema utilizará esse valor para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Superior da Libor apurada para o evento de juros/amortização.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
<p><b>EXCLUSIVO PARA TAXA JUROS MERCADO INTERNACIONAL - Parte/Contraparte - Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Taxa Juros Mercado Internacional</b></p>	
Taxa Juros	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Taxa de Juros informada para o período determinado no campo <b>Troca de Fluxo</b>.</p>
Troca de Fluxo	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se a taxa informada vale para todas as trocas de fluxo ou se apenas para a primeira troca (neste caso informará as demais taxas para os respectivos fluxos em tela exclusiva).</p> <p>Caixa de Seleção opções: <b>Todas as Trocas de Fluxo e Só para 1ª Troca de Fluxo</b>.</p>

Campo	Descrição
Variação Cambial	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à TJMI.</p> <p>As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: <b>Vazio, DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA e VCP.</b></p>
Tipo classe	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: US\$ Austrália, US\$ Canada e Franco Suíço.</p>
Cupom Limpo / Outros - cotação	<p>Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes. Somente deve ser preenchido:</p> <p>Se desejar utilizar o <b>Cupom Limpo</b> para uma das opções de variação cambial: <b>DÓLAR, EURO, IENE ou LIBRA;</b></p> <p>Cotação inicial da moeda quando indicada a opção <b>VCP</b> para variação cambial;</p>
Alíquota IR	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros, conforme fórmula.</p>
Limite Inferior (Floor) - Perc.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Inferior da TJMI informada para o evento de juros/amortização.</p> <p>Caso a TJMI informada seja menor que o valor definido no campo <b>limite inferior</b>, o sistema utilizará esse valor para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
Limite Superior (Cap) - Perc.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Superior da TJMI informada para o evento de juros/amortização.</p> <p>Caso a TJMI informada seja maior que o valor definido no campo <b>limite superior</b>, o sistema utilizará esse valor para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
<b>EXCLUSIVO PARA COMMODITY - Parte/Contraparte</b>	
Cotação Inicial	Campo de preenchimento obrigatório. Cotação Inicial da Parte.

Campo	Descrição
Código da Commodity	Campo de preenchimento obrigatório. Código da Commodity da Parte. Esse campo deverá ser preenchido através do RIC. Esta informação já existe nos arquivos públicos relacionados à Mercadorias.
Data da Cotação para Ajuste	Campo de preenchimento obrigatório. Data de Cotação para Ajuste da Parte. Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5). Dentre as opções disponíveis, a que for selecionada também será considerada para o cálculo da cotação da moeda atrelada à mercadoria.

### Telas Registro de Pagamento de Prêmio

**Registro de Pagamento de Prêmio**

Código do Contrato

Forma de Pagamento  ▾

Quantidade de Prêmios

Após clicar no botão **Prosseguir** (tela Registro de Contrato), o sistema exibe a tela para que o Participante registre o pagamento de prêmio. Através desta função, é possível inserir a quantidade de prêmios e a forma como serão pagos.

Para maiores informações sobre **Pagamento de Prêmio** acesse o tópico **Registro de Pagamento de Prêmio**.

## Registro de Contrato - Fluxo Não Constante

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Contrato – Fluxo não Constante

### Visão Geral

Está função permite o registro de um contrato de fluxo de pagamentos não periódicos.

Logo após a confirmação do lançamento, o sistema apresenta tela para que o Participante possa informar as datas e taxas de troca de fluxo, se neste momento, não desejar efetuar esse lançamento, o Participante pode lançar posteriormente acessando a função **Registro de Fluxo de Caixa Não Constante**. O lançamento na tela de registro de fluxo de caixa não constante deve ser feito na mesma data do registro do contrato, obedecendo ao horário de fechamento da **grade Sem Modalidade**. A falta de lançamento do registro do fluxo de caixa não constante até o horário de fechamento da grade **Sem Modalidade** implica no cancelamento do registro inicial deste contrato.

**Observação:** Para as curvas Prefixado 252du, Prefixado 360 d, DI 360d, DI, TJMI e Libor há a possibilidade de indicação de limitadores, inferior e superior, para cada uma das datas de pagamento de diferencial para os contratos de Swap Fluxo de Caixa Constante e Não Constante.

### Tela Registro de Contrato - Fluxo de Caixa Não Constante

Registro de Contrato - Fluxo de Caixa Não Constante			
Parte	Contraparte	CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Meu Número	<input type="text"/>		
<input type="text"/>			
Características			
Data Início	Data Vencimento	Adesão a Contrato	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Valor Base	Agenda de Prêmio	Código Estratégia	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
	Amortiza sem troca de diferencial	Codigo Identificador	
	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Exclusivo para Contrato à Termo			
Data Operação	Índice Termo	Perc. Termo	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Se Índice Termo			
PU Inicial/Cupom Limpo	Data de Cotação Final - Termo	Tipo/Classe	Denominação
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

(continua)



Curvas para Atualização					
Parte			Contraparte		
Percentual [ ] , [ ]	Categoria [ ]		Percentual [ ] , [ ]	Categoria [ ]	
Curva [ ]	+/- [ ]		Curva [ ]	+/- [ ]	
Juros(% aa) [ ] , [ ]	Lim. Inferior (Floor) [ ] , [ ]		Juros(% aa) [ ] , [ ]	Lim. Inferior (Floor) [ ] , [ ]	
Lim. Superior (Cap) [ ] , [ ]			Lim. Superior (Cap) [ ] , [ ]		
Se Curva(s) = "VCP":					
Parte			Contraparte		
PU [ ] , [ ]	Tipo/Classe [ ]		PU [ ] , [ ]	Tipo/Classe [ ]	
Denominação [ ]			Denominação [ ]		
Cupom Limpo/Data Cotação					
Parte			Contraparte		
Cupom Limpo [ ] , [ ]	Data de Cotação [ ]		Cupom Limpo [ ] , [ ]	Data de Cotação [ ]	
Exclusivo para curva "Libor"					
Parte			Contraparte		
Data de Cotação - Libor [ ]	Variação Cambial [ ]		Data de Cotação - Libor [ ]	Variação Cambial [ ]	
Tipo Classe [ ]	Data da Cotação - Variação Cambial [ ]		Tipo Classe [ ]	Data da Cotação - Variação Cambial [ ]	
Cupom Limpo / Outros - Cotação [ ] , [ ]	Alíquota IR [ ] , [ ]		Cupom Limpo / Outros - Cotação [ ] , [ ]	Alíquota IR [ ] , [ ]	
Limite Inferior (Floor) - Perc. [ ] , [ ]	Limite Superior (Cap) - Perc. [ ] , [ ]		Limite Inferior (Floor) - Perc. [ ] , [ ]	Limite Superior (Cap) - Perc. [ ] , [ ]	
Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional"					
Parte			Contraparte		
Taxa Juros [ ] , [ ]	Troca de Fluxo [ ]		Taxa Juros [ ] , [ ]	Troca de Fluxo [ ]	
Variação Cambial [ ]	Tipo Classe [ ]		Variação Cambial [ ]	Tipo Classe [ ]	
Cupom Limpo / Outros - Cotação [ ] , [ ]	Alíquota IR [ ] , [ ]		Cupom Limpo / Outros - Cotação [ ] , [ ]	Alíquota IR [ ] , [ ]	
Limite Inferior (Floor) - Perc. [ ] , [ ]	Limite Superior (Cap) - Perc. [ ] , [ ]		Limite Inferior (Floor) - Perc. [ ] , [ ]	Limite Superior (Cap) - Perc. [ ] , [ ]	
Exclusivo para Commodity					
Parte			Contraparte		
Cotação Inicial [ ] , [ ]	Codigo da Commodity [ ]	Data da Cotação para Ajuste [ ]	Cotação Inicial [ ] , [ ]	Codigo da Commodity [ ]	Data da Cotação para Ajuste [ ]
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>					

(fim)

Ao selecionar o botão **Enviar**, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência.

Após clicar no botão **Confirmar**, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o contrato está aguardando lançamento da contraparte. Nesta tela é exibido os botões **Prosseguir**, que dá continuidade ao registro, e **Desistir**, que cancela a operação.

Clicando no botão **Prosseguir**, sistema exibe tela para que o Participante faça o registro de pagamento de prêmio (detalhado abaixo).

**Observação para o preenchimento:**

Os campos abaixo podem ser informados na tela de **registro de contrato** de fluxo de caixa não constante ou na tela de **registro de fluxo** de caixa não constante:

- 1 - +/-
- 2 - Juros (% aa)
- 3 - Limite inferior (Floor) - Perc
- 4 - Limite superior (Cap) - Perc

Os valores informados na tela de registro de contrato tem validade para todo o fluxo, não podendo ser informados na tela de registro de fluxo de caixa.

**Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato - Fluxo de Caixa Não Constante**

Campo	Descrição
Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro que está registrando o contrato. Conta deve ser do tipo 00, 10, 20 ou 70 a 88.
Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro com quem é efetuado o contrato. Conta deve ser do tipo 00, 10, 20 ou 70 a 88.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído à operação de registro. Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.
CPF/CNPJ Cliente Parte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Identificação do Cliente do Participante. Há necessidade do matching das informações.
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Identificação do Cliente da Contraparte. Há necessidade do matching das informações.

**CARACTERÍSTICAS - Características básicas do contrato, pertinentes a qualquer tipo de fluxo de caixa**

Data Início	Campo de preenchimento obrigatório. Data a partir da qual as curvas do contrato passam a ser atualizadas. Não pode ser menor do que a Data Operação, exceto quando operação realizada com Cliente 1, limitado a D-2.
-------------	--

Campo	Descrição
Data Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data de vencimento do contrato de Swap. Deve ser maior que Data Início.</p> <p>O período máximo é de 9.999 dias úteis a partir da data informada em “Data Início”.</p>
Adesão a Contrato	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: CGD, CGD/CSA, CSA ou Sem Adesão. Indica a existência, ou não, de adesão a contrato padronizado de Derivativos.</p>
Valor Base	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor Base inicial da operação a partir do qual os parâmetros definidos para o contrato ou para a correção das operações a termo vão incidir. Em R\$ (14 inteiros e 2 decimais).</p>
Agenda de Prêmio	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se no contrato que está sendo registrado, existe o pagamento de prêmio. Caixa de Seleção com as opções: <b>Vazio, Sim e Não</b>.</p>
Código Estratégia	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informar o código da estratégia, cadastrada e habilitada para o Participante pela Cetip, que se deseja vincular ao contrato.</p>
Amortiza sem troca de diferencial	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Sim ou Não</p> <p>Quando Seleccionada a opção Sim, se uma das curvas for moeda ou índice de preços registrar a(s) mesma(s) como VCP.</p>
Código Identificador	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Código de controle interno do participante.</p>
<b>Exclusivo para Contrato à Termo</b>	
Data Operação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Pode ser a própria data de registro ou D-2 da data de registro, se for com cliente 1. Data início da operação a termo.</p> <p>Não há limite de prazo para o período a termo.</p>

Campo	Descrição
Índice Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso este campo não esteja preenchido, o sistema deve considerar que o Valor Base <b>não</b> será corrigido, a partir da Data Operação (que deve estar preenchida) até a Data Início do contrato de Swap. Os participantes pactuam um único índice para atualização do Valor Base.</p> <p>Para que o sistema atualize o valor base quando indicada a opção <b>VCP</b>, o participante deverá utilizar a função <b>Atualização de PU/Fator</b>.</p> <p>Indica o parâmetro com o qual deve ser atualizado o Valor Base inicial, a partir da Data Operação até a data do contrato de Swap, exclusive.</p> <p>Indexadores permitidos para atualização do Valor Base, quando contrato a termo: DI; Selic; Dólar; EURO/COM.EUROPEIA, EURO-BCE; Iene; Libra, FRANCO SUIÇO BCE e VCP.</p> <p><b>Observações:</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- No registro retroativo de contrato a termo com Cliente 1, não é permitido índice termo quando data de registro maior que data de início do contrato.</li> <li>- EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)</li> <li>- EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220)</li> <li>- FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]</li> </ul>
Perc. Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Valor percentual do Índice Termo que corrige o Valor Base inicial.</p> <p>Deve ser preenchido se o campo <b>Índice Termo</b> for informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais.</p>
<b>Se Índice Termo</b>	
PU Inicial/Cupom Limpo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso não seja preenchido, o Valor Base é atualizado pelo Fator (campo abaixo). Pode ser preenchido apenas na data de registro do Swap.</p> <p>No caso de Swap à Termo, só deve ser preenchido quando <b>Índice Termo</b> for VCP, DOLAR ou EURO.</p> <p>PU inicial para atualização do Valor Base.</p> <p>Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser <b>00 - VCP</b>.</p> <p>Cupom Limpo, exclusivo para utilização em caso de índice Termo = dólar</p> <p>Utilizado para informar o valor da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor inicial para valorização da curva do contrato quando código de registro igual a Dólar (Cupom Limpo).</p> <p><b>Obs.:</b> Na utilização do Índice Termo = dólar, a cotação que é utilizada pelo sistema Cetip é D-1;</p> <p>Para cotação do dólar de correção do termo for diferente de D-1 utilizar Índice termo = VCP</p>

Campo	Descrição
Data de Cotação Final – Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório para quando o campo “Índice termo” seja qualquer moeda disponível em seu domínio.</p> <p>Utilizado para informar o deslocamento da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor final para valorização da curva do contrato quando índice termo for moeda.</p> <p>Possíveis valores: (01) D-1; (02) D-2; (03) D-3; (04) D-4; (05) D-5;</p>
Tipo/Classe	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Tipo do Índice <b>VCP</b> que atualiza o Valor Base do contrato a termo.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções descritas no tópico Consulta de Tipo de Classe. Não é permitida a indicação de Tipo/Classe 73 (Estratégia).</p>
Denominação	<p>Descrição do parâmetro escolhido como <b>VCP</b> para atualização do Valor Base do contrato a termo. Texto livre com 320 posições. Há necessidade do <i>matching</i> das informações.</p> <p>Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo “Tipo/Classe”. Para maiores consultar a seção “Consulta Tipo Classe”.</p>
<p><b>CURVAS PARA ATUALIZAÇÃO - Parte/Contraparte - Curvas do Swap, para atualização conforme os parâmetros definidos</b></p>	
Percentual	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor percentual do parâmetro com que o participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva. Até 3 inteiros e 2 decimais.</p> <p>O percentual pode ser menor, igual ou maior que 100%, com exceção da curva Libor, havendo ou não taxa de juros. Curvas iguais ou diferentes, inclusive VCP:</p> <p>Curvas iguais ou diferentes, inclusive VCP:</p> <p>Se os campos "Curva" forem iguais -&gt; Os campos "Percentual" e/ou "Juros %a.a." deverão ser diferentes; e</p> <p>Não é permitido a indicação dos campos "Curva", "Percentual" e "Juros %a.a." idênticos.</p>
Categoria	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: COMMODITIES, JUROS, JUROS INTERNACIONAIS, TAXAS DE CÂMBIO E VCP.</p>
Curva	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>A caixa de opções abrirá de acordo com a categoria escolhida. A relação de curvas por categoria pode ser consultada no arquivo público “Indexadores Swap”.</p>

Campo	Descrição
+ / -	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Preencher em conjunto com Juros. Somente os registros de contratos pactuados com base no DI e Moeda. Libor e TJMI aceitam também taxas de juros negativas.</p> <p>Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa.</p>
Juros % a.a.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Preencher em conjunto com <b>Sinal</b>. Informar com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.</p> <p>É a taxa de remuneração que, agregada ao parâmetro, atualiza o Valor Base.</p> <p>Se o valor do “Juros% a.a.” for igual para todos os fluxos: informá-lo na tela de Registro do contrato.</p> <p>Se o valor do “Juros% a.a.” <b>não</b> for igual para todos os fluxos: informá-lo exclusivamente na agenda de eventos para os respectivos vencimentos na tela de fluxo não constante.</p>
Limite Inferior (Floor)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
Limite Superior (Cap)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Superior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
<b>Se Curva (s) = VCP - Parte/Contraparte</b>	

Campo	Descrição
PU	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando contrato à vista ou decorrido. Pode ser atualizado pela função <b>Registro de PU / Fator</b> até a data do evento de juros/amortização. Informado com até 6 (seis) números inteiros e 6 (seis) decimais.</p> <p>Define o PU base de valorização da curva referenciada em <b>VCP</b>.</p>
Tipo/Classe	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Qualificação da curva <b>VCP</b>. Caixa de Seleção com as opções descritas no tópico Consulta de Tipo de Classe.</p>
Denominação	<p>Campo <b>não</b> deve ser preenchido quando a ponta do contrato for Curva VCP e Tipo/Classe 73 (Estratégia).</p> <p>Descrição do parâmetro escolhido como VCP para a(s) curva(s) do(s) Participante e da Contraparte, caso seja(m) do tipo VCP. Texto livre com 320 posições.</p> <p>Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo "Tipo/Classe". Para maiores consultar a seção "Consulta Tipo Classe".</p>

#### Cupom Limpo/Data Cotação - Parte/Contraparte

Cupom Limpo	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Utilizado para Índice Ibovespa, Moedas e VCP.</p> <p>Cotação inicial informada pelas partes para valorização da curva do contrato.</p> <p>Caso não seja informada a cotação inicial, será utilizada a cotação capturada automaticamente pelo Módulo conforme indicado no campo "Data de Cotação".</p> <p>Nos casos em que a cotação inicial será diferente daquela capturada automaticamente pelo Módulo, esta deve ser indicada exclusivamente por meio deste campo, não devendo ser informada no campo "Denominação".</p>
Data de Cotação	<p>Data de Cotação a ser utilizada no <b>início</b> e no <b>vencimento</b> do contrato.</p> <p>Para <b>curvas calculadas</b>, são permitidas 3 (três) opções de datas de cotação: D-1, D-2 e D-3. Preenchimento Obrigatório, independentemente da indicação de "Cupom Limpo".</p> <p>Para <b>curvas VCP</b>, são permitidas 5 (cinco) opções de datas de cotação: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5. Preenchimento Obrigatório, independentemente da indicação de "Cupom Limpo".</p> <p>Caso a Data de Cotação seja D0, indicar esta informação no campo "Denominação", não sendo permitido a indicação no campo "Data de Cotação".</p>

#### EXCLUSIVO PARA CURVA LIBOR - Parte/Contraparte - Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Libor

Campo	Descrição
Data da Cotação - Libor	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Define a data da cotação da taxa Libor a ser utilizada no evento. Sua cotação é disponibilizada pelo SISBACEN.</p> <p>Caixa de Seleção com 6 opções de datas de cotação: D, D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5 do evento.</p>
Variação Cambial	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à Taxa Libor.</p> <p>As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda, cotação de D-1. Caixa de Seleção com as opções: <b>Vazio, DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA e VCP.</b></p>
Tipo classe	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: US\$ Austrália, US\$ Canadá e Franco Suíço.</p>
Data da Cotação Variação Cambial	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data da Cotação - Variação Cambial da Parte. Possíveis Valores: <b>01</b> (D-1), <b>02</b> (D-2), <b>03</b>, (D-3), <b>04</b> (D-4), <b>05</b> (D-5).</p>
Cupom Limpo / Outros - cotação	<p>Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes.</p> <p>Somente deve ser preenchido:</p> <p>Se desejar utilizar o <b>Cupom Limpo</b> para uma das opções de variação cambial: <b>DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA;</b> e</p> <p>Cotação inicial da moeda quando indicada a opção <b>VCP</b> para variação cambial.</p>
Alíquota IR	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros.</p>
Limite Inferior (Floor) - Perc.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso a Libor seja menor que o valor informado no limite inferior, o sistema utiliza esse valor para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Inferior da Libor apurada para o evento de juros/amortização.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>



Campo	Descrição
Limite Superior (Cap) - Perc.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso a Libor seja maior que o valor informado no limite superior, o sistema utiliza esse valor para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Superior da Libor apurada para o evento de juros/amortização.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
<b>EXCLUSIVO PARA TAXA JUROS MERCADO INTERNACIONAL - Parte/Contraparte</b>	
<b><i>Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Taxa Juros Mercado Internacional</i></b>	
Taxa Juros	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Taxa de Juros informada para o período determinado no campo <b>Troca de Fluxo</b>. Informar com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.</p>
Troca de Fluxo	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se a taxa informada vale para todas as trocas de fluxo ou se apenas para a primeira troca (neste caso informará as demais taxas para os respectivos fluxos em tela exclusiva).</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: <b>Vazio, Todas as Trocas de Fluxo e Só para 1ª Troca de Fluxo.</b></p>
Variação Cambial	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à TJMI. As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: <b>Vazio, DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA e VCP.</b></p>
Tipo classe	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: US\$ Austrália, US\$ Canadá e Franco Suíço.</p>
Cupom Limpo / Outros - cotação	<p>Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes. Somente deve ser preenchido:</p> <p>Se desejar utilizar o <b>Cupom Limpo</b> para uma das opções de variação cambial: <b>DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA;</b> e</p> <p>Cotação inicial da moeda quando indicada a opção <b>VCP</b> para variação cambial.</p>

Campo	Descrição
Alíquota IR	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros, conforme fórmula.</p>
Limite Inferior (Floor) - Perc.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Inferior da TJMI informada para o evento de juros/amortização.</p> <p>Caso a TJMI informada seja menor que o valor definido no campo <b>limite inferior</b>, o sistema utiliza esse valor para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Quando indicada a opção: <b>Só para 1ª troca de Fluxo</b>, o limite informado vale somente para essa opção. Os limites para as demais trocas devem ser informados na tela de registro de fluxo.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
Limite Superior (Cap) - Perc.	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Superior da TJMI informada para o evento de juros/amortização.</p> <p>Caso a TJMI informada seja maior que o valor definido no campo <b>limite superior</b>, o sistema utiliza esse valor para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Quando indicada a opção: <b>Só para 1ª troca de Fluxo</b>, o limite informado vale somente para essa opção. Os limites para as demais trocas devem ser informados na tela de registro de fluxo.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
<b>EXCLUSIVO PARA COMMODITY - Parte/Contraparte</b>	
Cotação Inicial	Campo de preenchimento obrigatório. Cotação Inicial da Parte/Contraparte.
Código da Commodity	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código da Commodity da Parte/Contraparte. Esse campo deverá ser preenchido através do RIC. Esta informação já existe nos arquivos públicos relacionados à Mercadorias.</p>
Data da Cotação para Ajuste	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data de Cotação para Ajuste da Parte/Contraparte. Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).</p> <p>Dentre as opções disponíveis, a que for selecionada também será considerada para o cálculo da cotação da moeda atrelada à mercadoria.</p>

## Tela Registro Fluxo de Caixa Não Constante

**Registro Fluxo de Caixa - Não Constante**

Parte

Contraparte

Meu Número (Oper Original)

Número de Datas de Eventos

Após clicar no botão **Prosseguir** (tela Registro de Contrato), o sistema exibe tela para que o Participante informe as **Partes**, o **Número da Operação de Registro de Fluxo** e o **Número de Datas de Eventos**.

Não informando o Fluxo de Caixa no mesmo dia do registro um determinado contrato de Swap, obedecendo ao horário de fechamento da grade **Sem Modalidade**, o registro deste contrato é cancelado.

Se o Participante não desejar realizar o fluxo de eventos nesse momento e clicar no botão **Desistir**, posteriormente deve realizar essa operação através da função Registro de Fluxo de Caixa.

Para maiores informações sobre **Fluxo de Caixa** acesse o tópico **Registro de Fluxo de Caixa - Não Constante**.

**Observação:** Existe a limitação de 180 datas de eventos por registro, incluindo o resgate.

## Tela Registro de Pagamento de Prêmio

**Registro de Pagamento de Prêmio**

Código do Contrato

Forma de Pagamento

Quantidade de Prêmios

Após confirmação dos dados da Tela Registro Fluxo de Caixa - Não Constante, o sistema exibe para o Participante, a tela para **Registro de Pagamento de Prêmio**. Através desta função o Participante especifica a quantidade de prêmios e a forma como serão pagos.

Para maiores informações sobre **Pagamento de Prêmio** acesse o tópico **Registro de Pagamento de Prêmio**.

**Observação:** Existe a limitação de 180 datas de eventos por registro, incluindo o resgate.

## Registro Fluxo de Caixa Não Constante

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Fluxo de Caixa não Constante

### Visão Geral

Função necessária para a complementação do registro de contrato com Fluxo não constante, onde o Participante informa as datas e taxas de troca de fluxo, indicando em cada uma delas se a datas informadas referem-se ao Fluxo da Parte ou da Contraparte.

**Observação:** Não informando o Fluxo de Caixa no mesmo dia do registro um determinado contrato de Swap, obedecendo ao horário de fechamento da grade **Sem Modalidade**, o registro deste contrato é cancelado.

### Tela Filtro Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

Parte

Contraparte

Meu Número (Oper Original)

Número de Datas de Eventos

Todos os campos da tela acima são de preenchimento obrigatório.

Nesta tela o Participante deve informar o número de datas de eventos do registro de fluxo de caixa não constante.

## Tela Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

Registro Fluxo de Caixa - Não Constante					
Contrato					
Código IF	Data Início	Data Vencimento			
14K00079316	14/11/2014	14/12/2014			
Código Parte	Código Contraparte	Meu Número (Oper Original)			
05000.00-5	10020.00-1	6			
Parte (Nome Simplificado)	Contraparte (Nome Simplificado)	Papel			
RIOBM	LEMEBM	PONTA 1 ▾			
Curva Parte	Curva Contraparte				
DI	DOLAR DOS EUA				
Tipo Amortização	Meu Número				
Sobre valor Base Original ▾	654				
Fluxo Não Constante Ponta 1					
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
28 / 11 / 2014	▾	, ,	, ,	, ,	50 , ,
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
14/12/2014	▾	, ,	, ,	, ,	50 , ,
Fluxo Não Constante Ponta 2					
Data	+/-	Juros(% aa)			Taxa Amortização
28 / 11 / 2014	▾	, ,			50 , ,
Data	+/-	Juros(% aa)			Taxa Amortização
14/12/2014	▾	, ,			50 , ,
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>					

Após preencher com as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

**Observações:**

- 1) As informações das datas do fluxo não constante da Parte devem coincidir, obrigatoriamente, com as datas do fluxo não constante da Contraparte.
- 2) O campo Data Último Pgto. Juros é utilizada para referenciar a data da Libor do primeiro fluxo que o sistema irá utilizar e encontra-se disponível para preenchimento somente quando uma das pontas do contrato utilizar como parâmetro a curva Libor.
- 3) Existe a limitação de 180 datas de eventos por registro, incluindo o resgate.

### Descrição dos Campos de Tela Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

Campo	Descrição
Papel	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a ponta que está efetuando a atualização. Caixa de Seleção com as opções: <b>Ponta1</b> ou <b>Ponta2</b>.</p>
Tipo de Amortização	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informa sobre qual valor incidirá a amortização. Caixa de Seleção com as opções: <b>Vazio</b>, <b>Sobre o valor Base original (valor base da data do início do contrato)</b>, <b>Sobre o valor Base Remanescente (valor base original decrescido das amortizações já efetuadas)</b>, <b>Na Data de Vencimento</b> e <b>Sem Troca de Amortização</b>.</p>
Meu número	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número atribuído a operação de registro de fluxo de caixa não constante. Número interno de cada participante identificando o lançamento.</p>
Data	<p>Campo de preenchimento obrigatório. Data em que ocorrerá o evento.</p>
+/-	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Preencher em conjunto com <b>Juros</b>. Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, Dólar, Libor e TJMI aceitam taxas de juros negativas.</p> <p>Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa.</p>
Taxa Juros	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Informar com até 3(três) números inteiros e 4(quatro) decimais. Taxa de Juros informados para o evento.</p> <p>É possível informar taxas de juros diferentes para cada data de evento, independentemente da curva utilizada (calculadas ou VCP). Para isso, o campo "Juros % a.a." na primeira tela de registro, das características gerais do contrato, não deve ser preenchido (caso preenchido, o sistema irá adotar a taxa informada nele para todos os eventos).</p>
Lim. Inferior	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso a Libor ou TJMI seja menor que o valor informado no limite inferior, o sistema utiliza esse valor para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Inferior da Libor apurada ou TJMI informada para o evento de juros/amortização.</p> <p>Uso exclusivo para DI, Libor e TJMI. Para DI, o limite inferior pode ser informado com até oito inteiros e oito casas decimais; Para Libor e TJMI, o limite deve ser informado com até três inteiros e cinco casas decimais.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item "Contratos com limitador", em "Informações Adicionais".</p>

Campo	Descrição
Lim. Superior	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso a Libor ou TJMI seja maior que o valor informado no limite superior, o sistema utiliza esse valor para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Superior da Libor apurada ou TJMI informada para o evento de juros/amortização.</p> <p>Uso exclusivo para DI, Libor e TJMI. Para DI, o limite superior pode ser informado com até oito inteiros e oito casas decimais; Para Libor e TJMI, o limite deve ser informado com até três inteiros e cinco casas decimais.</p> <p>Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.</p>
Taxa Amortização	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Percentual de amortização a ser aplicado conforme opção escolhida no campo <b>Tipo Amortização</b>. Informar com até 3(três) inteiros e 5(cinco) decimais.</p> <p>Se o <b>Tipo Amortização</b> escolhida for <b>Sobre o valor Base Original</b>, a soma das taxas informadas deverá ser igual a 100%.</p>

## Tela - Confirmação Fluxo de Caixa - Não Constante

## Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

## Contrato

<b>Código IF</b>	<b>Data Início</b>	<b>Data Vencimento</b>
14K00079317	14/11/2014	14/12/2014
<b>Código Parte</b>	<b>Código Contraparte</b>	<b>Meu Número (Oper Original)</b>
05000.00-5	10020.00-1	1111
<b>Parte (Nome Simplificado)</b>	<b>Contraparte (Nome Simplificado)</b>	<b>Papel</b>
RIOBM	LEMEBM	PONTA 1
<b>Curva Parte</b>	<b>Curva Contraparte</b>	
DI	DOLAR DOS EUA	
<b>Tipo Amortização</b>	<b>Meu Número</b>	
Sobre valor Base Original	1111	

## Fluxo Não Constante Ponta 1

<b>Data</b>	<b>+/-</b>	<b>Juros(% aa)</b>	<b>Lim. Inferior</b>	<b>Lim. Superior</b>	<b>Taxa Amortização</b>
28/11/2014					50,00000
<b>Data</b>	<b>+/-</b>	<b>Juros(% aa)</b>	<b>Lim. Inferior</b>	<b>Lim. Superior</b>	<b>Taxa Amortização</b>
14/12/2014					50,00000

## Fluxo Não Constante Ponta 2

<b>Data</b>	<b>+/-</b>	<b>Juros(% aa)</b>	<b>Taxa Amortização</b>
28/11/2014			50,00000
<b>Data</b>	<b>+/-</b>	<b>Juros(% aa)</b>	<b>Taxa Amortização</b>
14/12/2014			50,00000



## Registro de Fluxo de Datas de Verificação

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Fluxo de Datas de Verificação

### Visão Geral

Esta função é utilizada quando for aplicada **média asiática** (simples ou ponderada) para o cálculo do valor financeiro da operação.

### Tela de Registro de Data de Verificação

**Registro de Data de Verificação**

Parte	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
ContraParte	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Meu Número (Oper Original)	<input type="text"/>		
Quantidade de Datas de Verificação Parte	<input type="text"/>		
Quantidade de Datas de Verificação ContraParte	<input type="text"/>		

### Descrição dos Campos da Tela Registro de Data de Verificação

Campo	Descrição
Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, registrando o contrato.
Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro com quem é efetuado o contrato.
Meu número (Oper Original)	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído à operação. Número interno de cada Participante, identificando o lançamento. Preenchimento obrigatório.
Quantidade de Datas de Verificação Parte	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Quantidade de Datas de Verificação Parte. Utilizada somente quando for aplicada média asiática (simples ou ponderada). Informado com até 3 (três) inteiros.
Quantidade de Datas de Verificação Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Quantidade de Datas de Verificação Contraparte. Utilizada somente quando for aplicada média asiática (simples ou ponderada). Informado com até 3 (três) inteiros.

Após confirmação, aparece a tela abaixo onde o participante coloca as **datas e pesos**.

Registro de Data de Verificação		
Contrato		
Código IF	Data Início	Data Vencimento
14K00079316	14/11/2014	14/12/2014
Código Parte	Código Contraparte	Meu Número (Oper Original)
05000.00-5	10020.00-1	6
Parte (Nome Simplificado)	Contraparte (Nome Simplificado)	Papel
RIOBM	LEMEBM	PONTA 1
Curva Parte	Curva Contraparte	Meu Número
DI	DOLAR DOS EUA	<input type="text"/>
Ponta 1	Ponta 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 Registro de Data de Verificação**

<b>Campo</b>	<b>Descrição</b>
<b>Contrato</b>	
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído à operação.
<b>Ponta 1</b>	
Data de Verificação	Campo de preenchimento obrigatório quando for escolhido Média Asiática.  É exibido na tela as datas de referência para avaliação e posterior apuração do valor financeiro do SWAP. Devem ser indicadas, pelo menos, duas datas de verificação.
Pesos (%)	Campo de preenchimento obrigatório quando a média asiática for ponderada. Caso a média seja simples, os campos de peso não aparecem para preenchimento.  Indica a porcentagem do Valor Base que a cotação apurada na data de verificação irá representar para apuração final da taxa média aritmética ponderada.

## Registro de Pagamento de Prêmio

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Pagamento de Prêmio

### Visão Geral

Função para Registro de agenda de pagamentos de prêmio, onde o Participante informa a quantidade de Prêmios, as datas de pagamento e seus valores. Em cada data de evento, deve ser indicado no campo **Titular** qual das pontas envolvidas no contrato é responsável pelo pagamento do prêmio.

### Tela Filtro Registro de Pagamento de Prêmio

**Registro de Pagamento de Prêmio**

**Código do Contrato**

**Forma de Pagamento**

**Quantidade de Prêmios**

Através desta função o Participante informa a quantidade de prêmios e a forma como serão pagos em um determinado contrato.

### Descrição dos Campos da Tela Filtro Registro de Pagamento de Prêmio

Campo	Descrição
Código do Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Código do Contrato a ser pesquisado.
Forma de Pagamento	Campo de preenchimento obrigatório. Campo para indicação do fluxo do pagamento de prêmio. Caixa de Seleção com as opções: <b>Data de Registro</b> , <b>Data de Início</b> , <b>Data de Vencimento</b> e <b>Definir Fluxo</b> .
Quantidade de Prêmio	Campo de preenchimento obrigatório somente quando for escolhida a forma de pagamento <b>Definir Fluxo</b> . Número de prêmios a serem agendados pelo participante.

## Tela Registro de Pagamento de Prêmio

Registro de Pagamento de Prêmio		
Contrato		
Código do Contrato	Data Início	Data Vencimento
14K00079316	14/11/2014	14/12/2014
Ponta 1	Ponta 2	
05000.00-5	10020.00-1	
Ponta 1 (Nome Simplificado)	Ponta 2 (Nome Simplificado)	Meu Número
RIOBM	LEMEBM	<input type="text" value="006"/>
Curva Ponta 1	Curva Ponta 2	Papel
DI	DOLAR DOS EUA	PONTA 1
Eventos de Prêmio		
Data	Valor do Prêmio	Titular
<input type="text" value="21"/> / <input type="text" value="11"/> / <input type="text" value="2014"/>	<input type="text" value="500"/> , <input type="text"/>	<input type="text" value="PONTA 1"/> ▼
Data	Valor do Prêmio	Titular
<input type="text" value="28"/> / <input type="text" value="11"/> / <input type="text" value="2014"/>	<input type="text" value="500"/> , <input type="text"/>	<input type="text" value="PONTA 1"/> ▼
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Após preencher com as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida a tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

## Descrição dos Campos da Tela Registro

Campo	Descrição
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído a operação de registro de fluxo de caixa não constante. Número interno de cada participante identificando o lançamento.
Data	Campo de preenchimento obrigatório. Data em que ocorrerá o pagamento do prêmio.
Valor do Prêmio	Campo de preenchimento obrigatório. Informar o valor do prêmio.
Titular	Campo de preenchimento obrigatório. Indicar a ponta que pagará o prêmio. Caixa de Seleção com as opções: <b>Ponta1</b> ou <b>Ponta2</b> .

### **Liquidação Financeira de Prêmios**

Liquidação de prêmio na data de registro:

- Quando o registro do contrato for efetuado até o horário de encerramento da grade CTP12: Registro de Operações - Bilateral realizada na modalidade de Liquidação Bilateral; e
- Quando o registro do contrato for efetuado após o encerramento do horário da grade CTP12, acima mencionada, realizada na modalidade de Liquidação Bruta STR.

Liquidação de prêmio em data posterior a do registro

- Realizada na Modalidade de Liquidação Bilateral

Liquidação de prêmio fora do âmbito da Cetip (Sem Modalidade de Liquidação), independente da data de pagamento

- Quando se tratar de contratos entre o Participante e seu cliente do tipo 1 ou 2;
- Ou entre clientes 1 de um mesmo Participante

## Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

### Visão Geral

Caso o Participante não tenha informado os parâmetros para disparo de Reset no momento do **Registro de Contrato com Pagamento Final**, ele pode informar através dessa função.

**Observação:** Se no registro de um determinado contrato de Swap o Participante informar que há Reset, mas não informá-lo até o horário de fechamento da grade **Sem Modalidade** neste mesmo dia, o registro deste contrato é cancelado.

### Tela Filtro Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Código do Contrato

Forma de Disparo  ▼

Quantidade de Datas

O Participante deve informar o código do contrato com Pagamento Final, a forma de disparo e quantidades de datas, se for o caso, e clicar no botão **Pesquisar**.

### Formas de Disparo

#### Por Data:

O ajuste ocorre quando chegar à data (dia útil) informada pelo Participante. O Participante, ao escolher esta opção, deve determinar as datas específicas em que ocorrerão os ajustes. Formato: DD/MM/AAAA.

#### Por Valor:

Ao determinar um valor o Participante está indicando um limite máximo para uma possível diferença financeira entre as curvas do contrato em questão, marcadas a mercado. Dessa forma, a partir da informação de marcação a mercado dada pelo contratante, o sistema apura e compara o resultado com o valor informado neste campo. Se o diferencial das curvas marcadas a mercado, informado pelo Participante, for maior que o valor informado neste parâmetro, ocorre o disparo. Formato com 10 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais.

#### Por Data ou Valor:

Nesse tipo de disparo, um dos dois parâmetros deve ser acionado para que ocorra o disparo.

Podem ocorrer vários disparos por valor, antes ou após as datas informadas, tantas quantas forem as informações das curvas marcadas a mercado e houver ou não a liquidação financeira de ajuste e por conseguinte alteração dos parâmetros de disparo.

**Por Data e Valor:**

Esta opção permite a utilização conjunta dos parâmetros. Sua utilização consiste em acionar o ajuste a partir de data(s) específica(s) e a partir de um valor. Na data especificada o valor deve ser ultrapassado para ocorrer o disparo.

**Descrição dos Campos da Tela Filtro Registro de Parâmetros para Disparo de Reset**

Campo	Descrição
Código do Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Campo para indicação do contrato.
Forma de Disparo	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a forma de disparo do Reset. Caixa de Seleção com as opções: <b>Data, Valor, Data ou Valor e Data e Valor.</b>
Quantidade de Datas	Campo de preenchimento obrigatório somente se forma de Disparo envolver o parâmetro Data com limitação de 120 datas de eventos por registro. Se indicado no campo <b>Forma de Disparo</b> a opção: Data, Data e Valor ou Data ou Valor, aqui deve ser informado o número de datas nas quais ocorrerá possibilidade de Reset.



## Tela Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Registro de Parâmetros para Disparo de Reset		
Contrato		
Código do Contrato	Data Início	Data Vencimento
14K00079320	14/11/2014	14/12/2014
Ponta 1	Ponta 2	
05000.00-5	10020.00-1	
Ponta 1 (Nome Simplificado)	Ponta 2 (Nome Simplificado)	Meu Número
RIOBM	LEMEBM	<input type="text" value="3456"/>
Curva Ponta 1	Curva Ponta 2	Papel
DI	DOLAR DOS EUA	PONTA 1
Permissibilidade para Registros		
Curvas Marcadas a Mercado	Reset	
<input type="text" value="PONTA 1"/> ▼	<input type="text" value="PONTA 1"/> ▼	
Condição de Disparo		
Forma de Disparo	Credor	
DATA OU VALOR	<input type="text" value="PONTA 1"/> ▼	
Disparo por Valor		
Valor		
<input type="text" value="1000"/> , <input type="text"/>		
Datas de Disparo		
<input type="text" value="21"/>	<input type="text" value="11"/>	<input type="text" value="2014"/>
<input type="text" value="28"/>	<input type="text" value="11"/>	<input type="text" value="2014"/>
<input type="button" value="Enviar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/>	<input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Selecionando a opção: **PONTA 1** ou **PONTA 2**, o valor informado para ajuste não tem necessidade de duplo comando para matching, já optando por **AMBOS**, há a necessidade do mesmo.

Uma vez indicados os responsáveis por informar a Curva Marcada a Mercado, Reset e Credor, esses não poderão mais ser modificados. Serão os mesmos até o fim do contrato.

Após preencher com as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

### Descrição dos Campos da Tela de Registro

Campo	Descrição
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído a operação de registro de fluxo de caixa não constante. Número interno de cada participante identificando o lançamento.
Papel	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a ponta que está efetuando a atualização. Caixa de Seleção com as opções: <b>Ponta1</b> ou <b>Ponta2</b> .
Curvas Marcadas a Mercado	Campo de preenchimento obrigatório. Indica qual dos Participantes deve informar as Curvas Marcadas a Mercado. Caixa de Seleção com as opções: <b>AMBOS</b> , <b>PONTA 1</b> ou <b>PONTA 2</b> .
Reset	Campo de preenchimento obrigatório. Indica qual dos Participantes deve registrar o Reset. Caixa de Seleção com as opções: <b>AMBOS</b> , <b>PONTA 1</b> ou <b>PONTA 2</b> .
Credor	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a condição de disparo de Reset. A ponta indicada define quem pode ser credor na liquidação financeira do Reset. Se após a informação das Curvas Marcadas a Mercado, a ponta credora não for a indicada, o Reset não é disparado. Caixa de Seleção com as opções: <b>PONTA 1 OU PONTA 2</b> , <b>PONTA 1</b> ou <b>PONTA 2</b> .
Valor	Campo de preenchimento obrigatório. Parâmetro que define o valor limite do diferencial das Curvas Marcadas a Mercado. A diferença das Curvas Marcadas a Mercado deve ser maior que o parâmetro indicado para ocorrer o disparo do Reset. Preencher em R\$ (10 inteiros e 2 decimais).
Datas de Disparo	Campo de preenchimento obrigatório. Datas com possibilidade de ocorrer Reset. Formato: DD/MM/AAAAA.

## Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Curvas Marcadas a Mercado

### Visão Geral

Nessa função o Participante pode informar diariamente as **Curvas Marcadas a Mercado (MTM - Mark-To-Market)** de cada contrato com Reset registrado por ele. Com isso possibilita que o sistema consiga apurar o diferencial das Curvas Marcadas a Mercado e se o contrato ultrapassou o valor limite quando indicado. Se o Participante não informar essas curvas de marcação o contrato não tem o ajuste acionado.

Não é permitida a alteração das informações prestadas se já tiver ocorrido o ajuste utilizando os parâmetros anteriormente informados. Nesta condição, o Participante deve optar por não liquidá-lo e somente após este procedimento retornar a essa função para que sejam fornecidos novos parâmetros.

O conceito de marcação a mercado consiste em estabelecer o preço atual de uma operação de tal forma que sua reposição permita ao adquirente os mesmos resultados de uma nova operação com características de fluxos de caixa e prazos remanescentes, iguais ao da operação original.

### Tela Filtro Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Registro de Informação de Derivativos	
Código do Contrato	<input type="text" value="14K00079311"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>

O Participante deve inserir o código do contrato e clicar no botão **Pesquisar** para abrir a tela de registro de curvas marcadas a mercado.

### Tela de Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Registro de Curvas Marcadas a Mercado		
Contrato		
Código do Contrato	Data Início	Data Vencimento
14K00079311	14/11/2014	14/12/2014
Ponta 1	Ponta 2	
05000.00-5	05000.10-8	
Ponta 1 (Nome Simplificado)	Ponta 2 (Nome Simplificado)	Meu Número
RIOBM	RIOBM	<input type="text" value="125"/>
Curva Ponta 1	Curva Ponta 2	Papel
DOLAR DOS EUA	DI	PONTA 1
Curvas Marcadas a Mercado		
Ponta 1	Ponta 2	
<input type="text" value="1"/> , <input type="text" value="10000000"/>	<input type="text" value="1"/> , <input type="text" value="20000000"/>	
<input type="button" value="Enviar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/>	<input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Sendo um Participante indicado na função Registro de Parâmetros para Disparo de Reset, como parte credora da operação, para que o Reset dispare (independente da forma de disparo indicado), o fator informado por este Participante deve ser maior do que o da contraparte.

Logo após a informação das curvas marcadas a mercado, o sistema compara a evolução de cada uma das curvas de atualização do contrato, com as expectativas as curvas informadas nessa função.

Após preencher com as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

#### Descrição do Campo da Tela Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Campo	Descrição
<b>Campos de preenchimento obrigatório.</b>	
Meu Número	Número atribuído a operação de registro de Curvas Marcadas a Mercado. Número interno de cada Participante identificando o registro.
Ponta 1	Indica qual é o fator da Curva Marcada a Mercado desejado pela Ponta 1. Informado com até 6 (seis) números inteiros e 8 (oito) decimais.
Ponta 2	Indica qual é o fator da Curva Marcada a Mercado desejado pela Ponta 2. Informado com até 6 (seis) números inteiros e 8 (oito) decimais.

## Registro de Reset

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Reset

### Visão Geral

Através desta função, o Participante pode registrar, após o disparo, o Reset de um contrato pagamento final que tenha esta previsão, indicando se há ou não liquidação financeira. Havendo liquidação, o Participante pode definir se há ou não continuidade do contrato e alterações decorrentes do Reset.

Essa função só pode ser utilizada quando for disparado o Reset, esta condição pode ser consultada em:

- **Módulo Operações / Menu Consulta / itens Operações / Operações Pendentes;** ou
- **Módulo Swap / Consulta / Histórico de Curvas Marcadas a Mercado.**

Os ajustes ou Resets permitem aos contratantes avaliarem periodicamente a evolução de cada uma das curvas de atualização do contrato, confrontando-as com as expectativas futuras de taxa de juros (marcação a mercado de taxa de juros futura).

---

**Observação:** O Reset não pode ser realizado no dia do registro do contrato.

---

### Tela Filtro Registro de Reset

Registro de Reset

Código do Contrato  X

Nesta tela o Participante deve informar o código do contrato objeto de registro de Reset.

## Tela Registro de Reset

Contrato		
<b>Código do Contrato</b>	<b>Data Início</b>	<b>Data Vencimento</b>
14K00080928	17/11/2014	21/11/2014
<b>Ponta 1</b>	<b>Ponta 2</b>	
05000.00-5	05000.10-8	
<b>Ponta 1 (Nome Simplificado)</b>	<b>Ponta 2 (Nome Simplificado)</b>	<b>Meu Número</b>
RIOBM	RIOBM	<input type="text" value="12478"/>
<b>Curva Ponta 1</b>	<b>Curva Ponta 2</b>	<b>Papel</b>
DI	DOLAR DOS EUA	PONTA 1

Curvas Marcadas a Mercado	
<b>Ponta 1</b>	<b>Ponta 2</b>
1,01000000	1,02000000
<b>Diferencial das Curvas</b>	<b>Credor</b>
10,00	PONTA 2
<b>Liquidação do Reset</b>	<b>Continuidade do Contrato</b>
<input type="text" value="SIM"/>	<input type="text" value="SIM"/>

Alteração no Contrato		
<b>Altera Contrato</b>		
<input type="text" value="SIM"/>		
<b>Altera Parâmetros Reset</b>	<b>Forma de Disparo</b>	<b>Quantidade Datas Reset</b>
<input type="text" value="NAO"/>	<input type="text" value="VALOR"/>	<input type="text" value="1"/>

**Opções para fixar o momento do Reset:**

1. **Valor:** Em R\$. Ocorre a possibilidade de ajuste se o valor a mercado do Swap (diferença entre as curvas marcadas a mercado) for superior ao valor do limite informado.
2. **Data:** Ocorre a possibilidade de ajuste em determinadas datas.
3. **Data e Valor:** Ocorre a possibilidade de ajuste em determinadas datas se o valor do diferencial entre as curvas marcadas a mercado do Swap for superior ao valor do limite informado.
4. **Data ou Valor:** Ocorre a possibilidade de ajuste em determinadas datas ou se o valor a mercado do Swap for superior ao valor do limite informado, o que ocorrer primeiro. Os ajustes ou Resets permitem aos contratantes desta modalidade de Swap avaliar periodicamente a evolução de cada uma das curvas de atualização do contrato, confrontando-as com as expectativas futuras de taxa de juros (marcação a mercado de taxa de juros futura).

**Na ocorrência de registro de Reset com liquidação financeira e:**

1. **Continuidade do Contrato** - o sistema utiliza para atualização da curva contábil, da data do Reset em diante, o valor base atualizado.
2. **Não Continuidade do Contrato** - o sistema antecipa totalmente o contrato em decorrência do reset.
3. Selecionando **NÃO, para Liquidação do Reset**, obrigatoriamente no campo **Continuidade do Contrato** deve ser indicada a opção **SIM**, e neste caso o sistema utilizará, para atualização da curva contábil, a data de emissão ou a data do último reset liquidado em diante.

Se for selecionada a opção **SIM**, para os campos **Liquidação do Reset** e **Altera Contrato**, a liquidação financeira é realizada, nas modalidades: **Bruta STR**, **Bilateral** ou **Sem Modalidade**, após a alteração do contrato;

Após preencher com as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

**Observação:** Se foi informado pelo Participante que pode existir alteração no contrato, para que ocorra o Reset, o mesmo deve acessar a função **Registro de Reset - Alterações** para finalizar a operação.

A função "Antecipação de Contratos" não permite a antecipação de contratos com Reset nas datas de liquidação com Reset.

#### Descrição dos Campos de Tela Registro

Campo	Descrição
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído a operação de registro de Reset. Número interno de cada participante identificando o registro.
Papel	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de Seleção com as opções <b>Ponta1</b> , <b>Ponta2</b> .
Liquidação de Reset	Campo de preenchimento obrigatório. Optando pela liquidação do ajuste, a modalidade de liquidação pode ser <b>Bilateral</b> ou <b>Bruta</b> , conforme horário da janela de liquidação ou <b>Sem modalidade</b> . Optando por não liquidar o contrato, não é permitida qualquer alteração nos parâmetros. Caixa de Seleção com as opções <b>Sim</b> e <b>Não</b> . Informa se existe a liquidação financeira ou não do ajuste periódico.

Campo	Descrição
Continuidade de Contrato	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Optando por liquidá-lo, a modalidade de liquidação pode ser <b>Bilateral</b> ou <b>Bruta</b>, conforme horário da janela de liquidação ou <b>Sem modalidade</b>.</p> <p>Optando por não dar continuidade, não é permitida qualquer alteração nos parâmetros do contrato.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções <b>Sim</b> e <b>Não</b>. Nesse campo, o participante pode optar pela continuação do contrato até o próximo ajuste, vencimento ou antecipação total decorrente do reset.</p>
Altera Contrato	<p>Campo de preenchimento obrigatório se a opção <b>Continuidade de Contrato = SIM</b>.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções <b>Sim</b> e <b>Não</b>. Informa se existirá alteração ou não no contrato decorrente do Reset.</p>
Altera Parâmetros Reset	<p>Campo de preenchimento obrigatório se a opção <b>Altera Contrato = SIM</b>.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções <b>Sim</b> e <b>Não</b>. Informa se existirá alteração nos parâmetros de Reset.</p>
Forma de Disparo	<p>Campo de preenchimento obrigatório se a opção <b>Altera Parâmetros = SIM</b>.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções <b>Data, Valor, Data e Valor</b> e <b>Data ou Valor</b>. Nesse campo é escolhida a forma de disparo do ajuste periódico.</p>
Quantidade Datas de Reset	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Se indicado no campo <b>Forma de Disparo</b> a opção: <b>Data, Data e Valor</b> ou <b>Data ou Valor</b>, aqui deve ser informado o número de datas, nas quais ocorrerá o Reset.</p>



## Intermediação de Contrato

Menu Swap > Lançamentos > Intermediação de Contrato

### Visão Geral

A Intermediação de Contrato registra o valor da comissão, devida ao intermediador, que é cobrada da Parte que o contratou. Ocorrem com a digitação de ambas as partes envolvidas, o intermediador (quem recebe a comissão) e do Participante (quem paga a comissão).

Caso o intermediador cobre comissão das duas Partes envolvidas na operação, esta função deve ser realizada para o Participante e também para a Contraparte.

### Tela Intermediação de Contrato

**Registro de Intermediação de Contrato**

Parte	<input type="text" value="05000"/>	<input type="text" value="00"/>	<input type="text" value="5"/>
Contraparte	<input type="text" value="10020"/>	<input type="text" value="00"/>	<input type="text" value="1"/>
Código do Contrato	<input type="text" value="14K00079310"/>		
Meu Número	<input type="text" value="125"/>		
Comissão	<input type="text" value="1"/>	<input type="text" value=""/>	<input type="text" value=""/>

Após preencher os campos e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

### Observações:

- 1) O pagamento da comissão de intermediação deve ser na data de registro do contrato, mesmo que não coincida com a data de início, como no caso de contratos a termo.
- 2) Registro permitido para contratos de Pagamento Final.
- 3) O registro de comissão só é permitido entre contas próprias e para operações de Swap nas quais parte e contraparte são também contas próprias.
- 4) Para efeito de liquidação da comissão, o sistema irá verificar quais das contas informadas na "Tela Intermediação de Contratos" faz parte da operação indicada pelo código do contrato e, desta conta, irá debitar a comissão (e, conseqüentemente, será creditada a outra conta).

### Descrição dos campos da Tela Intermediação de Contrato

Campo	Descrição
<b>Campos de preenchimento obrigatório.</b>	
Parte	Código Cetip que identifica o membro que está acessando o módulo.
Contraparte	Código Cetip que identifica o outro membro envolvido na operação.
Código do Contrato	Número do contrato de Swap gerado pelo sistema.

---

Campo	Descrição
Número Operação	Número atribuído à operação de intermediação.
Comissão	Valor percentual que será aplicado sobre o Valor Base inicial da operação, sob a forma de comissão a ser paga ao intermediador. Informado com até 2 (dois) números inteiros e 8 (oito) decimais.

---

## Registro de Reset - Alterações

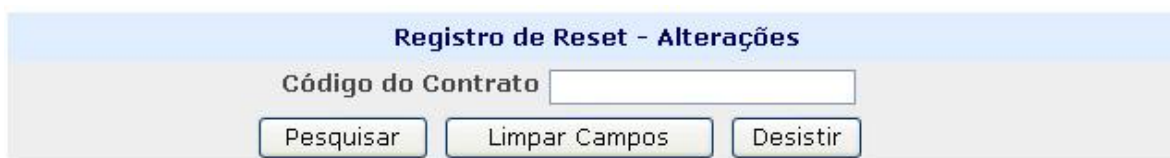
Menu Swap > Lançamentos > Registro de Reset - Alterações

### Visão Geral

Através dessa função o Participante pode alterar os parâmetros anteriormente definidos no **Registro de Reset**.

**Observação:** A alteração é permitida somente se o Participante selecionar a opção **SIM**, na parte **Altera Contrato**, no Registro de Reset.

### Tela Filtro Registro de Reset Alterações



The screenshot shows a web interface for filtering reset records. At the top, there is a blue header with the text "Registro de Reset - Alterações". Below the header, the label "Código do Contrato" is followed by a white text input field. Underneath the input field, there are three buttons: "Pesquisar" (Search), "Limpar Campos" (Clear Fields), and "Desistir" (Cancel).

Nesta tela o Participante deve informa o código do contrato objeto de alteração.

## Tela Registro de Reset - Alterações

Registro de Reset - Alterações		
Contrato		
Código IF 09K00001028	Data Início 11/11/2009	Data Vencimento 20/11/2009
Ponta 1 10020.00-1	Ponta 2 77786.00-3	
Ponta 1 (Nome Simplificado) LEMEBM	Ponta 2 (Nome Simplificado) MEIERBM	Meu Número 1
Curva Ponta 1 DOLAR	Curva Ponta 2 VCP	Papel PONTA 1
Valor Base 500000000 ,		
Ponta 1		
Percentual 100 ,	+/- +	Juros(% aa) 8 ,
Cupom Limpo 1 , 80000	Data de Cotação D-1	
Ponta 2		
Percentual 100 ,	+/-	Juros(% aa)
PU 1000 ,	Tipo/Classe EURO Spot	Denominação teste
Permissibilidade para Registros		
Forma de Disparo DATA E VALOR	Condição de Disparo PONTA 1 OU PONTA 2	
Curvas Marcadas a Mercado PONTA 1	Reset PONTA 1	
Disparo por Valor		
Valor 5000 ,		
Datas de Disparo		
16/11/2009		
17/11/2009		
18/11/2009		
19/11/2009		
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Após alterar as informações desejadas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados alterados, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

## Descrição dos Campos da Tela Registro - Alterações

Campo	Descrição
<b>Contrato – Campos de preenchimento obrigatório.</b>	
Meu Número	Número atribuído à operação de Alteração de Reset. Número interno atribuído pelo participante identificando a operação de alteração.
Papel	Caixa de Seleção com as opções: <b>Ponta1, Ponta2.</b>
Valor Base	Valor base da operação a partir do qual os parâmetros definidos para o contrato a partir do Reset irão incidir. Com 14 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais.
<b>Ponta 1 / Ponta 2</b>	
Percentual	Campo de preenchimento obrigatório. Valor percentual do parâmetro com que o Participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva. Após o Reset, caso não haja taxa de juros, o percentual pode ser diferente de 100%; havendo taxa de juros, o percentual deve ser obrigatoriamente 100%. Até 3 inteiros e 2 decimais.
Sinal + / -	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher em conjunto com <b>Juros</b> . Somente os registros de contratos pactuados com base no <b>DI, Dólar, LIBOR</b> e <b>TJMI</b> aceitam taxas de juros negativas. Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa.
Juros % a.a.	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher em conjunto com <b>Sinal</b> . Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais. É a taxa de remuneração que, agregada ao parâmetro, atualiza o Valor Base após o Reset.
Cupom Limpo/Outros - Cotação	Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes. Somente deve ser preenchido: Se desejar utilizar o <b>Cupom Limpo</b> para curva; Cotação inicial da moeda quando indicada a opção <b>Outros</b> para variação cambial: <b>Euro, Iene</b> ou <b>Libra</b> nas curvas <b>LIBOR</b> ou <b>TJMI</b> .

Campo	Descrição
Limite Inferior (Floor) - Perc	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.</p>
Limite Superior (Cap) - Perc	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.</p> <p>Taxa arbitrada como Limite Superior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.</p>
<b>Disparo por Valor – Campo de preenchimento obrigatório.</b>	
Valor	<p>Valor que é comparado com o diferencial das curvas marcadas a mercado, informadas pelo participante a partir do Reset. Preencher em R\$ com 10 inteiros e 2 casas decimais. Permite indicar valor 0,00.</p>
<b>Datas de Disparo – Campo de preenchimento obrigatório.</b>	
Data	<p>Data em que ocorre a possibilidade de ajustes. Formato: DD/MM/AAAA.</p>

## Alteração de Contrato - Pagamento Final

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Contrato – Pagamento Final

### Visão Geral

Esta função permite ao Participante alterar informações registradas em determinado contrato.

A alteração somente é admitida para os contratos realizados entre o Participante e sua conta de cliente 1 ou 2 e nos prazos abaixo:

Tipo da Operação	D0	D1	D2	D3	Dn
mercado x mercado	não	não	não	não	não
cliente 2 (a) x cliente 2 (b)	não	não	não	não	não
mercado x cliente 1 ou 2 (próprio)	não	possível	possível	possível	não
mercado x cliente 2 de outros	não	não	não	não	não

No caso do contrato não ter sido realizado entre o Participante e sua conta de cliente 1 ou 2, ainda, depois de decorrido o prazo acima mencionado, o Participante que tenha interesse em efetuar a alteração de contrato deve encaminhar correspondência juntamente com os demais documentos comprobatórios da operação, para avaliação da Cetip por meio da área operacional.

Ressaltamos que a utilização de outros mecanismos para caracterizar a alteração das condições originalmente pactuadas poderá caracterizar a inadimplência regulamentar do Participante, sujeitando-o às penalidades previstas no regulamento da Cetip.

### Tela Filtro Alteração de Contrato - Pagamento Final

**Alteração de Contrato - Pagamento Final**

Código do Contrato

Ação **CORREÇÃO**

Após inserir o Código do Contrato e clicar o botão **Pesquisar**, o sistema exibe tela com dados passíveis de alteração.

O contrato pode ser alterado mais de uma vez no mesmo dia desde que a alteração anterior esteja confirmada ou cancelada.

**Observação:****Contratos de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.**

A alteração de contrato de swap que afete a agenda de redutor de risco de crédito não vão gerar alteração de agente de redutor de risco de crédito periódico, tais alterações deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

**Tela de Registro de Alteração de Contrato - Pagamento Final**

Alteração de Contrato - Pagamento Final			
Parte 05000 00 5	Contraparte 05000 10 8	CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte 012.345.678-90
Meu Número	Código do Contrato 13A00000125	Comissão Parte	Comissão Contraparte
<b>Características</b>			
Data de Registro 7 / 1 / 2013	Data Início 7 / 3 / 2013	Data Vencimento 7 / 3 / 2014	
Valor Base 10000 ,	Valor Total Antecipado 0 ,	Valor Base Atual 10000 ,	Valor Total Amortizado 0 ,
Adesão a Contrato SEM ADESAO	Agenda de Prêmio NAO	Reset NAO	Código Estratégia
Amortiza sem troca de diferencial	Código Identificador		Funcionalidades SEM FUNCIONALIDADE
<b>Exclusivo para Contrato à Termo</b>			
Data Operação 7 / 1 / 2013	Índice Termo	Perc. Termo	
<b>Se Índice Termo</b>			
PU Inicial/Cupom Limpo	Data de Cotação Final - Termo	Tipo/Classe	Denominação
<b>Curvas para Atualização</b>			
Parte		Contraparte	
Percentual 100 ,	Curva PREFIXADO 360D	Percentual 100 ,	Curva DOLAR DOS EUA
TR Escolhida +/-	Juros(% aa) 10 ,	TR Escolhida +/-	Juros(% aa) 10 ,
Lim. Inferior (Floor)	Lim. Superior (Cap)	Lim. Inferior (Floor)	Lim. Superior (Cap)
<b>Terceira Curva</b>			
Parte/Contraparte	Cupom Limpo	Percentual	Curva
<b>Se Curva(s) = "VCP":</b>			
Parte		Contraparte	
PU	Tipo/Classe	PU	Tipo/Classe
Denominação		Denominação	
<b>Cupom Limpo/Data Cotação</b>			
Parte		Contraparte	
Cupom Limpo	Data Informação Cupom Limpo	Data de Cotação	Cupom Limpo
			Data de Cotação D-1

(continua)



Exclusivo para curva "Libor"					
Parte		Contraparte			
Data de Cotação - Libor <input type="text"/>	Variação Cambial <input type="text"/>	Data de Cotação - Libor <input type="text"/>	Variação Cambial <input type="text"/>		
Tipo Classe <input type="text"/>	Data da Cotação - Variação Cambial <input type="text"/>	Tipo Classe <input type="text"/>	Data da Cotação - Variação Cambial <input type="text"/>		
Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/>	Aliquota IR <input type="text"/>	Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/>	Aliquota IR <input type="text"/>		
Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/>	Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/>	Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/>	Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/>		
Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional"					
Parte		Contraparte			
Taxa Juros <input type="text"/>	Variação Cambial <input type="text"/>	Taxa Juros <input type="text"/>	Variação Cambial <input type="text"/>		
Tipo Classe <input type="text"/>	Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/>	Tipo Classe <input type="text"/>	Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/>		
Aliquota IR <input type="text"/>	Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/>	Aliquota IR <input type="text"/>	Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/>		
Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/>		Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/>			
Exclusivo para Commodity					
Parte		Contraparte			
Cotação Inicial <input type="text"/>	Codigo da Commodity <input type="text"/>	Média Asiática Verificação <input type="text"/>	Data da Cotação para Ajuste <input type="text"/>		
Funcionalidades					
Trigger in			Trigger out		
Parte/Contraparte <input type="text"/>	Fator/Valor/Taxa <input type="text"/>	Verificação <input type="text"/>	Parte/Contraparte <input type="text"/>		
Titular da Funcionalidade/Prêmio		Prêmio(1) de Funcionalidade		Prêmio(2) de Funcionalidade	
Titular <input type="text"/>		Valor R\$ <input type="text"/>	Rebate R\$ <input type="text"/>	Valor R\$ <input type="text"/>	Data Exercício <input type="text"/>
		Liquidação do Rebate <input type="text"/>	Dias Úteis após o Trigger Out <input type="text"/>		
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>					

(Fim)

Após a alteração das informações desejadas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados alterados, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

### Descrição dos Campos da Tela de Registro de Alteração de Contrato

Campo	Permissão para alteração / Observações
Parte e Contraparte	Não podem ser alterados.
CPF/CNPJ Parte e Contraparte	Não podem ser alterados.
Meu Número	O original não pode ser alterado, mas deve ser informado um novo para a operação de alteração.
Código do contrato	Não pode ser alterado.

Campo	Permissão para alteração / Observações
Comissão Parte	Valor percentual aplicado sobre o Valor Base do contrato e pago a Parte pela Contraparte.
Comissão Contraparte	Valor percentual aplicado sobre o Valor Base do contrato e pago a Contraparte pela Parte.
<b>CARACTERÍSTICAS</b>	
Data Início	Não pode ser menor do que a Data de Registro, exceto quando operação realizada com Cliente 1, limitado a D-2.
Data Vencimento	Data de vencimento do contrato. Deve ser maior que Data Início.
Valor Base	No caso de contratos à vista, o sistema desconsidera a atualização das curvas, sendo apresentadas com os novos valores no dia seguinte, atualizados desde a data de início, sobre o novo <b>Valor Base</b> . Quando contratos a termo, assumir, no dia seguinte à alteração, o novo Valor Base informado pelos participantes e atualizar pelo parâmetro pactuado (caso haja) até a data de início. Com 10 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais.
Valor Total Antecipado	Valor total antecipado.
Valor Base Atual	Valor base atualizado.
Valor Total Amortizado	Valor total amortizado.
Funcionalidades	Caixa de seleção com as funcionalidades.
Adesão a Contrato	Caixa de Seleção com as opções: <b>CGD</b> , <b>CGD/CSA</b> , <b>CSA</b> ou <b>Sem Adesão</b> . Indica a existência, ou não, de adesão a contrato padronizado de Derivativos.
Código Estratégia	Informar o código da estratégia, cadastrada e habilitada para o Participante pela Cetip, que se deseja vincular ao contrato.
Amortiza sem troca de diferencial	Caixa de Seleção com as opções: Sim ou Não. Quando Selecionada a opção Sim, se uma das curvas for moeda ou índice de preços registrar a(s) mesma(s) como VCP.
Código identificador	

#### Exclusivo para Contrato à Termo

Campo	Permissão para alteração / Observações
Data Operação	<p>Somente para dia útil. Em D-2 útil ou D+0 da data do registro do contrato. Data de quando a operação foi pactuada a termo, ou seja, ainda não teve início.</p> <p>Se for contrato a termo COM previsão de índice de atualização do Valor Base, a data somente pode ser alterada se ainda não estiver iniciado.</p> <p>Se for contrato a termo SEM previsão de índice de atualização, a data pode ser alterada, mesmo que este já tenha iniciado.</p>
Índice Termo	<p>É permitida a alteração, se contrato ainda não iniciado. Altera a atualização para o dia seguinte ao de alteração (caso haja troca de índice ou inclusão de índice).</p>
Perc. Termo	<p>Valor percentual do Índice Termo que corrige o Valor Base inicial.</p> <p>É permitida a alteração. Deve ser preenchido se o campo <b>Índice Termo</b> for informado.</p> <p>Preencher com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais.</p>
<b>Se Índice Termo</b>	
PU Inicial	<p>É permitida a alteração, se o contrato ainda não tiver sido iniciado. A atualização é realizada para o dia seguinte da alteração.</p> <p><b>Obs.:</b> Na utilização do Índice Termo = dólar, a cotação que é utilizada pelo sistema Cetip é D-1;</p> <p>Para cotação do dólar de correção do termo for diferente de D-1 utilizar Índice termo = VCP</p>
Data de Cotação Final – Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório para quando o campo “Índice termo” seja qualquer moeda disponível em seu domínio.</p> <p>Utilizado para informar o deslocamento da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor final para valorização da curva do contrato quando índice termo for moeda.</p> <p>Possíveis valores: (01) D-1; (02) D-2; (03) D-3; (04) D-4; (05) D-5;</p>
Tipo/Classe	<p>Tipo do Índice <b>VCP</b> que atualiza o Valor Base do contrato à termo.</p> <p>É permitida a alteração, mesmo com o contrato já iniciado.</p>
Denominação	<p>Descrição do parâmetro escolhido como <b>VCP</b> para atualização do Valor Base do contrato a termo. Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser <b>00 - VCP</b>.</p> <p>Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo “Tipo/Classe”. Para maiores consultar a seção “Consulta Tipo Classe”.</p> <p>É permitida a alteração, mesmo com o contrato já iniciado.</p>
<b>CURVAS PARA ATUALIZAÇÃO – Parte e Contraparte</b>	
<b><i>Curvas do Swap, para atualização conforme os parâmetros definidos</i></b>	

<b>Campo</b>	<b>Permissão para alteração / Observações</b>
Percentual	Valor percentual do parâmetro com que o Participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva. É permitido alteração. A curva é atualizada para o próximo dia útil.
Curva	Parâmetro para atualização das curvas do contrato.
TR Escolhida	
+ / -	Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa. É permitido alteração. A curva é atualizada para o próximo dia útil.
Juros % a.a.	É a taxa de remuneração que, agregada ao parâmetro, atualiza o Valor Base. É permitido alteração. A curva é atualizada para o próximo dia útil.
Lim. Inferior (Floor)	É permitida alteração. Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais.
Lim. Superior (Cap)	É permitida alteração. Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais.
<b>Terceira Curva</b>	
Parte/Contraparte	É permitida alteração. Caixa de Seleção com as opções Parte e Contraparte.
Cupom Limpo	É permitida alteração. Valor da taxa de juros, de comum acordo entre as partes, que o módulo utilizará como valor inicial para valorização da curva do contrato. Informado com até 8 (oito) números inteiros e 7 (sete) decimais.
Percentual	É permitida alteração. Valor percentual do parâmetro de atualização da Terceira Curva do Swap, usada como Limite Inferior ou Superior. Informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais.
Curva	É permitida alteração. Curva é a linha que descreve o comportamento do parâmetro de atualização do contrato.
+ / -	É permitida alteração. Indica se o juro a ser agregado ao parâmetro de atualização é positivo ou negativo.
Juros (% a)	É permitida alteração. Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.
Limitador	É permitida alteração. Caixa de Seleção com as opções: Limite Inferior e Limite Superior.

Campo	Permissão para alteração / Observações
<b>Se Curva (s) = VCP – Parte e Contraparte</b>	
PU	É permitida alteração. Valor unitário do índice na data de contratação do Swap em que a variação do parâmetro não disponibilizado pela Cetip é aplicada.
Tipo/Classe	Tipo do Índice VCP para a(s) curva(s) do(s) Participante e da Contraparte, caso seja(m) do tipo VCP. É permitida a alteração, mesmo com o contrato já iniciado.
Denominação	Descrição do parâmetro escolhido como <b>VCP</b> para a(s) curva(s) do(s) Participante e da Contraparte, caso seja(m) do tipo <b>VCP</b> . Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo “Tipo/Classe”. Para maiores consultar a seção “Consulta Tipo Classe”. É permitida a alteração, mesmo com o contrato já iniciado.
<b>Cupom Limpo/Data Cotação – Parte e Contraparte</b>	
Cupom Limpo	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Utilizado para Índice Ibovespa, Moedas e VCP. Cotação inicial informada pelas partes para valorização da curva do contrato. Caso não seja informada a cotação inicial, será utilizada a cotação capturada automaticamente pelo Módulo conforme indicado no campo “Data de Cotação”. Nos casos em que a cotação inicial será diferente daquela capturada automaticamente pelo Módulo, esta deve ser indicada exclusivamente por meio deste campo, não devendo ser informada no campo “Denominação”.
Data de Cotação	Data de Cotação a ser utilizada no <b>início</b> e no <b>vencimento</b> do contrato. Para <b>curvas calculadas</b> , são permitidas 3 (três) opções de datas de cotação: D-1, D-2 e D-3. Preenchimento Obrigatório, independentemente da indicação de “Cupom Limpo”. Para <b>curvas VCP</b> , são permitidas 5 (cinco) opções de datas de cotação: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5. Preenchimento Obrigatório, independentemente da indicação de “Cupom Limpo”. Caso a Data de Cotação seja D0, indicar esta informação no campo “Denominação”, não sendo permitido a indicação no campo “Data de Cotação”.
<b>EXCLUSIVO PARA CURVA LIBOR – Parte e Contraparte</b>	
<b>Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Libor</b>	
Data de Cotação	São as opções disponíveis para captura da Taxa Libor. É permitido alteração.
Variação Cambial	São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à Taxa Libor. É permitido alteração.

<b>Campo</b>	<b>Permissão para alteração / Observações</b>
Tipo classe	É permitido alteração.
Data de Cotação – Variação Cambial	Data da Cotação - Variação Cambial da Parte. Possíveis Valores: <b>01</b> (D-1), <b>02</b> (D-2), <b>03</b> , (D-3), <b>04</b> (D-4), <b>05</b> (D-5).
Cupom Limpo / Outros - cotação	Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes. É permitido alteração.
Alíquota IR	Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros, conforme fórmula. É permitido alteração.
Limite Inferior (Floor) - Perc.	Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. Será aplicado quando do vencimento do contrato. É permitido alteração.
Limite Superior (Cap) - Perc.	Taxa arbitrada como Limite Superior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. Será aplicado quando do vencimento do contrato. É permitido alteração.
<b>EXCLUSIVO PARA TAXA JUROS MERCADO INTERNACIONAL – Parte e Contraparte</b>	
<b><i>Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Taxa Juros Mercado Internacional</i></b>	
Taxa Juros	Taxa de Juros informada para o período determinado no campo Troca de Fluxo. É permitido alteração.
Variação Cambial	São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à TJMI. As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda. É permitido alteração.
Tipo Classe	É permitido alteração.
Cupom Limpo / Outros - cotação	Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes. É permitido alteração.
Alíquota IR	Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros, conforme fórmula. É permitido alteração.
Limite Inferior (Floor) - Perc.	Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. Será aplicado quando do vencimento do contrato. Taxa indicada para todas as trocas de fluxo, o limite valerá para todas as trocas. É permitido alteração.
Limite Superior (Cap) - Perc.	Taxa arbitrada como Limite Superior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. Será aplicado quando do vencimento do contrato. Taxa indicada para todas as trocas de fluxo, o limite valerá para todas as trocas. É permitido alteração.
<b>EXCLUSIVO PARA COMMODITY – Parte e Contraparte</b>	

<b>Campo</b>	<b>Permissão para alteração / Observações</b>
Cotação Inicial	Cotação Inicial da Parte/Contraparte.
Código da Commodity	Código da Commodity da Parte/Contraparte. Esse campo deverá ser preenchido através do RIC. Esta informação já existe nos arquivos públicos relacionados à Mercadorias.
Média Asiática Verificação	Caixa de seleção com as opções: Branco (quando opção não for Asiática), SIMPLES ou PONDERADA.
Data da Cotação para Ajustes	Data de Cotação para Ajuste da Parte/Contraparte. Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 5 (D-5).
<b>Funcionalidades</b>	
<b>Trigger In / Trigger Out</b>	
Parte / Contraparte	É permitida alteração. Caixa de Seleção com as opções: Parte e Contraparte.
Fator/Valor/Taxa	Permite a alteração do parâmetro que determina a efetivação do contrato.
Verificação	É permitida alteração da verificação diária para final. Não é permitida alteração da verificação final para diária, pois o trigger já poderia ter alcançado anteriormente a taxa/valor e neste caso o contrato já estaria valendo ou deixando de existir naquela data.
<b>Titular da Funcionalidade / Prêmio</b>	
Titular	Não altera.
<b>Prêmio (1) de Funcionalidade</b>	
Valor R\$	Não altera.
Rebate R\$	
Liquidação do Rebate	
Dias Úteis após o Trigger Out	
<b>Prêmio (2) de Funcionalidade</b>	
Valor R\$	Não altera.
Data Exercício	Não altera.

## Alteração de Contrato - Fluxo Constante

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Contrato – Fluxo Constante

### Visão Geral

Esta função permite ao Participante, alterar informações registradas em determinado contrato, desde que não tenha ocorrido operação de troca de juros ou de amortização.

Caso o contrato tenha como contraparte a conta 20 a alteração deve ser efetuada por duplo comando. (Ver: **Prazos para alteração**)

### Tela Filtro Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Código do Contrato

Ação CORREÇÃO

O Participante deve inserir o código do contrato e clicar no botão **Pesquisar** para acessar o contrato que se deseja alterar.

O contrato pode ser alterado mais de uma vez no mesmo dia desde que a alteração anterior esteja confirmada ou cancelada.

---

### Observação:

#### Contratos de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.

A alteração de contrato de swap que afete a agenda de redutor de risco de crédito não vai gerar alteração de agente de redutor de risco de crédito periódico, tais alterações deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

---



## Tela de Registro de Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante			
<b>Parte</b>	<b>Contraparte</b>	<b>CPF/CNPJ Cliente Parte</b>	<b>CPF/CNPJ Cliente Contraparte</b>
10020 / 10 / 4	10020 / 10 / 4	67.931.972/0001-70	93.896.397/0012-85
<b>Meu Número</b>	<b>Código do Contrato</b>		
	08D00003009		
Características			
<b>Data de Registro</b>	<b>Data Início</b>	<b>Data Vencimento</b>	
30 / 4 / 2008	30 / 5 / 2008	30 / 5 / 2018	
<b>Adesão a Contrato</b>	<b>Valor Base</b>	<b>Valor Total Antecipado</b>	
	1000000000 ,	100 ,	
<b>Valor Base Atual</b>	<b>Valor Total Amortizado</b>	<b>Agenda de Prêmio</b>	
1008766750 ,	521194068 , 90	NAO	
<b>Código Estratégia</b>		<b>Amortiza sem troca de diferencial</b>	
<b>Código Identificador</b>			
Exclusivo para Contrato à Termo			
<b>Data Operação</b>	<b>Índice Termo</b>	<b>Perc. Termo</b>	
30 / 4 / 2008	SELIC	100 ,	
Se Índice Termo			
<b>PU Inicial/Cupom Limpo</b>	<b>Data de Cotação Final - Termo</b>	<b>Tipo/Classe</b>	<b>Denominação</b>
FLUXO DE JUROS e AMORTIZAÇÕES			
<b>Juros a cada</b>	<b>Período</b>	<b>Data Início Pagto Juros</b>	
1	Meses	30 / 6 / 2008	
<b>Amort a cada</b>	<b>Período</b>	<b>Data Início Pagto Amort.</b>	<b>Tipo Amortização</b>
1	Meses	30 / 6 / 2008	Sobre valor Base Original
Curvas para Atualização			
<b>Parte</b>	<b>Contraparte</b>		
<b>Percentual</b>	<b>Percentual</b>		
100 ,	100 ,		
<b>Curva</b>	<b>+/-</b>	<b>Curva</b>	<b>+/-</b>
PREFIXADO 252D	+	LIBOR IENE 01M	-
<b>Juros(% aa)</b>	<b>Lim. Inferior (Floor)</b>	<b>Juros(% aa)</b>	<b>Lim. Inferior (Floor)</b>
12 ,			
<b>Lim. Superior (Cap)</b>		<b>Lim. Superior (Cap)</b>	
Se Curva(s) = "VCP":			
<b>Parte</b>	<b>Contraparte</b>		
<b>PU</b>	<b>Tipo/Classe</b>	<b>PU</b>	<b>Tipo/Classe</b>
<b>Denominação</b>		<b>Denominação</b>	
Cupom Limpo/Data Cotação			
<b>Parte</b>	<b>Contraparte</b>		
<b>Cupom Limpo</b>	<b>Data Informação Cupom Limpo</b>	<b>Cupom Limpo</b>	<b>Data Informação Cupom Limpo</b>
<b>Data de Cotação</b>		<b>Data de Cotação</b>	

(continua)

Exclusivo para curva "Libor"					
Parte			Contraparte		
Data de Cotação - Libor ▼	Variação Cambial ▼		Data de Cotação - Libor D ▼	Variação Cambial LIBRA ▼	
Tipo Classe ▼	Data da Cotação - Variação Cambial ▼		Tipo Classe ▼	Data da Cotação - Variação Cambial ▼	
Cupom Limpo / Outros - Cotação ,	Alíquota IR ,		Cupom Limpo / Outros - Cotação ,	Alíquota IR ,	
Limite Inferior (Floor) - Perc. ,	Limite Superior (Cap) - Perc. ,		Limite Inferior (Floor) - Perc. ,	Limite Superior (Cap) - Perc. ,	
Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional"					
Parte			Contraparte		
Taxa Juros ,	Troca de Fluxo ▼		Taxa Juros ,	Troca de Fluxo ▼	
Variação Cambial ▼	Tipo Classe ▼		Variação Cambial ▼	Tipo Classe ▼	
Cupom Limpo / Outros - Cotação ,	Alíquota IR ,		Cupom Limpo / Outros - Cotação ,	Alíquota IR ,	
Limite Inferior (Floor) - Perc. ,	Limite Superior (Cap) - Perc. ,		Limite Inferior (Floor) - Perc. ,	Limite Superior (Cap) - Perc. ,	
Exclusivo para Commodity					
Parte			Contraparte		
Cotação Inicial ,	Codigo da Commodity 	Data da Cotação para Ajuste ▼	Cotação Inicial ,	Codigo da Commodity 	Data da Cotação para Ajuste ▼
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>					

(fim)

Após a alterar as informações desejadas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados alterados, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

### Descrição dos Campos da Tela de Registro de Alteração de Contrato- Fluxo de Caixa Constante

Campo	Descrição
Parte e Contraparte	Não podem ser alterados.
CPF/CNPJ Parte e Contraparte	Não podem ser alterados.
Meu Número	O original não pode ser alterado, mas deve ser informado um novo para a operação de alteração.
Código do contrato	Não pode ser alterado.
Características	

Campo	Descrição
Data Início	É permitida alteração, desde que seja: igual à data de registro; ou igual a D-2 da Data de registro. Maior que a data de registro para contratos a termo. Quando contrato a termo, com previsão de índice de atualização do Valor Base, esta data só pode ser alterada quando contrato não iniciado. Não pode ser menor do que a Data Operação, exceto quando operação realizada com Cliente 1, limitado a D-2.
Data Vencimento	É permitida alteração, desde que não seja a data atual do sistema. Deve ser maior que Data Início.
Adesão a Contrato	É permitida alteração.
Valor Base	É permitida alteração. No caso de contratos à vista, o sistema desconsidera a atualização das curvas, sendo apresentadas com os novos valores no dia seguinte, atualizados desde a data de início, sobre o novo <b>Valor Base</b> .  Quando contratos a termo, assumir, no dia seguinte à alteração, o novo Valor Base informado pelos Participantes e atualizar pelo parâmetro pactuado (caso haja) até a data de início.
Valor Total Antecipado	Valor total antecipado.
Valor Base Atual	Valor base atualizado.
Valor Total Amortizado	Valor total amortizado.
Agenda de Prêmio	Não pode ser alterado.  Indica se no contrato que está sendo registrado exista o pagamento de prêmio.
Código Estratégia	Informar o código da estratégia, cadastrada e habilitada para o Participante pela Cetip, que se deseja vincular ao contrato.
Amortiza sem troca de diferencial	Caixa de Seleção com as opções: Sim ou Não.  Quando Selecionada a opção Sim, se uma das curvas for moeda ou índice de preços registrar a(s) mesma(s) como VCP.
Código identificador	
<b>Exclusivo para Contrato à Termo</b>	

Campo	Descrição
Data Operação	<p>É permitida alteração, somente para dia útil. Data de quando a operação foi pactuada a termo, ou seja, ainda não teve início.</p> <p>Se for contrato a termo COM previsão de índice de atualização do Valor Base, somente pode ser alterada se ainda não estiver iniciado.</p> <p>Se for contrato a termo SEM previsão de índice de atualização, pode ser alterada, mesmo que este já tenha iniciado.</p> <p>Há necessidade de reprocessamento da atualização do Valor Base desde a data do registro ou início até o dia da alteração.</p>
Índice Termo	<p>É permitida alteração, somente se contrato ainda não iniciado. Altera (refaz) a atualização para o dia seguinte ao de alteração (caso haja troca de índice ou inclusão de índice).</p> <p>Quando for alterado para <b>VCP</b>, é obrigatório informar o campo <b>PU inicial</b>, <b>Tipo de Classe</b> e <b>Denominação</b>. Se alterado de <b>VCP</b> para <b>Índice Termo</b> conhecido, é obrigatório excluir os campos <b>PU inicial</b>, <b>Tipo de Classe</b> e <b>Denominação</b>.</p>
Perc. Termo	É permitida alteração (se contrato ainda não iniciado). Deve ser preenchido se o <b>Índice Termo</b> for informado. Participa do cálculo referido no item anterior.
<b>Se Índice Termo</b>	
PU Inicial	É permitida alteração, somente se contrato ainda não iniciado. Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser <b>VCP</b> . Altera (refaz) a atualização imediatamente, somente caso o PU Atual tenha sido informado.
Data de Cotação Final – Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório para quando o campo “Índice termo” seja qualquer moeda disponível em seu domínio.</p> <p>Utilizado para informar o deslocamento da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor final para valorização da curva do contrato quando índice termo for moeda.</p> <p>Possíveis valores: (01) D-1; (02) D-2; (03) D-3; (04) D-4; (05) D-5;</p>
Tipo/Classe	É permitida alteração, mesmo com contrato já iniciado.
Denominação	É permitida alteração, mesmo com contrato já iniciado.
<b>Fluxo de Juros e Amortizações</b>	
Juros a cada	É permitida a alteração. É necessário refazer o fluxo e a agenda de eventos.
Período	É permitida a alteração desde que não tenha existido operação de troca de juros/amortização. É refeito o fluxo e a agenda de eventos.

Campo	Descrição
Data Início Pagto Juros	É permitida a alteração. Importante: Pode ser informada uma data passada (qualquer data), mesmo não sendo com cliente 1. Indica que o Swap foi registrado após a data original da dívida e pretende-se ajustar a primeira troca de juros no sistema fazendo referência à <b>Data Início Pagto Juros</b> , que já pode ter ocorrido, antes do registro do Swap.
Amortização a cada	É permitida a alteração. É necessário refazer o fluxo e a agenda de eventos.
Período	É permitida a alteração desde que não tenha existido operação de troca juros/amortização. Será refeito o fluxo e a agenda de eventos.
Data Início Pagto Amort.	É permitida a alteração. Se informada, a data deve <b>combinar</b> com uma data de pagamento de juros, ou seja, deve ser em data que também exista pagamento de juros.
Tipo Amort.	É permitida a alteração.
<b>Curvas para Atualização Parte e Contraparte</b>	
Percentual	É permitida alteração. Refazer a atualização para o próximo dia útil. Não havendo taxa de juros, o percentual pode ser diferente de 100%; havendo taxa de juros, o percentual deve ser obrigatoriamente 100%.
Curva	É permitida alteração. Refazer a atualização para o próximo dia útil. Quando for alterado para <b>VCP</b> , é obrigatório informar o campo <b>PU, Tipo de Classe e Denominação</b> . Se alterado de <b>VCP</b> para <b>Curva</b> conhecida, é obrigatório excluir os campos <b>PU, Tipo de Classe e Denominação</b> .
Sinal + / -	É permitida alteração. Refazer a atualização para o próximo dia útil. Preencher em conjunto com <b>Juros</b> . Somente os registros de contratos pactuados com base no <b>DI, DOLAR, LIBOR e TJMI</b> aceitam taxas de juros negativas.
Juros % a.a.	É permitida alteração. Refazer a atualização para o próximo dia útil. Preencher em conjunto com <b>Sinal</b> .
Lim. Inferior (floor)	
Lim. Superior (Cap)	
<b>Se Curva (s) = VCP Parte e Contraparte</b>	
PU	É permitida a alteração enquanto a primeira troca de juros ainda não houver sido realizada. Dessa forma, altera-se somente o PU inicial da primeira troca. Altera (refaz) a atualização imediatamente, somente caso o PU Atual tenha sido informado.

Campo	Descrição
Tipo/Classe	É permitida alteração, mesmo com contrato já iniciado.
Denominação	
<b>Cupom Limpo/Data Cotação Parte e Contraparte</b>	
Cupom Limpo	É permitida alteração, desde que o contrato ainda não tenha sido iniciado.
Data de Cotação	É permitida a alteração. Obrigatório se a curva da parte ou da contraparte alterada para <b>DÓLAR</b> , opções: D-1, D-2 ou D-3.
<b>Exclusivo para Curva Libor</b>	
<b><i>Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Libor Parte e Contraparte</i></b>	
Data de Cotação	É permitida a alteração. Recalcula a curva para o próximo dia útil.
Variação Cambial	É permitida a alteração. Recalcula a curva para o próximo dia útil. Quando for alterado para <b>OUTROS</b> , é obrigatório informar o campo <b>Outros - Cotação</b> . Se alterado de <b>OUTROS</b> para <b>Variação Cambial</b> conhecida, é obrigatório excluir o campo <b>Outros - Cotação</b> .
Tipo Classe	É permitida a alteração.
Data de Cotação – Variação Cambial	Data da Cotação - Variação Cambial da Parte. Possíveis Valores: <b>01</b> (D-1), <b>02</b> (D-2), <b>03</b> , (D-3), <b>04</b> (D-4), <b>05</b> (D-5).
Cupom Limpo / Outros - Cotação	É permitida a alteração. Altera (refaz) a atualização imediatamente, somente caso Cotação Atual tenha sido informada.
Alíquota IR	É permitida a alteração.
Limite Inferior (Floor)	É permitida a alteração.
Limite Superior (Cap)	É permitida a alteração.
<b>Exclusivo para Taxa Juros Mercado Internacional Parte e Contraparte</b>	
<b><i>Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Taxa Juros Mercado Internacional</i></b>	
Taxa Juros	É permitida a alteração. Recalcula a curva para o próximo dia útil.
Troca de Fluxo	É permitida a alteração. Recalcula a curva para o próximo dia útil.

Campo	Descrição
Variação Cambial	É permitida a alteração. Recalcula a curva para o próximo dia útil. Quando for alterado para <b>OUTROS</b> , é obrigatório informar o campo <b>Outros - Cotação</b> . Se alterado de <b>OUTROS</b> para <b>Variação Cambial</b> conhecida, é obrigatório excluir o campo <b>Outros - Cotação</b> .
Tipo classe	É permitida alteração.
Cupom Limpo / Outros - Cotação	É permitida a alteração. Altera (refaz) a atualização imediatamente, somente caso Cotação Atual tenha sido informada.
Alíquota IR	É permitida a alteração.
Limite Inferior (Floor)	É permitida a alteração.
Limite Superior (Cap)	É permitida a alteração.
<b>EXCLUSIVO PARA COMMODITY – Parte e Contraparte</b>	
Cotação Inicial	Cotação Inicial da Parte/Contraparte.
Código da Commodity	Código da Commodity da Parte/Contraparte. Esse campo deverá ser preenchido através do RIC. Esta informação já existe nos arquivos públicos relacionados à Mercadorias.
Data da Cotação para Ajustes	Data de Cotação para Ajuste da Parte/Contraparte. Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 5 (D-5). Dentre as opções disponíveis, a que for selecionada também será considerada para o cálculo da cotação da moeda atrelada à mercadoria.

## Alteração de Contrato - Fluxo não Constante

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Contrato – Fluxo não Constante

### Visão Geral

O Participante pode através dessa função, alterar informações registradas de um fluxo de caixa de determinado contrato, desde que não tenha ocorrido operação de troca de juros ou de amortização.

Caso o contrato tenha como contraparte a conta 20 a alteração deverá ser efetuada por duplo comando. (Ver: **Prazos para alteração**).

### Tela Filtro Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Não Constante

Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Código do Contrato 14k00079320

Ação CORREÇÃO

Pesquisar Limpar Campos Desistir

O Participante deve inserir os dados da tela e clicar no botão **Pesquisar** para acessar o contrato que se deseja alterar.

O contrato pode ser alterado mais de uma vez no mesmo dia desde que a alteração anterior esteja confirmada ou cancelada.

### Observação:

#### Contratos de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.

A alteração de contrato de swap que afete a agenda de redutor de risco de crédito não vão gerar alteração de agente de redutor de risco de crédito periódico, tais alterações deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.



## Tela de Registro de Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Não Constante

Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Não Constante			
Parte	Contraparte	CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
00074 00 5	05000 00 5		
Meu Número	Código do Contrato		
	08D00000179		
Características			
Data de Registro	Data Início	Data Vencimento	
10 / 4 / 2008	10 / 4 / 2008	4 / 8 / 2021	
Adesão a Contrato	Valor Base	Valor Total Antecipado	
SEM ADESAO	180000000 ,	0 ,	
Valor Base Atual	Valor Total Amortizado	Agenda de Prêmio	
180000000 ,	59351400 ,	NAO	
Código Estratégia		Amortiza sem troca de diferencial	
Código Identificador			
Exclusivo para Contrato à Termo			
Data Operação	Índice Termo	Perc. Termo	
Se Índice Termo			
PU Inicial/Cupom Limpo	Data de Cotação Final - Termo	Tipo/Classe	Denominação
Curvas para Atualização			
Parte		Contraparte	
Percentual		Percentual	
100 ,		100 ,	
Curva	+/-	Curva	+/-
LIBOR DOLAR 06M	+ ▼	DOLAR DOS EUA	+ ▼
Juros(% aa)	Lim. Inferior (Floor)	Juros(% aa)	Lim. Inferior (Floor)
3 ,		6 ,	
Lim. Superior (Cap)		Lim. Superior (Cap)	
Se Curva(s) = "VCP":			
Parte		Contraparte	
PU	Tipo/Classe	PU	Tipo/Classe
Denominação		Denominação	
Cupom Limpo/Data Cotação			
Parte		Contraparte	
Cupom Limpo	Data Informação Cupom Limpo	Cupom Limpo	Data Informação Cupom Limpo
		1 , 7000000	
Data de Cotação		Data de Cotação	
		D-1	

(continua)

Exclusivo para curva "Libor"					
Parte			Contraparte		
Data de Cotação - Libor D-1	Variação Cambial DOLAR		Data de Cotação - Libor	Variação Cambial	
Tipo Classe	Data da Cotação - Variação Cambial		Tipo Classe	Data da Cotação - Variação Cambial	
Cupom Limpo / Outros - Cotação 1, 7000000	Alíquota IR		Cupom Limpo / Outros - Cotação	Alíquota IR	
Limite Inferior (Floor) - Perc.	Limite Superior (Cap) - Perc.		Limite Inferior (Floor) - Perc.	Limite Superior (Cap) - Perc.	
Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional"					
Parte			Contraparte		
Taxa Juros	Troca de Fluxo		Taxa Juros	Troca de Fluxo	
Variação Cambial	Tipo Classe		Variação Cambial	Tipo Classe	
Cupom Limpo / Outros - Cotação	Alíquota IR		Cupom Limpo / Outros - Cotação	Alíquota IR	
Limite Inferior (Floor) - Perc.	Limite Superior (Cap) - Perc.		Limite Inferior (Floor) - Perc.	Limite Superior (Cap) - Perc.	
Exclusivo para Commodity					
Parte			Contraparte		
Cotação Inicial	Codigo da Commodity	Data da Cotação para Ajuste	Cotação Inicial	Codigo da Commodity	Data da Cotação para Ajuste
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>					

(fim)

Após alterar as informações desejadas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela, onde o Participante pode conferir os dados alterados, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação e posteriormente tela para prosseguir com o **Registro de Fluxo de Caixa**.

### Descrição dos Campos da Tela de Registro de Alteração de Contrato- Fluxo de Caixa Não Constante

Campo	Permissão para alteração / Observações
Parte e Contraparte	Não podem ser alterados.
CPF/CNPJ Parte e Contraparte	Não podem ser alterados.
Meu Número	O original não pode ser alterado, mas deve ser informado um novo para a operação de alteração.
Código do contrato	Não pode ser alterado.
Características	

Campo	Permissão para alteração / Observações
Data Início	<p>É permitida alteração desde que seja: <b>Igual à data de registro</b> ou <b>Igual a D-2 da data de registro</b>.</p> <p>Maior que a data de registro para contratos a termo. Quando contrato a termo, com previsão de índice de atualização do Valor Base, esta data só poderá ser alterada quando contrato não iniciado.</p> <p>Não pode ser menor do que a Data Operação, exceto quando operação realizada com Cliente 1, limitado a D-2.</p> <p>A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.</p>
Data Vencimento	<p>É permitida alteração, desde que não seja a data atual do sistema. Deve ser maior que Data Início.</p> <p>A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.</p>
Adesão a Contrato	É permitida alteração.
Valor Base	<p>É permitida alteração. No caso de contratos à vista, o sistema desconsidera a atualização das curvas, sendo apresentadas com os novos valores no dia seguinte, atualizados desde a data de início, sobre o novo <b>Valor Base</b>.</p> <p>Quando contratos a termo, o sistema assume, no dia seguinte à alteração, o novo Valor Base informado pelos Participantes e atualiza pelo parâmetro pactuado (caso haja) até a data de início.</p>
Valor Total Antecipado	Valor total antecipado.
Valor Base Atual	Valor base atualizado.
Valor Total Amortizado	Valor total amortizado.
Agenda de Prêmio	Não pode ser alterado. Indica se no contrato que está sendo registrado existirá o pagamento de prêmio.
Código Estratégia	Informar o código da estratégia, cadastrada e habilitada para o Participante pela Cetip, que se deseja vincular ao contrato.
Amortiza sem troca de diferencial	<p>Caixa de Seleção com as opções: Sim ou Não.</p> <p>Quando Seleccionada a opção Sim, se uma das curvas for moeda ou índice de preços registrar a(s) mesma(s) como VCP.</p>
Código identificador	
<b>Exclusivo para Contrato à Termo</b>	

Campo	Permissão para alteração / Observações
Data Operação	<p>É permitido alteração. Somente para dia útil.</p> <p>Data de quando a operação foi pactuada a termo, ou seja, ainda não teve início.</p> <p>Se for contrato a termo COM previsão de índice de atualização do Valor Base, somente poderá ser alterada se ainda não estiver iniciado.</p> <p>Se for contrato a termo SEM previsão de índice de atualização, a data pode ser alterada, mesmo que este já tenha iniciado.</p> <p>Há reprocessamento da atualização do Valor Base desde a data do registro ou início até o dia da alteração.</p>
Índice Termo	<p>É permitida alteração (se contrato ainda não iniciado). Altera (refaz) a atualização para o dia seguinte ao de alteração (caso haja troca de índice ou inclusão de índice).</p> <p>Quando for alterado para <b>VCP</b>, é obrigatório informar o campo <b>PU inicial, Tipo de Classe e Denominação</b>. Se alterado de <b>VCP</b> para <b>Índice Termo</b> conhecido, é obrigatório excluir os campos <b>PU inicial, Tipo de Classe e Denominação</b>.</p>
Perc. Termo	<p>É permitida alteração (se contrato ainda não iniciado). Deve ser preenchido se o <b>Índice Termo</b> for informado. Participa do cálculo referido no item anterior.</p>
<b>Se Índice Termo</b>	
PU Inicial/Cupom Limpo	<p>É permitida alteração (se contrato ainda não iniciado). Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser <b>VCP</b>. Altera (refaz) a atualização imediatamente, somente caso o PU Atual tenha sido informado.</p>
Data de Cotação Final – Termo	<p>Campo de preenchimento obrigatório para quando o campo “Índice termo” seja qualquer moeda disponível em seu domínio.</p> <p>Utilizado para informar o deslocamento da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor final para valorização da curva do contrato quando índice termo for moeda.</p> <p>Possíveis valores: (01) D-1; (02) D-2; (03) D-3; (04) D-4; (05) D-5;</p>
Tipo/Classe	<p>É permitida alteração, mesmo com contrato já iniciado.</p>
Denominação	<p>É permitida alteração, mesmo com contrato já iniciado.</p>
<b>Curvas para Atualização – Parte e Contraparte</b>	
Percentual	<p>É permitida alteração. Não havendo taxa de juros, o percentual pode ser diferente de 100%; havendo taxa de juros, o percentual deve ser obrigatoriamente 100%.</p> <p>Refaz a atualização para o próximo dia útil. A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.</p>

Campo	Permissão para alteração / Observações
Curva	<p>É permitida alteração. Quando for alterado para <b>VCP</b>, é obrigatório informar o campo <b>PU</b>, <b>Tipo de Classe</b> e <b>Denominação</b>.</p> <p>Se alterado de <b>VCP</b> para <b>Curva</b> conhecida, é obrigatório excluir os campos <b>PU</b>, <b>Tipo de Classe</b> e <b>Denominação</b>.</p> <p>Refaz a atualização para o próximo dia útil. A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.</p>
Sinal + / -	<p>É permitida alteração.</p> <p>Preencher em conjunto com <b>Juros</b>. Somente os registros de contratos pactuados com base no <b>DI</b>, <b>DOLAR</b>, <b>LIBOR</b> e <b>TJMI</b> aceitam taxas de juros negativas.</p> <p>Refaz a atualização para o próximo dia útil. A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.</p>
Juros % a . a	<p>É permitida alteração. Preencher em conjunto com <b>Sinal + / -</b>.</p> <p>A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato. Refaz a atualização para o próximo dia útil.</p>
Lim. Inferior (floor)	
Lim. Superior (Cap)	
<b>Se Curva (s) = VCP – Parte e Contraparte</b>	
PU	<p>É permitida a alteração enquanto a primeira troca de juros ainda não houver sido realizada. Dessa forma, altera-se somente o PU inicial da primeira troca. Altera (refaz) a atualização imediatamente, somente caso o PU Atual tenha sido informado.</p>
Tipo/Classe	<p>É permitida alteração, mesmo com contrato já iniciado.</p>
Denominação	<p>É permitida alteração, mesmo com contrato já iniciado.</p>
<b>Cupom Limpo/Data Cotação - Parte e Contraparte</b>	
Cupom Limpo	<p>É permitida alteração, desde que o contrato ainda não tenha sido iniciado.</p>
Data de Cotação	<p>É permitida a alteração. Obrigatório se a curva da parte ou da contraparte for <b>DÓLAR</b>, opções: D-1, D-2 ou D-3.</p>
<b>Exclusivo para Curva Libor - Parte e Contraparte</b>	
<b><i>Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Libor</i></b>	
Data de Cotação	<p>É permitida a alteração desde que não tenha havido operação de troca de juros. Recalcula a curva para o próximo dia útil.</p>

Campo	Permissão para alteração / Observações
Variação Cambial	É permitida a alteração. Recalcula a curva para o próximo dia útil. Quando for alterado para <b>OUTROS</b> , é obrigatório informar o campo <b>Outros - Cotação</b> . Se alterado de <b>OUTROS</b> para <b>Variação Cambial</b> conhecida, é obrigatório excluir o campo <b>Outros - Cotação</b> .
Tipo classe	É permitida a alteração.
Data de Cotação – Variação Cambial	Data da Cotação - Variação Cambial da Parte. Possíveis Valores: <b>01</b> (D-1), <b>02</b> (D-2), <b>03</b> , (D-3), <b>04</b> (D-4), <b>05</b> (D-5).
Cupom Limpo / Outros - Cotação	É permitida a alteração. Altera (refaz) a atualização imediatamente, somente caso a Cotação Atual tenha sido informada.
Alíquota IR	É permitida a alteração.
Limite Inferior (Floor)	É permitida a alteração desde que não tenha havido operação de troca de juros. A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.
Limite Superior (Cap)	É permitida a alteração. A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.
<b>Exclusivo para Taxa Juros Mercado Internacional - Parte e Contraparte</b>	
<b><i>Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Taxa Juros Mercado Internacional</i></b>	
Taxa Juros	É permitida a alteração. Recalcula a curva para o próximo dia útil. A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.
Troca de Fluxo	É permitida a alteração. Recalcula a curva para o próximo dia útil. A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.
Variação Cambial	É permitida a alteração. Recalcula a curva para o próximo dia útil. Quando for alterado para <b>OUTROS</b> , é obrigatório informar o campo <b>Outros - Cotação</b> . Se alterado de <b>OUTROS</b> para <b>Variação Cambial</b> conhecida, é obrigatório excluir o campo <b>Outros - Cotação</b> .
Tipo classe	É permitida a alteração.
Cupom Limpo / Outros - Cotação	É permitida a alteração. Altera (refaz) a atualização imediatamente, somente caso a Cotação Atual tenha sido informada.
Alíquota IR	É permitida a alteração desde que não tenha havido operação de troca de juros.

<b>Campo</b>	<b>Permissão para alteração / Observações</b>
Limite Inferior (Floor)	É permitida a alteração. A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.
Limite Superior (Cap)	É permitida a alteração. A alteração deste campo obriga ao Participante e redefinir todo fluxo de caixa deste contrato.
<b>EXCLUSIVO PARA COMMODITY - Parte/Contraparte</b>	
Cotação Inicial	Cotação Inicial da Parte/Contraparte.
Código da Commodity	Código da Commodity da Parte/Contraparte. Esse campo deverá ser preenchido através do RIC. Esta informação já existe nos arquivos públicos relacionados à Mercadorias.
Data da Cotação para Ajustes	Data de Cotação para Ajuste da Parte/Contraparte. Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 5 (D-5). Dentre as opções disponíveis, a que for selecionada também será considerada para o cálculo da cotação da moeda atrelada à mercadoria.

## Alteração de Fluxo de Caixa Não Constante

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Fluxo de Caixa Não Constante

### Visão Geral

O Participante pode através dessa função, alterar informações registradas de um fluxo de caixa de determinado contrato, desde que não tenha ocorrido operação de troca de juros ou de amortização.

Caso o contrato tenha como contraparte a conta 20 a alteração deve ser efetuada por duplo comando. (Ver: **Prazos para alteração**)

### Tela Filtro Alteração de Fluxo de Caixa - Não Constante

Alteração de Fluxo de Caixa - Não Constante

Código do Contrato

Ação

Alterar Número de Datas de Eventos

Número de Datas de Eventos

O Participante deve inserir os dados da tela e clicar no botão **Pesquisar** para acessar o contrato que se deseja alterar.

### Observação:

#### Contratos de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.

A alteração de contrato de swap que afete a agenda de redutor de risco de crédito não vão gerar alteração de agente de redutor de risco de crédito periódico, tais alterações deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

### Descrição do campo da Tela de Filtro Alteração de Fluxo de Caixa

Campo	Descrição
Código do Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Código do Contrato a ser pesquisado.
Alterar Número de Datas de Eventos	Campo de preenchimento obrigatório. Indica se o número de datas de eventos será alterado. Caixa de Seleção com as opções: <b>Vazio</b> , <b>SIM</b> e <b>NÃO</b> .



Campo	Descrição
Número de Datas de Eventos	Campo de preenchimento obrigatório, se no campo <b>Alterar Número de Datas de Eventos</b> for selecionada a opção <b>SIM</b> . Número desejado de datas de eventos para o fluxo.

### Tela de Registro Alteração de Fluxo de Caixa - Não Constante

Alteração de Fluxo de Caixa - Não Constante					
Contrato					
Código IF		Data Início		Data Vencimento	
14K00127556		17/11/2014		21/11/2014	
Ponta 1		Ponta 2			
05000.00-5		05000.10-8			
Ponta 1 (Nome Simplificado)		Ponta 2 (Nome Simplificado)			
RIOBM		RIOBM			
Curva Ponta 1		Curva Ponta 2			
LIBOR DOLAR 01M		DI			
Tipo Amortização		Meu Número			
Sobre valor Base Original	▼	123			
Fluxo Não Constante Ponta 1					
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
18 / 11 / 2014	▼				50
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
21/11/2014	▼				50
Fluxo Não Constante Ponta 2					
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
18 / 11 / 2014	▼				50
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
21/11/2014	▼				50
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>					

Após alterar as informações desejadas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela, onde o Participante pode conferir os dados alterados, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

### Descrição dos Campos da Tela de Registro de Alteração de Fluxo de Caixa

Campo	Permissão para alteração / Observações
Tipo Amortização	Se alterado, o valor desse campo é criticado em conjunto com o campo <b>Taxa Amortização</b> .

Campo	Permissão para alteração / Observações
Meu Número	Não é permitida alteração quando número de eventos não for alterado. Ao efetuar uma alteração que não seja sobre o número de eventos, deve ser informado um novo número para a operação.
Data Último Pagto. Juros	Disponível para preenchimento somente quando uma das pontas do contrato utilizar como parâmetro a curva Libor.
<b>Fluxo Não Constante Ponta 1 / Fluxo Não Constante Ponta 2</b>	
Data	É permitida alteração.
+/-	É permitida alteração.
Juros (% aa)	É permitida alteração.
Lim. Inferior	Possibilidade de alteração depende das informações incluídas no contrato original deste fluxo.
Lim. Superior	Possibilidade de alteração depende das informações incluídas no contrato original deste fluxo.
Taxa Amortização	É permitida alteração. Os valores atribuídos a esse campo serão criticados em conjunto com o campo <b>Tipo Amortização</b> .

## Alteração de Fluxo de Data de Verificação

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Fluxo de Data de Verificação

### Visão Geral

Esta tela funciona da mesma maneira do Registro e o participante pode alterar a quantidade de datas e/ou o valor das mesmas.

#### Tela de Alteração de Fluxo de Data de Verificação

Alteração de Fluxo de Data de Verificação

Código do Contrato

Alterar Número de Datas de Verificação  ▼

Quantidade de Datas de Verificação Parte

Quantidade de Datas de Verificação ContraParte

Pesquisar
Limpar Campos
Desistir

#### Descrição dos Campos da Tela Alteração de Fluxo de Data de Verificação

Campo	Descrição
Código do Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Código do Contrato
Alterar Número de Datas de Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa com as opções: SIM e NÃO.
Quantidade de Datas de Verificação Parte	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Quantidade de Datas de Verificação Parte. Utilizada somente quando for aplicada média asiática (simples ou ponderada).
Quantidade de Datas de Verificação Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Quantidade de Datas de Verificação Contraparte. Utilizada somente quando for aplicada média asiática (simples ou ponderada).

Após confirmação, aparece a tela abaixo onde o participante coloca as novas datas e pesos.

## Tela Alteração de Fluxo de Data de Verificação

Alteração de Fluxo de Data de Verificação		
Contrato		
Código IF	Data Início	Data Vencimento
14K00202544	19/11/2014	28/11/2014
Código Parte	Código Contraparte	
05000.00-5	10020.00-1	
Parte (Nome Simplificado)	Contraparte (Nome Simplificado)	
RIOBM	LEMEBM	
Curva Parte	Curva Contraparte	
COMMODITIES	DI	
Meu Número		
1421		
Ponta 1	Ponta 2	
Data da Verificação 20/11/2014		
Data da Verificação 21/11/2014		

## Descrição dos Campos da Tela Registro de Data de Verificação

Campo	Descrição
<b>Contrato – Campo de preenchimento obrigatório.</b>	
Meu Número	Número atribuído à operação.
<b>Ponta 1</b>	
Data de Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando for escolhido Média Asiática.</p> <p>É exibido na tela as datas de referência para avaliação e posterior apuração do valor financeiro do SWAP. Devem ser indicadas, pelo menos, duas datas de verificação.</p>
Pesos (%)	<p>Preencher quando a média asiática for ponderada. Caso a média seja simples, os campos de peso não aparecem para preenchimento.</p> <p>Indica a porcentagem do Valor Base que a cotação apurada na data de verificação irá representar para apuração final da taxa média aritmética ponderada.</p>

## Alteração de Pagamento de Prêmio

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Pagamento de Prêmio

### Visão Geral

O Participante pode através dessa função, incluir, alterar ou excluir a quantidade e/ou informações registradas de pagamentos de prêmio de determinado contrato.

Prazo para alteração

Na data do registro do contrato (D-0), é permitida a alteração da agenda de prêmios, quantas vezes forem necessárias.

A partir de D+1 útil do registro e até em D+3 útil do registro, inclusive, em contratos entre conta própria e seus clientes ou entre clientes, é permitida a alteração da agenda de prêmios, sendo permitido, no máximo, uma alteração por dia. Observando que tal alteração pode ser efetuada somente até D-1 do vencimento.

Não é permitido cancelamento de operação de alteração de agenda de prêmios e a alteração da quantidade de prêmios para no mínimo 1 prêmio.

Seguem os campos da tela de registro e as observações cabíveis quanto à possibilidade de alteração.

Tipo da Operação	Prazos para alterações
<p><b>À vista</b>, com contrato registrado em <b>D</b>; data de início em <b>D</b>, agenda de prêmios para <b>D+n</b></p>	<p>Se não existe operação de pagamento de prêmio para <b>D</b>:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ Permitida alteração (inclusões e exclusões) da agenda de prêmios das datas <b>D</b> até <b>D+n</b>.</li> </ul>
<p><b>À termo</b>, com contrato registrado em <b>D</b>; data de início em <b>D+n</b>, agenda de prêmios para <b>D+n</b></p>	
<p><b>À vista</b>, com contrato registrado em <b>D</b>; data de início em <b>D</b>, agenda de prêmios para <b>D+n</b>, operação de pagamento de prêmio em <b>D</b> e <b>D+1</b></p>	<p>Se operação de pagamento de prêmio com status Pendente de Liquidação Financeira:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ É permitida alteração da agenda de prêmios somente para os prêmios futuros;</li> <li>▪ Não é permitida alteração do prêmio da data de registro, se houver essa necessidade o participante deve cancelar a operação de pagamento de prêmio, assim o sistema cancela automaticamente a agenda de prêmios e retorna o status do contrato para Pendente de Agenda de Prêmios para nova definição do fluxo de pagamentos de prêmio.</li> </ul>
<p><b>À termo</b>, com contrato registrado em <b>D</b>; data de início em <b>D+n</b>, agenda de prêmios para <b>D+n</b>, operação de pagamento de prêmio em <b>D</b> e <b>D+1</b></p>	

### Contrato com clientes próprios e entre clientes

Tipo da Operação	Prazos para alterações
<b>À vista</b> , com contrato registrado em <b>D</b> , Data de Início em <b>D</b> , Agenda de Prêmios para <b>D+n</b>	Se não existe operação de pagamento de prêmio para <b>D</b> : <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ É permitida alteração (inclusões e exclusões) da agenda de prêmios das datas <b>D</b> até <b>D+n</b>.</li> </ul>
<b>À termo</b> , com contrato registrado em <b>D</b> , Data de Início em <b>D+n</b> , Agenda de Prêmios para <b>D+n</b>	Se existe operação de pagamento de prêmio: <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ É permitida alteração da agenda de prêmios somente para os prêmios futuros.</li> </ul>
<b>À vista</b> , com contrato registrado em <b>D</b> , Data de Início em <b>D</b> , Agenda de Prêmios para <b>D+n</b> , operação de prêmio em <b>D</b> e <b>D+n</b>	Se operação de pagamento de prêmio com status Finalizado: <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ É permitida alteração da agenda de prêmios somente para os prêmios futuros;</li> <li>▪ Para alteração do prêmio da data de registro, é necessário primeiramente o cancelamento da operação de pagamento de prêmio, o sistema cancela automaticamente a agenda de prêmios e retorna o status do contrato para Pendente de Agenda de Prêmios para nova definição do fluxo de pagamentos de prêmio.</li> </ul>
<b>À termo</b> , com contrato registrado em <b>D</b> , Data de Início em <b>D+n</b> , Agenda de Prêmios para <b>D+n</b> , operação de prêmio em <b>D</b> e <b>D+n</b>	

**Observação1:** Para incluir os prêmios deve ser informado um número maior do que o registrado, assim como para excluir o valor informado deve ser menor, desde que fique no mínimo, com pagamento registrado.

**Observação2:**

#### Contratos de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.

A alteração de contrato de swap que afete a agenda de redutor de risco de crédito não vai gerar alteração de agente de redutor de risco de crédito periódico, tais alterações deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

#### Tela Filtro Alteração de Pagamento de Prêmio

##### Alteração de Pagamento de Prêmio

Código do Contrato

Quantidade de Prêmios

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

O Participante deve inserir os dados da tela e clicar no botão **Pesquisar** para acessar o contrato que se deseja alterar.

### Tela de Registro de Alteração de Pagamento de Prêmio

Alteração de Pagamento de Prêmio		
Contrato		
<b>Código do Contrato</b> 14K00079310	<b>Data Início</b> 14/11/2014	<b>Data Vencimento</b> 14/12/2014
<b>Ponta 1</b> 05000.00-5	<b>Ponta 2</b> 05000.10-8	
<b>Ponta 1 (Nome Simplificado)</b> RIOBM	<b>Ponta 2 (Nome Simplificado)</b> RIOBM	<b>Meu Número</b> <input type="text" value="3339"/>
<b>Curva Ponta 1</b> DOLAR DOS EUA	<b>Curva Ponta 2</b> DI	<b>Papel</b> PONTA 1
Eventos de Prêmio		
<b>Data</b> 17/11/2014	<b>Valor do Prêmio</b> 5,00	<b>Titular</b> PONTA 1
<b>Data</b> <input type="text" value="19"/> / <input type="text" value="11"/> / <input type="text" value="2014"/>	<b>Valor do Prêmio</b> <input type="text" value="5"/> , <input type="text"/>	<b>Titular</b> <input type="text" value="PONTA 1"/> ▼
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Após alterar as informações desejadas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados alterados, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

### Descrição dos Campos da Tela de Registro de Alteração de Pagamento de Prêmio

Campo	Descrição
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído a operação de registro de fluxo de caixa não constante. Número interno de cada participante identificando o lançamento.
Papel	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a ponta que está efetuando a atualização. Caixa de Seleção com as opções: <b>Ponta1</b> ou <b>Ponta2</b> .
Data	Campo de preenchimento obrigatório. Data em que ocorrerá o pagamento do prêmio.
Valor do Prêmio	Campo de preenchimento obrigatório. Informa o valor do prêmio. Valor Financeiro do Prêmio com duas casas decimais.
Titular	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a ponta que pagará o prêmio. Caixa de Seleção com as opções: <b>Ponta1</b> ou <b>Ponta2</b> .

## Antecipação de Contratos

Menu Swap > Lançamentos > Antecipação de Contratos

### Visão Geral

Esta função permite aos Participantes realizar a antecipação parcial ou total de contrato de swap.

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

O valor da antecipação deve ser apurado com base nos dois indicadores econômicos 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 Cetip.

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 Cetip.

### Tela Filtro Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato

Código do Contrato 14K00079315

Pesquisar Limpar Campos Desistir

O Participante deve inserir o código do contrato e clicar no botão **Pesquisar** para acessar o contrato que se deseja antecipar.

Na necessidade de antecipação de contrato com Reset nas datas de liquidação de Reset o Participante deve registrar a operação por meio da função “Registro de Reset”.

Na operação de antecipação são informados os fatores para atualização do Valor Base remanescentes e valor a antecipar, cuja diferença é o último resultado financeiro do contrato. É calculado conforme as fórmulas abaixo:

- **Valor Antecipação total** = (Valor Base remanescente \* Fator Participante) - (Valor Base remanescente \* Fator Contraparte), onde valor base remanescente = valor base original decrescido das amortizações já efetuadas.

A Antecipação total é realizada quando as partes quitam a dívida original e para que isto seja refletido no Swap, é necessário que o Valor Base seja antecipado totalmente, terminando o contrato.



- **Valor Antecipação parcial** = (Valor a antecipar \* Fator para Antecipação - Participante) - (Valor a antecipar \* Fator para Antecipação - Contraparte), onde valor a antecipar = valor informado pelo Participante / contraparte que deve ser menor ou igual ao valor base remanescente do contrato e Fator para Antecipação = fator de atualização do valor base a antecipar.

### Tela de Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato	
Código do Contrato	14K00079315
Papel	PONTA 1
Ponta 1	05000.00-5
Ponta 2	10020.00-1
Ponta 1 (Nome Simplificado)	RIOBM
Ponta 2 (Nome Simplificado)	LEMEBM
Valor Base Remanescente	1.000,00
Cesta de Garantias (Ponta 1)	
Cesta de Garantias (Ponta 2)	
Meu Número	4444
Fator para Antecipação (Ponta 1)	1, 1
Fator para Antecipação (Ponta 2)	1, 2
Data de Antecipação	17/11/2014
Valor para Antecipação	500,
Mantém Prêmios	SIM
Liquidação Financeira	
Liquidante	Modalidade
	Bruta
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Após preencher as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

### Descrição dos Campos da Tela Antecipação de Contrato

Campo	Descrição
Meu Número	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número atribuído pelo participante, que estiver realizando a operação de antecipação.</p>
Fator para Antecipação (Ponta 1)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Se Antecipação Total: fator para atualização do Valor Base remanescente, compondo o financeiro da ponta do Participante.</p> <p>Se Antecipação Parcial: fator para atualização do valor a ser antecipado (informado no campo "Valor para Antecipação"), compondo o financeiro da ponta do Participante.</p> <p>Preenchido com 10 (dez) inteiros e 8 (oito) casas decimais.</p>

Campo	Descrição
Fator para Antecipação (Ponta 2)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Se Antecipação Total: fator para atualização do Valor Base remanescente, compondo o financeiro da ponta da Contraparte.</p> <p>Se Antecipação Parcial: fator para atualização do valor a ser antecipado (informado no campo "Valor para Antecipação"), compondo o financeiro da ponta da Contraparte.</p> <p>Preenchido com 10 (dez) inteiros e 8 (oito) casas decimais.</p>
Data de Antecipação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data de antecipação do contrato. Caixa de Seleção utilizado apenas se, no filtro, uma das contas for de cliente 1. Neste caso pode ser preenchido com a data atual ou com D-2. Se não houver conta de cliente 1, a caixa vem protegida com <b>Data Atual</b>.</p>
Valor para Antecipação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Valor total ou parcial a antecipar do contrato. Preenchido com 10 inteiros e 2 casas decimais.</p>
Mantém Prêmios	<p>Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de Seleção com as opções: Vazio, SIM e NÃO.</p> <p>Em caso de antecipação total, esse campo não deve ser considerado ficando o mesmo com a opção Vazio. Em caso de antecipação parcial:</p> <p>Se informado Sim, indica que os pagamentos de prêmios agendados após a data da antecipação parcial devem ser mantidos.</p> <p>Se informado Não, indica que os pagamentos de prêmios agendados após a data de antecipação parcial serão cancelados automaticamente pelo sistema.</p>

#### Observações:

##### Contratos com Fluxo de Caixa – Antecipação Parcial:

1) Quando o contrato tiver previsão de amortização do "Tipo 0" – percentuais incidentes sobre o Valor Base Original – será aplicado um fator de ajuste sobre os percentuais de amortização a decorrer (eventos futuros) originalmente informados, para que os mesmos passem a refletir a antecipação efetuada.

2) Caso haja previsão de amortização do "Tipo 1" – percentuais incidentes sobre Valor Base Remanescente não haverá ajuste dos percentuais de amortização a decorrer (eventos futuros).

##### Contratos de Swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito

1) O registro de antecipação total de contrato vai gerar antecipação de agenda de redutor de risco de crédito com liquidação financeira do saldo pela mesma modalidade de liquidação da operação do contrato original. Para esses casos também é gerado um novo evento na agenda do DRRC indicando seu tipo e sua situação.

2) As antecipações parciais também vão gerar operações de antecipação de agenda de redutor de risco de crédito, nesse caso o saldo do redutor de risco de crédito liquidado será proporcional ao percentual antecipado do contrato original. Para esses casos também é gerado um novo evento na agenda do DRRC indicando seu tipo e sua situação. Para maiores detalhes a respeito da metodologia de cálculo aplicada para esses casos, consulte o “Cadernos de Fórmulas – DRRC” disponível no site <http://www.cetip.com.br>.

### Possibilidade de antecipação nos contratos com Fluxo Constante e Não Constante

#### Possibilidade de antecipação nos contratos com FLUXO Constante e Não Constante

	Antecipação Parcial	Antecipação Total
Contrato a termo	Sim, mas somente da data de início até D-1 da data de vencimento	Sim. De D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento.
Contrato à vista	Sim, De D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento	Sim. De D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento.
Operação de antecipação decorrida.	Sim, somente para contratos que envolvam clientes 1. É acatado registro de antecipação parcial retroativa de até 2 (dois) dias úteis, se e somente se não houver ocorrido evento no período entre a data do registro e a data da antecipação retroativa. Se um contrato for registrado a termo e já iniciou, as antecipações retroativas não podem se referir à data anterior ao dia de início do contrato.	Sim, somente para contratos que envolvam clientes 1 e registro retroativo de até 2 (dois) dias úteis e de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento.
Operação de Antecipação em data de eventos com amortização	Sim	Sim
Operação de Antecipação em data de eventos apenas de juros	Sim	Sim
Operação de Antecipação decorrida em Datas de Eventos	Sim	Não

### Possibilidade de ANTECIPAÇÃO nos Contratos de Pagamento Final

	Antecipação Parcial	Antecipação Total
Contrato a termo	Sim, de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento	Sim, de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento
Contrato à vista	Sim, de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento	Sim, de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento
Operação de antecipação decorrida.	Sim, somente para contratos que envolvam clientes 1. É acatado registro de antecipação parcial retroativa de até 2 (dois) dias úteis. Se um contrato for registrado a termo e já iniciou, as antecipações retroativas não podem se referir à data anterior ao dia de início do contrato.	Sim, somente para contratos que envolvam clientes 1 e registro de até 2 (dois) dias úteis e de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento.

### Possibilidades de antecipação nos contratos COM e SEM MODALIDADE

Tipos de Contratos	Knock In	Knock Out	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio
À vista Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.	No primeiro dia útil posterior à data de início até a data do vencimento, exclusive.	No primeiro dia útil posterior à data de início até a data de vencimento, exclusive se não disparar o trigger.	No primeiro dia útil posterior à data de início até a data do vencimento, exclusive, se o trigger não for disparado.	Não se aplica.	No primeiro dia útil posterior à data de início (D), até a data de vencimento, exclusive.	No primeiro dia útil posterior à data de início (D), até a data de vencimento, exclusive.
À termo Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N.	Não se aplica.	Não se aplica.	Não se aplica.	Se exercida a opção, no primeiro dia útil posterior a D+N, até data de vencimento, exclusive.	Não se aplica.	No primeiro dia útil posterior a D+N, até data de vencimento, exclusive.

Tipos de Contratos	Knock In	Knock Out	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio
À vista com Cliente1 Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.	No primeiro dia útil posterior à data de início até a data do vencimento, exclusive	No primeiro dia útil posterior a D, até a data de vencimento, exclusive	No primeiro dia útil posterior à data de início até a data do vencimento, exclusive. Se o trigger não for disparado	Não se aplica.	No primeiro dia útil posterior à data de registro (D+1 ou 2), até a data de vencimento, exclusive.	No primeiro dia útil posterior à data de registro (D+1 ou 2), até a data de vencimento, exclusive.
À termo decorrido Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.	Não se aplica.	Não se aplica.	Não se aplica.	Se exercida a opção, no primeiro dia útil posterior a D+N, até data de vencimento, exclusive.	Não se aplica.	No primeiro dia útil posterior a D+N, até data de vencimento, exclusive.

#### CONTRATOS SEM MODALIDADE

À vista Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D) até a data de vencimento, exclusive.
À termo Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de registro (D+N+1) até a data de vencimento, exclusive.
À vista com Cliente1 Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D+1 ou 2) até a data de vencimento, exclusive.
À termo decorrido Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de registro (D+N+1) até a data de vencimento, exclusive.

## Antecipação referente aos prêmios e comissões

### Situação dos prêmios e comissões na antecipação dos contratos

Pagamento da COMISSÃO de intermediação de contrato na <b>DATA DE INÍCIO</b> .	A comissão tem curso normal de liquidação.
Pagamento do PRÊMIO da <b>OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO</b> .	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade <b>KNOCK IN</b> . (O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade <b>KNOCK OUT</b> . (O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade <b>KNOCK IN-OUT</b> . (O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade <b>SWAPTION A TERMO</b> . (Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 na data de início).	Pagamento Prêmio 1, tem curso normal. Pagamento Prêmio 2, depois de exercida a opção, o pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade <b>COMPOUND SWAPTION</b> . (Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).	Pagamento Prêmio 1, tem curso normal. Pagamento Prêmio 2: <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Antes de exercida a opção:</b> É cancelado automaticamente. <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ <b>Depois de exercida a opção:</b> O pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.</li> </ul> </li> </ul>
Pagamento de PRÊMIO da modalidade <b>SWAP COM PRÊMIO</b> .	Pagamento Prêmio 1, tem curso normal.

## Cessão de Contrato

Menu Swap > Lançamentos > Cessão de Contrato

### Visão Geral

Através dessa função, o Participante pode realizar a cessão de contrato de Swap Fluxo de Caixa com Fluxo Constante, Não Constante e Pagamento Final com a possibilidade de pagamento de prêmio. A cessão pode ser efetuada a qualquer momento entre a data de registro e a de vencimento do contrato, exclusive. Não é admitida a cessão parcial do contrato. A cessão do contrato a termo é possível da data de registro até a data de vencimento, exclusive. É permitida a cessão de contratos envolvendo contas de cliente 1 e 2.

O lançamento da cessão de contrato é efetuado pelo Cedente e Adquirente com a necessidade de confirmação do Anuente, sendo essa confirmação efetuada pela função **Manutenção de Operações Pendentes** do produto **Operações**, através da opção **Confirmar**. Existindo prêmio na operação, somente o cedente ou o adquirente pode ser titular da mesma.

A cessão de contrato em que haja pagamento de prêmio é concretizada simultaneamente à respectiva liquidação financeira.

### Tela de Cessão de Contrato

Cessão de Contrato

Cedente 05000,00,5

Adquirente 01409,00,2

CPF/CNPJ (Adquirente)

Código do Contrato 14K00202512

Contrato Inadimplente NAO

Meu Número 132468

Papel CEDENTE

Anuente 10020,00,1

Valor do Prêmio

Titular do Prêmio

Enviar Limpar Campos Desistir

Após preencher com as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação e a **necessidade de confirmação pela Contraparte**.

**Observação 1:** A cessão de contrato que envolva conta de cliente 1 obedece aos seguintes critérios:

- 1) A conta de cliente 1 pode ser cedente na operação de cessão;
- 2) A conta de cliente 1 pode ser adquirente somente quando a conta própria for anuente da operação cessão;
- 3) A conta de cliente 1 não pode ser anuente da operação de confirmação de cessão; e
- 4) Não é permitida informação de prêmio.

**Observação 2:** Não é permitida a cessão de contrato de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.

**Observação 3:** Não é permitida a cessão parcial de contrato de swap.

### Descrição dos Campos da Tela de Cessão de Contrato

Campo	Descrição / Orientação
Cedente	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro que cede o contrato.
Adquirente	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica quem adquire o contrato.
CPF / CNPJ (Adquirente)	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes.
Código do Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Número do contrato gerado pelo sistema quando foi realizado o registro da operação de Swap.
Contrato Inadimplente	Campo de preenchimento obrigatório. Indica se o contrato em questão está inadimplente ou não
Meu número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído ao contrato de cessão.
Papel	Campo de preenchimento obrigatório. Indica quem está efetuando a operação. Caixa de Seleção com as opções <b>CEDENTE, ADQUIRENTE</b> .
Anuente	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip que identifica o membro que está mantendo a operação original de Swap.



Campo	Descrição / Orientação
Valor do Prêmio	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor do prêmio a ser pago. Não é necessário que o valor do prêmio seja o mesmo pago na operação original. O preenchimento não é obrigatório. Caso o campo não seja preenchido as partes não se obrigam, ou seja, apenas realizam a cessão do contrato.
Titular do Prêmio	Campo de preenchimento obrigatório se for preenchido o campo <b>Valor do Prêmio</b> . Indica a ponta que pagará o prêmio, se houver.

### Confirmação de Cessão de Contrato (Cedente ou Adquirente)

Após o lançamento da cessão de contrato efetuado pelo Cedente, o Adquirente também deve lançar a operação, sendo esse lançamento efetuado pela função Manutenção de Operações Pendentes no **Módulo Operações**, através da opção **Confirmar**. Caso o Adquirente tenha realizado o registro primeiro, o Cedente que deve confirmar o lançamento, na forma descrita acima.

Cessão de Contrato

Cedente 05000.00-5	Cedente (Nome Simplificado) RIOBM
Adquirente 01409.00-2	Adquirente (Nome Simplificado) FLORIDAINV
CPF/CNPJ (Adquirente)	
Código do Contrato 14K00202512	Contrato Inadimplente NAO
Meu Número 132468	Papel CEDENTE
Anuente 10020.00-1	Anuente (Nome Simplificado) LEMEBM
Valor do Prêmio	Titular do Prêmio

Após preencher as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação e a **necessidade de confirmação de cessão pelo Anuente**.

### Confirmação de Cessão de Contrato (pelo Anuente)

Para que a operação de Cessão de Contrato seja finalizada, o Anuente deve acessar a função **Manutenção de Operações Pendentes** no **Módulo Operações**, selecionar o contrato desejado e selecionar a opção **Confirmar**.

Cessão de Contrato	
Cedente 05000.00-5	Cedente (Nome Simplificado) RIOBM
Adquirente 01409.00-2	Adquirente (Nome Simplificado) FLORIDAINV
CPF/CNPJ (Adquirente)	
Código do Contrato 14K00202512	Contrato Inadimplente NAO
Meu Número <input type="text" value="8742"/>	Papel ANUENTE
Anuente 10020.00-1	Anuente (Nome Simplificado) LEMEEM
Valor do Prêmio	Titular do Prêmio

Após preencher as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação. **A Situação de Contrato fica com status Transferido.**

Efetuada a operação, os direitos ou obrigações do cedente nos pagamentos de prêmios agendados no registro do contrato anterior a cessão devem ser transferidos para o adquirente.

Caso o Anuente não confirme a cessão, até o encerramento do horário estabelecido para lançamentos na modalidade LBTR, no caso de cessão com prêmio ou na sem modalidade, quando sem prêmio, a mesma não é processada, permanecendo o contrato com suas condições originais.

Existindo prêmio, a operação de prêmio somente é gerada após lançamento da operação de confirmação de cessão pelo anuente.

Existe a possibilidade de cancelamento das operações de cessão e confirmação de cessão.

- **Se operação de cessão sem prêmio** - é permitido o cancelamento antes e após casamento das operações; e
- **Se operação de cessão com prêmio** - é permitido o cancelamento somente se operação de prêmio não tiver sido finalizada.

## Possibilidades de Cessão nos contratos COM e SEM MODALIDADE

Tipos de Contratos	Knock In	Knock Out	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio
<b>À vista</b> Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive.  Independente do disparo do trigger.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive  Desde que o trigger não tenha sido disparado.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive.  Independente do disparo do trigger de In.	Não se aplica.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive.
<b>À termo</b> Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N.	Não se aplica.	Não se aplica.	Não se aplica.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive.	Não se aplica.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive.
<b>À vista com Cliente1</b> Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive.  Independente do disparo do trigger.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive.  Desde que o trigger não tenha sido disparado.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive.  Independente do disparo do trigger de In.	Não se aplica.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive.
<b>À termo decorrido</b> Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.	Não se aplica.	Não se aplica.	Não se aplica.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive.	Não se aplica.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive.

---

**CONTRATOS SEM MODALIDADE**


---

**À vista**  
Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D. A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.

---

**À termo**  
Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N. A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.

---

**À vista com Cliente<sup>1</sup>**  
Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D. A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.

---

**À termo decorrido**  
Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N. A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.

---

**Cessão referente aos prêmios**
**Cessão de contrato e a situação dos prêmios.**


---

Pagamento do PRÊMIO da **OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO**. Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.

---

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN**. Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.  
(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

---

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK OUT**. Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.  
(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

---

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN-OUT**. Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.  
(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

---

---

**Cessão de contrato e a situação dos prêmios.**


---

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **SWAPTION A TERMO**.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 na data de início).

Os direitos são transferidos.

Se a data da cessão for posterior à data de pagamento do Prêmio 2, o valor financeiro da transferência do prêmio, informado para a cessão, inclui os dois pagos anteriormente.

Se a data da cessão for anterior à data de pagamento do Prêmio 2, o valor financeiro da transferência do prêmio informado para a cessão, inclui somente o Prêmio 1. E a obrigação do Prêmio 2 é transferida para o novo titular se desejar exercer a opção.

---

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **COMPOUND SWAPTION**.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).

Se a data da cessão for posterior à data de pagamento do Prêmio 2, o valor financeiro da transferência do prêmio, informado para a cessão, inclui os dois pagos anteriormente.

Se a data da cessão for anterior à data de pagamento do Prêmio 2, o valor financeiro da transferência do prêmio informado para a cessão, inclui somente o Prêmio 1. E a obrigação do Prêmio 2 é transferida para o novo titular se desejar exercer a opção.

---

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **SWAP COM PRÊMIO**.

Prêmio já foi pago.

---

## Cancelamento de Contrato

Menu Swap > Lançamentos > Cancelamento de Contrato

### Visão Geral

Por meio desta função, o participante pode realizar o cancelamento de contrato de swap de pagamento final ou de fluxo de caixa constante/não constante (a vista, a termo, a vista decorrido ou a termo decorrido) no prazo máximo de 3 dias úteis da data de registro do contrato, independentemente de ter sido realizado com outro participante ou com a sua conta de cliente 1 ou 2.

No caso de ter sido realizado com outro participante, o lançamento do cancelamento de contrato exigirá o duplo comando.

Depois de decorrido o prazo acima mencionado, o participante que tenha interesse em efetuar o cancelamento de contrato deve encaminhar correspondência juntamente com os demais documentos comprobatórios da operação, para avaliação da Cetip por meio da área operacional.

**Observação:** Para cancelamento de Contrato na data de registro, deve ser utilizada a função **Cancelamento de operações**, no Módulo Operações. De D+1 até D+3 (úteis), do registro do contrato, o cancelamento deve ser realizado através da função **Cancelamento de Contrato**, no Módulo Swap. Verifique a situação de prêmios e comissões no capítulo Cancelamento referente aos prêmios e comissões.

### Tela Filtro Cancelamento

**Cancelamento de Contrato**

Parte	<input type="text" value="05000"/>	<input type="text" value="00"/>	<input type="text" value="5"/>
Contraparte	<input type="text" value="05000"/>	<input type="text" value="10"/>	<input type="text" value="8"/>
Código do Contrato	<input type="text" value="14K00079310"/>		
Meu Número	<input type="text" value="1212"/>		

O Participante deve inserir os dados da tela e clicar no botão **Pesquisar** para acessar o contrato que se deseja cancelar.

### Descrição dos Campos da Tela Filtro Cancelamento

Tipo de contrato	Prazo de Cancelamento
------------------	-----------------------

#### Campos de preenchimento obrigatório.

Parte	Código Cetip que identifica o membro que registrou o contrato.
-------	--

Tipo de contrato	Prazo de Cancelamento
Contraparte	Código Cetip que identifica o membro com quem foi efetuado o contrato.
Código do Contrato	Código do Contrato a ser cancelado.
Meu Número	Número atribuído pelo Participante, que estiver realizando a operação de cancelamento.

### Tela de Confirmação de Cancelamento de Contrato

Cancelamento de Contrato	
Dados da Operação de Cancelamento	
Parte 05000.00-5	Parte (Nome Simplificado) RIOBM
Contraparte 05000.10-8	Contraparte (Nome Simplificado) RIOBM
Ponta na operação a cancelar PONTA 1	
Meu número 1212	
Contrato	
Código do Contrato 14K00079310	
Data Inicio 14/11/2014	Prazo em dias úteis 21
Data Vencimento 14/12/2014	Prazo em dias corridos 30

Após clicar no botão **Confirmar**, o sistema exibe mensagem de sucesso da operação de cancelamento.

## Atualização de PU/Fator

Menu Swap > Lançamentos > Atualização PU/Fator

### Visão Geral

Utilizado na atualização das curvas referenciadas em **VCP**, para Libor com variação cambial expressa em **outras moedas**, para informação da variação cambial expressa em **outras moedas** da TJMI, para Contrato a Termo é válida apenas nos lançamentos realizados na data de registro até D-1 do início do contrato e para Cupom Limpo nas curvas referenciadas em **MOEDA**.

### Tela Filtro Atualização PU/Fator

**Atualização PU/FATOR**

Código do Contrato

O Participante deve inserir o código do contrato e clicar no botão **Pesquisar** para acessar o contrato no qual deseja atualizar.

### Tela de Atualização PU/Fator

**Atualização PU/FATOR**

Código do Contrato 15D00034137

Ponta 1 05000.00-5      Ponta 1 (Nome Simplificado) RIOBM

Ponta 2 05000.10-8      Ponta 2 (Nome Simplificado) RIOBM

Ponta 1 (CPF/CNPJ)

Ponta 2 (CPF/CNPJ) 420.750.176-20

Papel PONTA 1      Tipo de Atualização  ▼

Curva  ▼      Data PU/FATOR  /  /

Meu Número       PU  ,

FATOR  ,

### Descrição dos Campos da Tela de Atualização de PU/Fator

Campo	Descrição
Curva	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica qual foi a ponta que utilizou a curva a ser atualizada. Ponta 1 ou Ponta 2.</p>
Meu Número	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número atribuído pelo participante, que estiver realizando a operação de atualização.</p>



Campo	Descrição
Tipo de atualização	Campo de preenchimento obrigatório. Define a atualização a ser efetuada. A Caixa de Seleção apresenta as opções conforme o contrato objeto da atualização: <b>Contrato a Termo; Cupom Limpo; Curva VCP; Libor - Variação Cambial Outros</b> ou <b>TJMI - Variação Cambial Outros</b> .
Data PU / Fator	Campo de preenchimento obrigatório. Data acordada entre as partes em que ocorrerá a atualização do PU/Fator.
PU	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preço ou cotação para atualizar a curva definida no campo <b>Curva</b> . A atualização aqui informada é tomada como PU Final e o quociente de ambos é multiplicado pelo Valor Base. Quando for lançamento de:  Pu/Fator de Curva VCP - 10 inteiros e 8 decimais;  Cotação Cupom Limpo - 3 inteiros e 4 decimais;  Cotação de Libor (variação cambial Outros) e TJMI (variação cambial Outros) - 3 inteiros e 4 decimais.
Fator	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Fator para atualização da curva. Caso o Participante não informe o PU final, pode informar diretamente o fator a ser utilizado. Campo com 2(dois) inteiros e 8(oito) casas decimais.

Após preencher com as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

#### Tela confirmação de Atualização PU/FATOR

Atualização PU/FATOR	
Código do Contrato 15D00034137	
Ponta 1 05000.00-5	Ponta 1 (Nome Simplificado) RIOBM
Ponta 2 05000.10-8	Ponta 2 (Nome Simplificado) RIOBM
Papel PONTA 1	Tipo de Atualização CURVA VCP
Curva PONTA 1	Data PU/FATOR 17/09/2015
Meu Número 96	PU 2,60000000
	FATOR
Valor Financeiro -936.232,02	
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Na atualização das curvas do contrato, se no dia do evento, o PU/Fator for informado até o fechamento da grade **Bilateral**, o evento é gerado na modalidade de liquidação **Bilateral**. Obedecendo ao horário de fechamento da grade, o Participante pode lançar quantas vezes forem necessárias e é considerado sempre o último PU/Fator informado. Após o fechamento dessa grade, o PU/Fator informado não pode ser cancelado.

---

No caso de contrato entre um Participante e seu cliente 1 ou 2 ou entre clientes 1 do mesmo Participante, se no dia do evento o PU/Fator for informado até o fechamento da grade **Sem Liquidação no STR**, o evento é gerado nessa modalidade. Antes de lançar um novo PU/Fator, o Participante deve excluir o último lançamento efetuado utilizando a função **Cancelamento de operações** do produto **Operações**.

Após o fechamento da grade bilateral, o evento que estiver pendente de lançamento de PU/Fator assume a modalidade **Bruta STR**. Se o PU/Fator for informado durante a grade **Bruta STR** e houver necessidade de uma nova atualização, o Participante deve excluir o último lançamento efetuado, utilizando a função **Cancelamento de operações**, acima mencionada e em seguida, efetuar um novo lançamento.

Caso o valor financeiro do evento seja zero, independente das partes, do horário e dos parâmetros, o mesmo assume a modalidade **Sem modalidade**.

A Atualização de Cupom Limpo - Curva Dólar, não gera pendência, pois caso não seja informada a cotação, o sistema utiliza a cotação PTAX800, ponta de venda.

Para efetuar a atualização da variação cambial expressa em **outras moedas** com curva **TJMI**, o Participante deve informar, primeiramente, o registro dessa curva na função **Registro de TJMI**.

---

#### **Informação obrigatória de dados adicionais**

Essa função também deve ser utilizada para cumprimento do disposto no Comunicado Cetip nº 016/2017 de 13 de março de 2017, que estabelece a obrigatoriedade do lançamento de PU/Fator para as curvas que necessitam dessa informação para atualização do contrato.

A ausência de lançamento **no último dia de cada mês**, caracteriza a inadimplência regulamentar do registrador do Swap, conforme comunicado citado acima.

---

## Registro de Taxas de Juros Mercado Internacional

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Taxa de Juros Mercado Internacional

### Visão Geral

Através dessa função, o Participante poderá informar a Taxa de Juros Mercado Internacional (TJMI), que foi utilizada por uma das partes envolvidas como parâmetro, em determinada operação. Os Participantes devem informar a TJMI (Taxa de Juros Mercado Internacional) no período compreendido entre a data de registro (ou último evento) até a data do próximo evento.

Quando for utilizada a curva **TJMI** com variação cambial expressa em **outras moedas**, o Participante deve informar a TJMI nessa função e depois efetuar a atualização da variação cambial na função **Atualização de PU/Fator**.

Se no ato do registro do contrato for escolhida a opção: **somente na 1ª troca de fluxo**, o contrato fica com status **Pendente de TJMI**. Do 2ª evento em diante será necessária a atualização da taxa.

### Tela Filtro Registro de TJMI

O Participante deve inserir o código do contrato e clicar no botão **Pesquisar** para acessar o contrato no qual se deseja registrar Taxa de Juros Mercado Internacional.

### Tela de Registro de TJMI

Após preencher com as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

Na atualização das curvas do contrato, se no dia do evento, a TJMI for informada até o fechamento da grade **Bilateral**, o evento é gerado na modalidade de liquidação **Bilateral**. Obedecendo ao horário de fechamento da grade, o Participante pode registrar quantas vezes forem necessárias e é considerada sempre a última TJMI informada. Após o fechamento dessa grade, a TJMI informada não poderá ser cancelada.

No caso de contrato entre um Participante e seu cliente 1 ou 2 ou entre clientes 1 do mesmo Participante, se no dia do evento, a TJMI for informada até o fechamento da grade **Sem Liquidação no STR**, o evento é gerado nessa modalidade. Antes de registrar uma nova TJMI, o Participante deve excluir o último registro feito utilizando a função **Cancelamento de operações** do produto **Operações**. Após o fechamento da grade bilateral, o evento que estiver pendente de registro de TJMI assume a modalidade **Bruta STR**. Se a TJMI for registrada durante a grade **Bruta STR** e houver necessidade de um novo, o Participante deve excluir o último registro efetuado, utilizando a função **Cancelamento de operações**, acima mencionada e em seguida, efetuar um novo.

#### Descrição dos Campos da Tela de Registro de TJMI

Campo	Descrição
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído pelo participante, que estiver realizando a operação de registro de TJMI, à operação.
Data Fluxo	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de Seleção contendo todas as datas de eventos de TJMI do contrato.
Taxa juros	Campo de preenchimento obrigatório. Campo de informação da TJMI para a data selecionada na Caixa de Seleção do campo <b>Data Fluxo</b> .

## Exercício de Opção

Menu Swap > Lançamentos > Exercício de Opção

### Visão Geral

Esta função permite ao titular o exercício da opção de uma determinada modalidade registrada no contrato.

O exercício de opção serve para as seguintes funcionalidades: Swaption a termo, Compound Swaption, Opção de arrependimento, Knock In com opção e Knock Out com opção.

Discriminamos em relação a cada modalidade, o dia a ser realizado o exercício de opção.

Funcionalidades	Descrição	Data do exercício da opção
Swaption a termo	Confirma o exercício do Swaption e pagamento de Prêmio 2.	Na data início
Compound Swaption	Confirma o exercício de Swaption e pagamento de Prêmio 2.	Na <b>Data de Exercício</b> , indicada no Registro do Contrato.
Opção de arrependimento	Confirma o exercício de opção de arrependimento.	Da data início até a D-1 da data de vencimento inclusive. Na data de vencimento, o exercício da Opção de Arrependimento é realizado automaticamente pelo sistema.
Knock In com Opção	Confirma o exercício de opção de arrependimento.	A partir da data do disparo do trigger até a data de vencimento, inclusive.
Knock Out com Opção	Confirma o exercício de opção de arrependimento.	Na data início até a data de vencimento e se o trigger não for disparado.

**Observações:** O horário limite para o exercício de opção na data de vencimento do contrato é aquele estabelecido pela Cetip para início da liquidação financeira na modalidade Bilateral por Participante.

Na hipótese do Contrato de Swap ter sido registrado com a funcionalidade "Opção de Arrependimento", o procedimento adequado para configurar a rescisão do contrato é por meio do Exercício da Opção (de Arrependimento). Na hipótese de utilização de outros mecanismos o Participante poderá ser considerado Inadimplente Regulamentar, sujeitando-o às penalidades previstas no Regulamento da Cetip.

**Importante:** Apenas para contratos de Swap com a funcionalidade “Opção de Arrependimento, na data de vencimento, exclusivamente, o sistema realiza o exercício automático da Opção de Arrependimento caso o ajuste do Swap seja negativo para o titular da Opção de Arrependimento. Para contratos do tipo VCP, o exercício automático no vencimento é realizado após lançamento de PU, caso seja verificado o ajuste negativo para o titular. O exercício automático é exclusivo para o vencimento, ou seja, para o exercício da Opção de Arrependimento antes da data de vencimento é necessário realizá-lo mediante comando das partes do contrato na função “Exercício de Opção”.

### Exercício de opção quanto ao Tipo de registro

#### Possibilidade do exercício de opção nos contratos

<p>Contrato à vista: Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.</p>	<p>A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D + 1 ou 2) até a data de vencimento, inclusive.</p>
<p>Contrato a termo: Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D + N.</p>	<p>A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D + N + 1) até a data de vencimento, inclusive.</p>
<p>Contrato à vista com cliente 1: Registrado em D + 1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.</p>	<p>A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D + 1 ou 2) até a data de vencimento, inclusive.</p>
<p>Contrato a termo decorrido: Registrado em D + 1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D + N.</p>	<p>A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D + N + 1) até a data de vencimento, inclusive.</p>

### Exercício de opção referente aos prêmios e comissões

#### Situação dos prêmios e comissões no exercício de opção dos contratos

<p>Pagamento do PRÊMIO da OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO.</p>	<p>O pagamento do prêmio da opção de arrependimento, pago na data de registro tem curso normal independente se exerce ou não a opção.</p>
<p>Pagamento de PRÊMIO da modalidade SWAPTION A TERMO. (Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 na data de início).</p>	<p>Pagamento Prêmio 1 tem curso normal. Pagamento Prêmio 2:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Se não foi exercida a opção:</b> É cancelado automaticamente.</li> <li>• <b>Se exercida a opção:</b> O pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.</li> </ul>

### Situação dos prêmios e comissões no exercício de opção dos contratos

Pagamento de PRÊMIO da modalidade COMPOUND SWAPTION.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).

Pagamento Prêmio 1 tem curso normal.

Pagamento Prêmio 2:

- **Se não foi exercida a opção:** É cancelado automaticamente.
- **Se exercida a opção:** O pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.

### Exercício de opção na data de Vencimento do Contrato

#### Possibilidade do exercício de opção no vencimento do contrato

Contratos com curvas calculadas e que não envolvam contas de clientes próprios.

Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela Cetip para início da liquidação financeira na modalidade Bilateral por Participante.

Contratos com curvas calculadas e que envolvam contas de clientes próprios.

Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela Cetip para início da liquidação financeira na modalidade Bilateral por Participante.

Contratos onde pelo uma das curvas seja VCP e que não envolvam contas de clientes próprios.

Se Atualização de PU/Fator finalizada até a grade CTP12 - Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela Cetip para início da liquidação financeira na modalidade Bilateral por Participante;

Se Atualização de PU/Fator não finalizada até a grade CTP12 - Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela Cetip para grade BRUTA STR ou BRUTA BT, conforme o caso.

Contratos onde pelo uma das curvas seja VCP e que envolvam contas de clientes próprios.

Se Atualização de PU/Fator finalizada até a grade CTP12 - Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela Cetip para início da liquidação financeira na modalidade Bilateral por Participante;

Se Atualização de PU/Fator não finalizada até a grade CTP12 - Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela Cetip para grade SEM MODALIDADE.

### Tela Filtro Exercício de Opção

#### Exercício de Opção

Código do Contrato

Na tela acima o Participante deve inserir o Código do Contrato, para que este seja acessado.

### Tela Exercício de Opção

Exercício de Opção		
Contrato		
<b>Código do Contrato</b> 14K00202507	<b>Data Início</b> 19/11/2014	<b>Data Vencimento</b> 21/11/2014
<b>Funcionalidades</b> OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO		
<b>Ponta 1</b> 05000.00-5	<b>Ponta 2</b> 10020.00-1	<b>Papel</b> PONTA 1
<b>Ponta 1 (Nome Simplificado)</b> RIOBM	<b>Ponta 2 (Nome Simplificado)</b> LEMEBM	<b>Meu Número</b> <input type="text" value="11111"/>
<b>Curva Ponta 1</b> DI	<b>Curva Ponta 2</b> DOLAR DOS EUA	
<b>Valor da Curva Atualizado Ponta 1</b> 100.083,50	<b>Valor da Curva Atualizado Ponta 2</b> 98.009,01	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Nesta tela, o sistema informa os dados do contrato acessado. Para prosseguir no lançamento do exercício de opção o Participante deve preencher o campo **Meu Número** e clicar no botão **Enviar**. Logo após é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmar, corrigir, retornar ou desistir da operação. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação.

**Observação:** Não é permitido o estorno de exercício de opção de arrependimento do contrato.

### Exercício de opção quanto ao tipo de registro

#### Possibilidade do exercício de opção nos contratos

<b>Contrato à vista.</b> Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D+1 ou 2) até a data de vencimento, inclusive.
<b>Contrato a termo.</b> Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D+N+1) até a data de vencimento, inclusive.
<b>Contrato à vista com cliente 1.</b> Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D+1 ou 2) até a data de vencimento, inclusive.



### Possibilidade do exercício de opção nos contratos

<b>Contrato a termo decorrido.</b> Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D+N+1) até a data de vencimento, inclusive.
---	---

### Exercício de opção referente aos prêmios e comissões

#### Situação dos prêmios e comissões no exercício de opção dos contratos

Pagamento do PRÊMIO da <b>OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO</b> .	O pagamento do prêmio da opção de arrendimento, pago na data de registro tem curso normal independente se exerce ou não a opção.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade <b>SWAPTION A TERMO</b> . (Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 na data de início).	Pagamento Prêmio 1 tem curso normal. Pagamento Prêmio 2: <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Se não foi exercida a opção:</b> É cancelado automaticamente. <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ <b>Se exercida a opção:</b> O pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.</li> </ul> </li> </ul>
Pagamento de PRÊMIO da modalidade <b>COMPOUND SWAPTION</b> . (Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).	Pagamento Prêmio 1 tem curso normal. Pagamento Prêmio 2: <ul style="list-style-type: none"> <li>• <b>Se não foi exercida a opção:</b> É cancelado automaticamente. <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ <b>Se exercida a opção:</b> O pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.</li> </ul> </li> </ul>



---

# Consulta

---

## Características de Contrato de Swap

Menu Swap > Consultas > Características de Contrato de Swap

### Visão Geral

O Participante pode consultar as características de um contrato de Swap com fluxo de caixa em que apareça em uma das pontas ou de um Participante do seu serviço de digitação.

Caso o Participante não preencha o filtro Parte ou Conta, são apresentados, conforme as informações fornecidas na tela de filtro, todos os contratos por ele registrados não vencidos, sendo o próprio ou um Participante pertencente à sua família de Digitação, necessariamente uma das pontas.

**Observação:** Caso a consulta ultrapasse 5000 linhas, é enviado arquivo ao participante.

### Tela Filtro Consulta Contratos

Consulta Contratos

Parte (Nome Simplificado)

Parte (Conta)  -  -

Código do Contrato

Tipo do Contrato

Situação do Contrato

Cesta Garantias

Agenda Prêmio

Reset

Funcionalidades

Indexador da Parte

Indexador da Contraparte

Contrato - Data de Registro  /  /  -  /  /

Data Vencimento  /  /  -  /  /

Evento - Data do Evento  /  /  -  /  /

Sistema Origem

Código IF Sistema Origem

O Participante deve preencher pelo menos um campo da tela e clicar no botão **Pesquisar**.

### Descrição dos Campos da Tela de Filtro Consulta Contratos

Campo	Descrição
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado do participante no contrato de Swap.
Parte (Conta)	Conta própria do participante no contrato de Swap.

Campo	Descrição
Código do contrato	Código do Contrato a ser pesquisado.
Tipo do Fluxo de Caixa	Tipo de fluxo utilizado na operação de Swap.
Situação do Contrato	Indica a situação em que se encontra o contrato a ser pesquisado.
Cesta de Garantias	Pode ser filtrado pela Cesta de Garantias do contrato. Caixa de Seleção com as opções: Vazio (default), SIM e NÃO.
Agenda de Prêmio	Pode ser filtrado pela Agenda de Prêmios do contrato. Caixa de Seleção com as opções: Vazio (default), SIM e NÃO.
Reset	Pode ser filtrado pelo Reset do contrato. Caixa de Seleção com as opções: Vazio (default), SIM e NÃO.
Funcionalidades	Pode ser filtrado pela Funcionalidade do contrato. Caixa de Seleção com as opções pré-definidas.
Indexador do Participante	Pode ser filtrado pelo indexador da curva do participante. Caixa de Seleção com as opções pré-definidas.
Indexador da Contraparte	Pode ser filtrado pelo indexador da curva da contraparte. Caixa de Seleção com as opções pré-definidas.
Contrato - Data de Registro	Podem ser informados, isoladamente ou em conjunto, períodos de datas de emissão e/ou de vencimento.
Contrato - Data de Vencimento	
Evento - Data do Evento	Podem ser informados, separadamente ou de forma combinada com as datas acima, um período de data de evento.
Sistema Origem	Campo de preenchimento opcional. Caixa combo-box com a opção: BMF Bovespa
Código IF Sistema Origem	Campo de preenchimento opcional. Campo de preenchimento com 14 (quatorze) caracteres.

### Tela de Relação

#### Consulta Contratos

Página 1 de 2 ( Linhas 1 a 25 de 41 )

Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 15:19:38



Código do Contrato	Continuidade do Contrato	Tipo do Contrato	Data de Registro	Dt Última Correção	Dt Último Aditamento	Valor Base	Percentual Índice Termo	Índice Termo	PU Inicial Termo	PU Atual Termo	Dt PU Atual Termo	Fator de Atualização Termo
<a href="#">11D00000950</a>	CONFIRMADO	CONSTANTE	18/04/2011			10.000,00						0,00000000

(continua)

									PARTE		
Dt Início	Dt Vencimento	Valor Base Atual	Valor Amortizado	Valor Base Remanescente	Dt Antecipação	Valor Antecipado Acumulado	Mântem Prêmio	Código da Estratégia	Conta	Nome Simplificado	CPF/CNPJ
15/04/2011	17/10/2016	10.000,00	5.454,54	4.545,46		0,00			05000.00-5	RIOBM	

(continua)

Ponta	Percentual do indexador	Indexador	Dt Atualizacao	PU Inicial	PU Atual	Fator de Juros	Fator de Correção	Valor Juros	Diferença Juros	Valor Amortização	Diferença Amortização	Valor da Curva Atualizado
P1	100,00	DI	23/07/2014			1,026807330	1,000000000	121,85	121,85	909,09	909,09	4.667,31

(continua)

														CONTRAPARTE			
Diferença da Curva	Cesta de Garantias	Lim. Inf.	Lim. Sup.	Lim. Inf. Libor	Lim. Sup. Libor	Lim. Inf. TJMI	Lim. Sup. TJMI	Contraparte	Nome Simplificado	CPF/CNPJ	Ponta	Percentual do indexador	Indexador	Dt Atualizacao	PU Inicial		
-5.332,69								05000.10-8	RIOBM	296.366.368-42	P2	100,00	VCP		1,000000000		

(continua)

PU Atual	Fator de Juros	Fator de Correção	Valor Juros	Diferença Juros	Valor Amortização	Diferença Amortização	Valor da Curva Atualizado	Diferença da Curva	Cesta de Garantias	Lim. Inf.	Lim. Sup.	Lim. Inf. Libor	Lim. Sup. Libor
	1,0000000000	0,000000000	0,00	-121,85	0,00	-909,09	10.000,00	5.332,69					

(continua)

Lim. Inf. TJMI	Lim. Sup. TJMI	Observação	Agenda Prêmio	Reset	Funcionalidades	Parte/Contraparte (Terc. Curva)	Fator/Valor/Taxa (Terc. Curva)	Percentual (Terc. Curva)	Curva (Terc. Curva)	+/- (Terc. Curva)	Juros (% aa) (Terc. Curva)	Limitador (Terc. Curva)
			NÃO		SEM FUNCIONALIDADE							

(continua)

AGENTE DE CÁLCULO				RESPONSÁVEL PELA ACELERAÇÃO			
Conta	Nome Simplificado	Conta	Nome Simplificado	Conta	Nome Simplificado	Conta	Nome Simplificado

(fim)

Após clicar no link do código de instrumento financeiro, é exibida, apenas para consulta de informações, a própria tela de Registro de Contrato.

#### Descrição dos Campos da Tela de Relação

Campo	Descrição
Código do Contrato	Código do contrato pesquisado.
Situação Contrato	Indica a situação em que se encontra o contrato a ser pesquisado.
Tipo do Contrato	Tipo de contrato utilizado na operação de Swap.

<b>Campo</b>	<b>Descrição</b>
Data de Registro	Data de registro do Contrato pesquisado.
Dt. Alteração	Data de alteração do Contrato pesquisado.
Valor Base	Valor Base inicial da operação a partir do qual os parâmetros definidos para o contrato ou para a correção das operações a termo irão incidir.
Percentual Índice Termo	Índice Termo Valor percentual do Índice Termo que corrigiu o Valor Base inicial.
Índice Termo	Indica o parâmetro com o qual foi atualizado o Valor Base inicial.
PU Inicial Termo	Preço unitário inicial informado pelo Participante no registro do Termo. Este campo só apresenta valor quando se tratar de índice Termo VCP.
PU Atual Termo	Preço unitário atual informado pelo Participante no período de vigência do Termo.
Dt. PU Atual Termo	Data que o PU atual foi informado.
Fator de Atualização Termo	Fator de atualização que indica atualização do PU do Termo a partir das características informadas no registro do Termo.
Dt. Início	Data de início da vigência do contrato.
Dt. Vencimento	Data de vencimento do contrato.
Valor Base Atual	Valor base atualizado.
Valor Amortizado	Valor que já foi amortizado do contrato.
Valor Base Remanescente	Valor base restante do contrato.
Dt. Antecipação	Data de antecipação do contrato.
Valor Antecipado Acumulado	Valor que foi antecipado do contrato.
Mantém Prêmio	Indica o desejo de o Participante manter ou não o pagamento de prêmios futuros.
<b>PARTE</b>	
Conta (Parte)	Número da conta do Participante.
Nome Simplificado (Parte)	Nome simplificado do Participante.
CPF/CNPJ (Parte)	CPF/CNPJ do Participante.
Ponta	Indica as pontas envolvidas no contrato. A conta de menor número na operação é denominada Ponta 1 (P1) e a conta de maior número, Ponta 2 (P2).
Percentual do Indexador (Parte)	Percentual do indexador escolhido.

Campo	Descrição
Indexador (Parte)	Parâmetro através do qual a curva do Participante é atualizada.
Dt Atualização (Parte)	Data para a qual a curva se encontra atualizada.
PU Inicial (Parte)	Preço unitário inicial informado pelo Participante no registro do contrato. Este campo só apresenta valor quando se tratar de curva VCP ou Dólar Cupom Limpo.
PU Atual (Parte)	Preço unitário atual informado pelo Participante no período de vigência do contrato, quando se tratar de curva VCP.
Fator de Juros (Parte)	Fator de juros calculado a partir das características informadas no registro do contrato.
Fator de Correção (Parte)	Fator de correção cambial calculado a partir das características informadas no registro do contrato.
Valor Juros (Parte)	Valor de juros calculado a partir do fator de juros. (Valor informativo, sem financeiro)
Diferença Juros (Parte)	Diferença entre o valor de juros da parte e o valor de juros da contraparte.
Valor Amortização (Parte)	Valor meramente contábil e informativo, não gera financeiro. Este é gerado pela informação do campo <b>Diferença de amortização</b> .
Diferença Amortização (Parte)	Diferença entre o valor de amortização da parte e o valor de amortização da contraparte.
Valor da Curva Atualizado (Parte)	Valor da Curva Atualizado calculado através da multiplicação do valor base inicial ou remanescente, fator de juros e fator de correção. (Valor informativo, sem financeiro).
Diferença da Curva (Parte)	Diferença entre o valor da curva atualizado da parte e o valor da curva atualizado da contraparte. (Valor informativo, sem financeiro).
Cesta de Garantias (Parte)	Código da cesta de garantias oferecida pela parte.
Lim. Inf.	Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato.
Lim. Sup.	Taxa arbitrada como Limite Superior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato.
Lim. Inf. Libor	Indica a taxa arbitrada como Limite Inferior da Libor informada para o evento de juros/amortização.
Lim. Sup. Libor	Indica a taxa arbitrada como Limite Superior da Libor informada para o evento de juros/amortização.
Lim. Inf. TJMI	Indica a taxa arbitrada como Limite Inferior da TJMI informada para o evento de juros/amortização.
Lim. Sup. TJMI	Indica a taxa arbitrada como Limite Superior da TJMI informada para o evento de juros/amortização.



Campo	Descrição
<b>CONTRAPARTE</b>	
Conta (Contraparte)	Número da conta da contraparte.
Nome Simplificado (Contraparte)	Nome simplificado da contraparte.
CPF/CNPJ (Contraparte)	CPF/CNPJ da contraparte.
Ponta	Indica as pontas envolvidas no contrato. A conta de menor número na operação é denominada Ponta 1 (P1) e a conta de maior número, Ponta 2 (P2).
Percentual do Indexador (Contraparte)	Percentual do indexador escolhido pela contraparte.
Indexador (Contraparte)	Parâmetro através do qual a curva da contraparte é atualizada.
Dt. Atualização (Contraparte)	Data para a qual a curva se encontra atualizada.
PU Inicial (Contraparte)	Preço unitário inicial informado pela contraparte no registro do contrato. Este campo só apresenta valor quando se tratar de curva VCP ou Dólar Cupom Limpo.
PU Atual (Contraparte)	Preço unitário atual informado pela contraparte no período de vigência do contrato, quando se tratar de curva VCP.
Fator de Juros (Contraparte)	Fator de juros calculado a partir das características informadas no registro do contrato.
Fator de Correção (Contraparte)	Fator de correção cambial calculado a partir das características informadas no registro do contrato.
Valor Juros (Contraparte)	Valor de juros calculado a partir do fator de juros. (Valor informativo, sem financeiro).
Diferença Juros (Contraparte)	Diferença entre o valor de juros da contraparte e o valor de juros da parte.
Valor Amortização (Contraparte)	Valor meramente contábil e informativo, não gerando nenhum financeiro, que é gerado, efetivamente, pela informação do campo <b>Diferença de amortização</b> .
Diferença Amortização (Contraparte)	Diferença entre o valor de amortização da contraparte e o valor de amortização da parte.
Valor da Curva Atualizado (Contraparte)	Valor da Curva Atualizado calculado através da multiplicação do valor base inicial ou remanescente, fator de juros e fator de correção. (Valor informativo, sem financeiro).
Diferença da Curva (Contraparte)	Diferença entre o valor da curva atualizado da contraparte e o valor da curva atualizado da parte. (Valor informativo, sem financeiro).
Cestas de Garantias (Contraparte)	Código da cesta de garantias oferecida pela contraparte.

<b>Campo</b>	<b>Descrição</b>
Lim. Inf.	Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente a valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato.
Lim. Sup.	Taxa arbitrada como Limite Superior, referente a valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato.
Lim. Inf. Libor	Indica a taxa arbitrada como Limite Inferior da Libor informada para o evento de juros/amortização.
Lim. Sup. Libor	Indica a taxa arbitrada como Limite Superior da Libor informada para o evento de juros/amortização.
Lim. Inf. TJMI	Indica a taxa arbitrada como Limite Inferior da TJMI informada para o evento de juros/amortização.
Lim. Sup. TJMI	Indica a taxa arbitrada como Limite Superior da TJMI informada para o evento de juros/amortização.
Observação	Campo destinado a alguma informação adicional.
Agenda Prêmio	Indica se no contrato registrado, existe o pagamento de prêmio.
Reset	Indica se no contrato registrado, há possibilidade de reset.
Funcionalidade	Indica a funcionalidade do contrato.
Parte/Contraparte (Terc. Curva)	
Fator/Valor/Taxas (Terc. Curva)	Parâmetro que determina a efetivação do contrato.
Percentual (Terc. Curva)	Valor percentual do parâmetro de atualização da Terceira Curva
Curva (Terc. Curva)	Curva que o módulo necessita para atualização do contrato.
+ / - (Terc. Curva)	Indica se o juro a ser agregado ao parâmetro de atualização é positivo ou negativo.
Juros (%aa) (Terc. Curva)	Taxa de Juros que, agregada ao parâmetro escolhido para terceira curva, atualiza o valor base.
Limitador (Terc. Curva)	Indica se o Limitador é o Limite Inferior ou Limite Superior.
<b>Agente de Cálculo</b>	
Conta	Código Cetip que identifica o Agente de Cálculo
Nome Simplificado	Nome simplificado do Agente de Cálculo
<b>Responsável pela Aceleração</b>	
Conta	Código Cetip que identifica o Responsável pela Aceleração

---

Campo	Descrição
Nome Simplificado	Nome simplificado do Responsável pela Aceleração

---

## Agenda de Eventos

Menu Swap > Consultas > Agenda de Eventos

### Visão Geral

A função permite que as partes envolvidas num contrato de Swap Fluxo de Caixa, consultem as datas dos eventos e suas respectivas operações - Troca de diferenciais de Juros ou de amortizações e prêmios - programadas num contrato.

A função também permite a realização da consulta mesmo que as partes envolvidas não façam parte do contrato.

### Tela Filtro Consulta Agenda

**Consulta Agenda de Eventos**


Código do Contrato

Preencha o Código do Contrato e clique no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema apresenta tela de relação com o resultado da busca.

### Tela de Relação

**Consulta Agenda de Eventos**

Página 1 de 2 ( Linhas 1 a 25 de 44 )  
Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 15:34:48

 **Critério de pesquisa**

Código do Contrato	Operação	Data Original	Data Ocorrencia	Parte (Conta)	Parte (Nome Simplificado)	Estado
<a href="#">11D00000950</a>	PAGAMENTO DE JUROS	<a href="#">17/10/2011</a>	17/10/2011	05000.00-5	RIOBM	ATIVO
<a href="#">11D00000950</a>	PAGAMENTO DE JUROS	<a href="#">17/10/2011</a>	17/10/2011	05000.10-8	RIOBM	ATIVO
<a href="#">11D00000950</a>	AMORTIZACAO	<a href="#">17/10/2011</a>	17/10/2011	05000.00-5	RIOBM	ATIVO
<a href="#">11D00000950</a>	AMORTIZACAO	<a href="#">17/10/2011</a>	17/10/2011	05000.10-8	RIOBM	ATIVO
<a href="#">11D00000950</a>	PAGAMENTO DE JUROS	<a href="#">17/04/2012</a>	17/04/2012	05000.00-5	RIOBM	ATIVO
<a href="#">11D00000950</a>	PAGAMENTO DE JUROS	<a href="#">17/04/2012</a>	17/04/2012	05000.10-8	RIOBM	ATIVO
<a href="#">11D00000950</a>	AMORTIZACAO	<a href="#">17/04/2012</a>	17/04/2012	05000.00-5	RIOBM	ATIVO
<a href="#">11D00000950</a>	AMORTIZACAO	<a href="#">17/04/2012</a>	17/04/2012	05000.10-8	RIOBM	ATIVO
<a href="#">11D00000950</a>	PAGAMENTO DE JUROS	<a href="#">17/10/2012</a>	17/10/2012	05000.00-5	RIOBM	NÃO LIQUIDADO

Obter no formato:

Após clicar no link existente no campo **Data original**, o sistema exhibe tela com detalhes do evento selecionado.

## Tela Detalhe Agenda de Eventos

## Agenda de Eventos

## Código do Contrato

11D00000950

## Data Registro

18/04/2011

## Data Início

15/04/2011

## Data Vencimento

17/10/2016

## Valor Base

10.000,00

## Valor Amortizado

5.454,54

Parte		Contraparte	
Parte (Conta)	Parte (Nome Simplificado)	Contraparte (Conta)	Contraparte (Nome Simplificado)
05000.00-5	RIOBM	05000.10-8	RIOBM
Percentual	Curva	Percentual	Curva
100,00	DI	100,00	VCP
+/-	Juros(% aa)	+/-	Juros(% aa)
	0,0000		0,0000
Data Atualizacao da Parte	Valor da Curva Atualizado - Parte	Data Atualizacao da Contraparte	Valor da Curva Atualizado - Contraparte
23/07/2014	4.667,31		10.000,00

## Dados do Evento

Data Original	Data Ocorrencia	Operação	Dias Úteis	Taxa TJMI	% Amortização	Tx Juros (ñ constante)	Estado
17/10/2011	17/10/2011	PAGAMENTO DE JUROS	126				ATIVO
Lim. Inf.	Lim. Sup.						



Nesta tela o Participante pode consultar detalhadamente o evento selecionado.

## Fluxo não Constante

Menu Swap > Consultas > Fluxo não Constante

### Visão Geral

Por meio dessa função, o Participante tem acesso, para simples consulta, aos detalhes do fluxo de um contrato de Swap com fluxo de caixa não constante.

A função também permite a realização da consulta mesmo que as partes envolvidas não façam parte do contrato.

### Tela Filtro Consulta de Fluxo da Caixa Não Constante

#### Consulta de Fluxo de Caixa Não Constante

Código do Contrato

Após informar o código do contrato e clicar no botão **Pesquisar**, o sistema exibe tela com detalhes do fluxo de caixa.

## Tela Detalhe Consulta de Fluxo da Caixa Não Constante

## Consulta de Fluxo de Caixa Não Constante

## Contrato

<b>Código do Contrato</b>	<b>Data Início</b>	<b>Data Vencimento</b>
08D00000179	10/04/2008	04/08/2021
<b>Ponta 1</b>	<b>Ponta 2</b>	
00074.00-5	05000.00-5	
<b>Ponta 1 (Nome Simplificado)</b>	<b>Ponta 2 (Nome Simplificado)</b>	
BNDESBD	RIOBM	
<b>Curva Ponta 1</b>	<b>Curva Ponta 2</b>	
LIBOR DOLAR 06M	DOLAR DOS EUA	
<b>Tipo Amortização</b>		
Sobre valor Base Original		

## Fluxo Não Constante Ponta 1

Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2008	+	3,0000			2,62300
04/02/2009	+	3,0000			2,68900
04/08/2009	+	3,0000			2,75700
04/02/2010	+	3,0000			2,82700
04/08/2010	+	3,0000			2,89900
04/02/2011	+	3,0000	0,00000000		2,97300
04/08/2011	+	3,0000			3,04800
04/02/2012	+	3,0000			3,12600
04/08/2012	+	3,0000			3,20500
04/02/2013	+	3,0000			3,28700
04/08/2013	+	3,0000			3,37000
04/02/2014	+	3,0000			3,45600
04/08/2014	+	3,0000			3,54300
04/02/2015	+	3,0000			3,63300
04/08/2015	+	3,0000			3,72600
04/02/2016	+	3,0000			3,82000

(continua)

Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2016	+	3,0000			3,91700
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2017	+	3,0000			4,01700
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2017	+	3,0000			4,11900
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2018	+	3,0000			4,22400
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2018	+	3,0000			4,33100
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2019	+	3,0000			4,44100
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2019	+	3,0000			4,55400
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2020	+	3,0000			4,66900
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2020	+	3,0000			4,78800
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2021	+	3,0000			4,91000
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2021	+	3,0000			5,04800

#### Fluxo Não Constante Ponta 2

Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2008	+	6,0000			2,62300
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2009	+	6,0000			2,68900
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2009	+	6,0000			2,75700
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2010	+	6,0000			2,82700
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2010	+	6,0000			2,89900
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2011	+	6,0000			2,97300
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2011	+	6,0000			3,04800
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2012	+	6,0000			3,12600
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2012	+	6,0000			3,20500
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2013	+	6,0000			3,28700

(continua)



Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2013	+	6,0000			3,37000
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2014	+	6,0000			3,45600
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2014	+	6,0000			3,54300
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2015	+	6,0000			3,63300
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2015	+	6,0000			3,72600
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2016	+	6,0000			3,82000
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2016	+	6,0000			3,91700
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2017	+	6,0000			4,01700
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2017	+	6,0000			4,11900
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2018	+	6,0000			4,22400
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2018	+	6,0000			4,33100
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2019	+	6,0000			4,44100
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2019	+	6,0000			4,55400
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2020	+	6,0000			4,66900
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2020	+	6,0000			4,78800
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2021	+	6,0000			4,91000
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2021	+	6,0000			5,04800

[Voltar](#) [Sair](#)

(fim).

## Histórico de Parâmetros Para Disparo de Reset

Menu Swap > Consultas > Histórico de Parâm. Disparo de Reset

### Visão Geral

Através dessa função, o Participante tem acesso à lista de registros de parâmetros efetuados em um ou mais contratos.

#### Tela Filtro do Histórico de Parâmetros

**Histórico de Parâmetros para Disparo de Reset**

Parte (Nome Simplificado)

Parte (Conta)  -  -

Contraparte (Nome Simplificado)

Contraparte (Conta)  -  -

Código do Contrato

Forma de Disparo

Data Registro  /  /  -  /  /

Após informar, um dos campos da tela e clicar no botão **Pesquisar**, o sistema exibe Tela de Relação com lista de todos os registros de parâmetros efetuados pelo Participante a um ou mais contratos.

#### Descrição dos Campos da Tela Filtro Histórico de Parâmetros

Campo	Descrição
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Parte (Conta)	Conta própria da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Conta)	Conta própria da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Código do Contrato	Código do Contrato a ser pesquisado.
Forma de Disparo	Caixa de Seleção com as opções <b>Data, Valor, Data e Valor</b> e <b>Data ou Valor</b> . Nesse campo é escolhida a forma de disparo do ajuste periódico.
Data Registro	Período em que foi registrado o Reset desejado.

## Tela de Relação

## Histórico de Parâmetros para Disparo de Reset

Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 6 de 6 )

Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 16:01:24



Critério de pesquisa

Data Registro	Código do Contrato	Parte (Nome Simplificado)	Parte (Conta)	Contraparte (Nome Simplificado)	Contraparte (Conta)	Forma de Disparo	Condição de Disparo (Credor)	Parâm. Disparo (Valor)	Quantidade de Datas	Código do Usuário
22/08/2013	13J00005481	RIOBM	05000.20-1	LEMEBM	10020.00-1	DATA	PONTA 1			3 HCARLO
23/04/2014	14B00000750	RIOBM	05000.00-5	COPABM	77785.00-4	DATA	PONTA 1			0 ELOBAO
24/02/2014	14B00001922	RIOBM	05000.00-5	COPABM	77785.00-4	DATA	PONTA 1			2 ANDRES
27/02/2014	14B00004579	RIOBM	05000.00-5	COPABM	77785.00-4	DATA	PONTA 1			2 ANDRES
10/03/2014	14C00001071	RIOBM	05000.00-5	COPABM	77785.00-4	DATA	PONTA 1			2 ELOBAO
17/03/2014	14B00000750	RIOBM	05000.00-5	COPABM	77785.00-4	DATA	PONTA 1 OU PONTA 2			4 HMAGLI

 Exibir página

Atualizar

Voltar

Obter no formato:

Excel

Após clicar no link existente no campo **Data Registro**, na Tela de Relação, o sistema exibe tela com detalhes do registro de parâmetros efetuado na data selecionada. E no link existente no campo **Código de Contrato**, o sistema exibe tela com detalhes do registro de Swap efetuado na data selecionada.

## Tela Detalhe Histórico de Parâmetros

## Histórico de Parâmetros para Disparo de Reset

## Dados do Contrato

<b>Código do Contrato</b>	<b>Data Início</b>	<b>Data Vencimento</b>
13J00005481	20/08/2013	20/08/2014
<b>Ponta 1</b>	<b>Ponta 2</b>	
05000.20-1	10020.00-1	
<b>Ponta 1 (Nome Simplificado)</b>	<b>Ponta 2 (Nome Simplificado)</b>	
RIOBM	LEMEBM	
<b>Curva Ponta 1</b>	<b>Curva Ponta 2</b>	<b>Data Histórico</b>
DI	DOLAR DOS EUA	22/08/2013

## Permissibilidade para Registros

<b>Curvas Marcadas a Mercado</b>	<b>Reset</b>
PONTA 2	PONTA 2

## Condição de Disparo

<b>Forma de Disparo</b>	<b>Credor</b>
DATA	PONTA 1

## Datas de Disparo

26/08/2013  
28/08/2013  
29/08/2013

## Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Menu Swap > Consultas > Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

### Visão Geral

O Participante, através dessa função, tem acesso ao histórico de uma ou todas as curvas informadas a um ou mais contratos.

#### Tela Filtro Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

**Consulta de Histórico de Curvas Marcadas a Mercado**

Parte (Nome Simplificado)

Parte (Conta)  .  -

Nome Simplificado Contraparte

Contraparte (Conta)  .  -

Código do Contrato

Data de Registro  /  /  -  /  /

Após informar, um dos campos da tela e clicar no botão **Pesquisar**, o sistema exibe Tela de Relação com lista de todos os registros de curvas informadas pelo Participante a um ou mais contratos.

#### Descrição dos Campos da Tela Filtro Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Campo	Descrição
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Parte (Conta)	Conta própria da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Conta)	Conta própria da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Código do Contrato	Código do Contrato a ser pesquisado.
Data Registro	Período em que foi registrado o Reset desejado.

## Tela de Relação

## Consulta de Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 12 de 12 )

Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 16:15:22



Data de Registro	Código do Contrato	Parte (Nome Simplificado)	Parte (Conta)	Nome Simplificado Contraparte	Contraparte (Conta)	Fator Parte	Fator Contraparte	Diferencial das Curvas	Credor	Código do Usuário
06/06/2014 00:00:00	<a href="#">14F00000315</a>	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	10,00000000	10,00000000	0,00	PONTA 1	HFERSI
06/06/2014 00:00:00	<a href="#">14F00000315</a>	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	10,00000000	10,00000000	0,00	PONTA 2	HFERSI
28/04/2014 00:00:00	<a href="#">14D00031126</a>	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	10.009,00000000	10.008,00000000	1.000,00	PONTA 1	P21402
28/04/2014 00:00:00	<a href="#">14D00031126</a>	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	1.005,00000000	1.006,00000000	1.000,00	PONTA 2	P21402
28/04/2014 00:00:00	<a href="#">14D00031126</a>	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	100.010,00000000	100.002,00000000	8.000,00	PONTA 1	P20349
28/04/2014 00:00:00	<a href="#">14D00031126</a>	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	100.002,00000000	100.010,00000000	8.000,00	PONTA 1	P20349
28/04/2014 00:00:00	<a href="#">14D00031126</a>	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	10.008,00000000	10.009,00000000	1.000,00	PONTA 1	P21402
28/04/2014 00:00:00	<a href="#">14D00031126</a>	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	1.006,00000000	1.005,00000000	1.000,00	PONTA 2	P21402
07/04/2014 00:00:00	<a href="#">14D00000255</a>	LEMEBM	10020.00-1	MOSSOROBI	01535.00-0	100.000,00000000	1,00000000	99.999,000,00	PONTA 2	SANDIM
07/04/2014 00:00:00	<a href="#">14D00000278</a>	LEMEBM	10020.00-1	MOSSOROBI	01535.00-0	100.000,00000000	1,00000000	99.999,000,00	PONTA 2	SANDIM
03/04/2014 00:00:00	<a href="#">14D00000178</a>	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	1,00000000	100.000,00000000	99.999,000,00	PONTA 2	TDSS
03/04/2014 00:00:00	<a href="#">14D00000178</a>	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	100.000,00000000	1,00000000	99.999,000,00	PONTA 2	TDSS

« 1 » Exibir página » »

Atualizar Voltar

Obter no formato: Excel ▼

Ao clicar no link existente no campo Código de Contrato, na Tela de Relação, o sistema exibe tela com detalhes do registro de Swap efetuado na data selecionada.

## Características de Contrato de Swap

Parte	Contraparte	CPF/CNPJ Cliente Parte	Comissão Parte
10020.00-1	10020.10-4	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Comissão Contraparte
Código do Contrato		012.345.678-90	
14F00000315		Intermediador Parte	

## Características

Data Início	Data Vencimento	Valor Base	Valor Base Remanescente
27/05/2014	06/06/2023	100,00	100,00
Valor Base Atual	Data da Última Antecipação	Valor Antecipado Acumulado	Valor Amortizado no Período
100,00		0,00	0,00
Valor Total Amortizado	Adesão a Contrato	Agenda de Prêmio	Reset
0,00	CGD	NAO	SIM
Funcionalidades	Observação	Amortiza sem troca de diferencial	Código Identificador
SEM FUNCIONALIDADE		NAO	
Código Estratégia	Data Última Correção	Data Último Aditamento	

## Exclusivo para Contrato à Termo

Data Operação	Índice Termo	Perc. Termo
PU Inicial/Cupom Limpo	Tipo/Classe	Denominação

## Curvas para Atualização

Parte			Contraparte		
Percentual	Categoria	Curva	Percentual	Categoria	Curva
100,00	VCP	VCP	100,00	VCP	VCP
TR Escolhida	+/-	Juros(% aa)	TR Escolhida	+/-	Juros(% aa)
	Lim. Inferior (Floor)	Lim. Superior (Cap)		Lim. Inferior (Floor)	Lim. Superior (Cap)

## Terceira Curva

Parte/Contraparte	Cupom Limpo	Percentual	Curva	+/-	Juros(% aa)	Limitador
-------------------	-------------	------------	-------	-----	-------------	-----------

(continua)

Se Curva(s) = "VCP":					
Parte		Contraparte			
PU	Tipo/Classe	PU	Tipo/Classe		
100,00000000	TJLP	100,00000000	LIBOR-DOLAR		
Denominação		Denominação			
100		100			
Cupom Limpo/Data Cotação					
Parte		Contraparte			
Cupom Limpo	Data de Cotação	Cupom Limpo	Data de Cotação		
Exclusivo para curva "Libor"					
Parte		Contraparte			
Data de Cotação - Libor	Variação Cambial	Data de Cotação - Libor	Variação Cambial		
Tipo Classe	Data da Cotação - Variação Cambial	Tipo Classe	Data da Cotação - Variação Cambial		
Cupom Limpo / Outros - Cotação	Alíquota IR	Cupom Limpo / Outros - Cotação	Alíquota IR		
Limite Inferior (Floor) - Perc.	Limite Superior (Cap) - Perc.	Limite Inferior (Floor) - Perc.	Limite Superior (Cap) - Perc.		
Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional"					
Parte		Contraparte			
Taxa Juros	Variação Cambial	Taxa Juros	Variação Cambial		
Tipo Classe	Cupom Limpo / Outros - Cotação	Tipo Classe	Cupom Limpo / Outros - Cotação		
Alíquota IR	Limite Inferior (Floor) - Perc.	Alíquota IR	Limite Inferior (Floor) - Perc.		
Limite Superior (Cap) - Perc.		Limite Superior (Cap) - Perc.			
Exclusivo para Commodity					
Parte		Contraparte			
Cotação Inicial	Codigo da Commodity	Média Asiática	Verificação		
Data da Cotação para Ajuste					
Bolsa de Referencia	Commodity	Tipo	Unidade de Negociação		
Moeda de Cotação	Mês de Vencimento	Ano de Vencimento			
Funcionalidades					
Trigger in		Trigger out			
Parte/Contraparte	Fator/Valor/Taxa	Parte/Contraparte	Fator/Valor/Taxa		
Verificação		Verificação			
Titular da Funcionalidade/Prêmio		Prêmio(1) de Funcionalidade		Prêmio(2) de Funcionalidade	
	Titular	Valor R\$	Rebate R\$	Valor R\$	Data Exercício
		Liquidação do Rebate	Dias Úteis após o Trigger Out		

[Voltar](#) [Sair](#)

[Versão para Impressão](#)

(fim)

## Histórico Reset

Menu Swap > Consultas > Histórico de Reset

### Visão Geral

Esta função permite ao Participante, consultar o histórico dos ajustes registrados e suas possíveis alterações.

#### Tela Filtro Histórico de Reset

Histórico de Reset

Parte (Nome Simplificado)  X

Parte (Conta)  -  -

Contraparte (Nome Simplificado)

Contraparte (Conta)  -  -

Código do Contrato

Liquidação do Reset

Data Registro  /  /  -  /  /

Após informar, um dos campos da tela e clicar no botão **Pesquisar**, o sistema exibe Tela de Relação com lista de todos os Registros de Reset fornecidos pelo Participante a um ou mais contratos.

#### Descrição dos Campos da Tela Filtro Histórico de Reset

Campo	Descrição
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Parte (Conta)	Conta própria da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Conta)	Conta própria da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Código do Contrato	Código do Contrato a ser pesquisado.
Liquidação de Reset	Caixa de Seleção com as opções Sim e Não. Indica se existiu ou não liquidação no Reset desejado.
Data Registro	Período em que foi registrado o Reset desejado.

## Tela de Relação

## Histórico de Reset

Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 9 de 9 )

Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 16:28:10



Ação	Data Registro	Código do Contrato	Parte (Nome Simplificado)	Parte (Conta)	Contraparte (Nome Simplificado)	Contraparte (Conta)	Diferencial das Curvas	Credor	Liquidação do Reset	Continuidade do Contrato	Código do Usuário
	07/04/2014	<a href="#">14D00000278</a>	LEMEBM	10020.00-1	MOSSOROBI	01535.00-0	99.999.000,00	PONTA 2	NÃO	SIM	SANDIM
	12/09/2013	<a href="#">13E00016029</a>	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	2.000,00	PONTA 1	SIM	SIM	HHELEN
	12/09/2013	<a href="#">13E00016029</a>	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	2.000,00	PONTA 1	SIM	SIM	HHELEN
	26/08/2013	<a href="#">13H00000921</a>	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	100.000,00	PONTA 1	SIM	SIM	HCARLO
	26/08/2013	<a href="#">13H00000921</a>	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	100.000,00	PONTA 1	SIM	SIM	HCARLO
	23/08/2013	<a href="#">13H00000921</a>	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	100.000,00	PONTA 1	SIM	SIM	HCARLO
	23/08/2013	<a href="#">13H00000921</a>	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	100.000,00	PONTA 1	SIM	SIM	HCARLO
	24/05/2013	<a href="#">13E00016029</a>	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	230,00	PONTA 2	SIM	SIM	HDISOU
	24/05/2013	<a href="#">13E00016029</a>	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	230,00	PONTA 2	SIM	SIM	HDISOU

&lt;&lt; 1 Exibir página &gt;&gt;

Atualizar

Voltar

Obter no formato: Excel

Ao selecionar a opção selecionar **Detalhar Reset** na Caixa de Seleção do campo Ação, na Tela de Relação, e clicar na dupla seta verde, o sistema exibe **tela com detalhes do Registro de Reset** efetuado na data selecionada.

Ao selecionar a opção **Detalhar Alteração** na Caixa de Seleção do campo Ação, na Tela de Relação, e clicando na dupla seta verde, o sistema exibe **tela com informações detalhadas do contrato**. Antes e depois da alteração efetuada na data selecionada.

Clicando no link existente no campo Código de Contrato, na Tela de Relação, o sistema exibe tela com detalhes do registro de Swap efetuado na data selecionada.



## Resumo de Contratos

Menu Swap > Consultas > Resumo de Contratos

### Visão Geral

O resumo dos contratos permite visualizar o saldo de todos os contratos realizados por um Participante, segregado por data de vencimento e parâmetro.

A função também permite a realização da consulta mesmo que o participante não faça parte do contrato.

### Tela Filtro Resumo de Contratos

#### Filtro Consulta Resumo dos Contratos

Parte

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Após preencher o campo Parte e clicar em **Pesquisar**. O sistema exibe a tela de relação com um resumo dos contratos do Participante.

### Tela de Relação

#### Consulta Resumo dos Contratos

Página 1 de 6 ( Linhas 1 a 25 de 138 )

Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 16:34:24



Data de Vencimento	Curva	Saldo
25/07/2014	IBOVESPA FECHAMENTO	6.683,74
27/07/2014	DI	6,64
30/07/2014	DI	4,10
01/08/2014	IBOVESPA FECHAMENTO	-9,63
04/08/2014	PREFIXADO 252D	102.472,21
04/08/2014	PREFIXADO 360D	89.572,11
05/08/2014	DI	16.899,82
05/08/2014	DOLAR DOS EUA	-7.009,48
05/08/2014	EURO/COM.EUROPEIA	-9.890,34
07/08/2014	VCP	35.983,45
17/08/2014	DI	62.069,65
20/08/2014	DOLAR DOS EUA	-372.734,23
23/08/2014	PREFIXADO 252D	0,00
30/08/2014	DOLAR DOS EUA	66,82
02/09/2014	PREFIXADO 252D	2.230,68
03/09/2014	DI	-954,92
15/09/2014	DI	-1,31
23/09/2014	DI	9,99
24/09/2014	DOLAR DOS EUA	-7,85
03/10/2014	VCP	949,19
13/10/2014	PREFIXADO 252D	-199,69
17/10/2014	LIBOR DOLAR 03M	-363,46
24/10/2014	VCP	-99.990,00
29/10/2014	IBOVESPA FECHAMENTO	-89.455,82
01/11/2014	IBOVESPA FECHAMENTO	-89.256,08

Atualizar

Voltar

« «  Exibir página » »

Obter no formato:

Excel

## Contratos com Opção de Arrependimento

Menu Swap > Consultas > Contratos com Opção de Arrependimento

### Visão Geral

Permite a visão do resultado parcial na data da consulta, positivo ou negativo, de todos os registros de contratos com opção de arrependimento de um determinado Participante.

#### Tela Filtro Contratos com Opção de Arrependimento

**Consulta Contratos Com Opção de Arrependimento do Participante**

Parte

Data

Para consultar um determinado contrato, o Participante deve inserir a conta da Parte e, para uma busca mais refinada, inserir também a Data. Após preencher os campos e clicar no botão **Pesquisar** o sistema apresenta tela de relação.

#### Tela de Relação

**Consulta Contratos Com Opção de Arrependimento do Participante**

Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 7 de 7 )  
 Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 16:39:41

 **Critério de pesquisa**

Funcionalidade	Data Vencimento	Código do Contrato	Contraparte	Data Liquidação		Prêmio	Diferença
OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO	12/12/2014	<a href="#">14D00027512</a>	10020.10-4	23/07/2014		212.121,00	-1.487.319,26
					Total na data		-1.487.319,26
KNOCK OUT COM OPÇÃO	15/06/2015	<a href="#">11I00000087</a>	10020.10-4	23/07/2014		1,00	-97,54
					Total na data		-97,54
OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO	16/05/2016	<a href="#">13G00002978</a>	10020.10-4	23/07/2014		1,00	-165,70
					Total na data		-165,70
					Total Geral		-1.487.582,50

« < 1  > »

Excel

Na tela acima, o usuário pode consultar o resultado parcial dos contratos com opção de arrependimento de um Participante. Ao clicar no Código do Contrato, o sistema apresenta a tela Características de Contrato de Swap, com todas as peculiaridades do contrato selecionado.

## Contratos de Swaption/Compound

Menu Swap > Consultas > Contratos Swaption/Compound

### Visão Geral

Permite a visão dos contratos realizados com essas funcionalidades, informando o valor e a data de exercício para pagamento do Prêmio 2.

#### Tela Filtro Contratos Swaption/Compound

**Consulta de Contratos Swaption/Compound Participante**

Parte


Data

Para consultar um determinado contrato, o Participante deve inserir a conta da Parte e, para uma busca mais refinada, inserir também a Data. Após preencher os campos e clicar no botão **Pesquisar** o sistema retorna.

#### Tela de Relação

**Consulta de Contratos Swaption/Compound Participante**

Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 3 de 3 )  
Data e Hora da Consulta: 19/11/2014 - 14:49:42

 **Critério de pesquisa**

Funcionalidade	Data Exercício	Código do Contrato	Contraparte	Data Liquidação		Premio(2)
SWAPTION	20/11/2014	<a href="#">14K00202512</a>	10020.00-1	19/11/2014		
					Total na data	0,00
					Total Geral	0,00

Nesta tela o usuário pode consultar o resultado parcial dos contratos com funcionalidade Swaption/Compound de um Participante. Ao clicar no Código do Contrato, o sistema apresenta a tela Características de Contrato de Swap, com todas as peculiaridades do contrato selecionado.

## Histórico de Alteração de Contratos

Menu Swap > Consultas > Consulta Histórico

### Visão Geral

O Participante, através dessa função, tem acesso ao histórico de alteração de contratos.

#### Tela Filtro Consulta Histórico

##### Consulta Historico - Alteração de Contratos

Parte (Nome Simplificado)	<input type="text" value="RIOBM"/>
Parte (Conta)	<input type="text" value="05000"/> <input type="text" value="00"/> <input type="text" value="5"/>
Código do Contrato	<input type="text"/>
Tipo do Contrato	<input type="text" value="CONSTANTE"/> ▼
Situação do Contrato	<input type="text" value="CONFIRMADO"/> ▼
Indexador da Parte	<input type="text"/> ▼
Indexador da Contraparte	<input type="text"/> ▼

Após informar, no mínimo, um dos campos da tela e clicar no botão **Pesquisar**, o sistema exibe Tela de Relação com lista de todos os registros de curvas informadas pelo Participante a um ou mais contratos. Quanto mais campos forem preenchidos, mais rápida é a pesquisa.

#### Descrição dos Campos Tela Filtro Consulta Histórico

Campo	Descrição
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da parte a ser pesquisada.
Parte (Conta)	Conta própria da parte.
Código do Contrato	Código do Contrato a ser pesquisado.
Tipo de Fluxo de Caixa	Indica o tipo do fluxo de caixa do contrato a ser pesquisado.
Situação do Contrato	Caixa de Seleção para informar o estado atual do contrato.
Indexador do Participante	Caixa de Seleção para informar o indexador do Participante no contrato.
Indexador da Contraparte	Caixa de Seleção para informar o indexador da Contraparte no contrato.

## Tela de Relação

## Consulta Contratos Alterados

Página 1 de 1 ( Linhas 1 a 4 de 4 )

Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 17:58:51



Código do Contrato	Continuidade do Contrato	Dt Alteração	Usuário	Tipo do Contrato	Data de Registro	Valor Base	Percentual Índice Termo	Índice Termo	PU Inicial Termo	PU Atual Termo	Dt PU Atual Termo	Fator de Atualização Termo
13C00004980	CONFIRMADO	24/07/2013		CONSTANTE	13/03/2013	10.000.000,00						0,00000000
14A00000460	CONFIRMADO	07/02/2014		CONSTANTE	05/02/2014	100.000,00						0,00000000
14G00001674	CONFIRMADO	18/07/2014		CONSTANTE	17/07/2014	41.000,00						0,00000000
14G00001702	CONFIRMADO	18/07/2014		CONSTANTE	17/07/2014	1.100.000,00						0,00000000

« « 1 Exibir página » »

Obter no formato: Excel ▼

(continua)

								PARTE			
Dt Início	Dt Vencimento	Valor Base Atual	Valor Amortizado	Valor Base Remanescente	Dt Antecipação	Valor Antecipado Acumulado	Mântem Prêmio	Conta	Nome Simplificado	CPF/CNPJ	Percentual do indexador
27/03/2013	27/03/2016	10.000.000,00	0,00	10.000.000,00		0,00		05000.00-5	RIOBM		100,00000
05/02/2014	20/01/2015	100.000,00	49.999,98	50.000,02		0,00		05000.00-5	RIOBM		100,00000
18/07/2014	17/10/2014	41.000,00	1.261,52	39.738,48		0,00		05000.00-5	RIOBM		200,00000
17/07/2014	17/08/2014	1.100.000,00	0,00	1.100.000,00		0,00		05000.00-5	RIOBM		100,00000

(continua)

Indexador	Dt Atualização	PU Inicial	PU Atual	Fator de Juros	Fator de Correção	Valor Juros	Diferença Juros	Valor Amortização	Diferença Amortização	Valor da Curva Atualizado	Diferença da Curva
DOLAR	23/07/2014	1.555,0000000000		1,000000000	0,00142308	0,00	-347.288,20	14.230,80	-9.985.769,20	14.230,80	-10.333.057,40
DI	23/07/2014			1,001571602	1,000000000	78,58	78,58	8.333,33	0,00	50.078,60	78,58
DI	23/07/2014			1,005186746	1,000000000	206,11	426,97	630,76	-1,01	39.944,59	363,46
VCP		2.000,0000000000		1,000000000	0,000000000	0,00	-1.791,74	0,00	-1.100.000,00	1.100.000,00	-1.791,74

Atualizar Voltar

(continua)

CONTRAPARTE												
Cesta de Garantias	Contraparte	Nome Simplificado	CPF/CNPJ	Percentual do indexador	Indexador	Dt Atualização	PU Inicial	PU Atual	Fator de Juros	Fator de Correção	Valor Juros	
	10020.00-1	LEMEBM		105,00000	DI	23/07/2014			1,034728820	1,000000000	347.288,20	
	77785.00-4	COPABM		100,00000	Indefinido	23/07/2014			1,000000000	1,000000000	0,00	
	10020.00-1	LEMEBM		100,00000	Libor Dolar - Trimestral	23/07/2014			0,994450919	1,00159856	-220,86	
	10020.00-1	LEMEBM		200,00000	DI	23/07/2014			1,001628860	1,000000000	1.791,74	

(continua)

Diferença Juros	Valor Amortização	Diferença Amortização	Valor da Curva Atualizado	Diferença da Curva	Cesta de Garantias	Observação
347.288,20	10.000.000,00	9.985.769,20	10.347.288,20	10.333.057,40		
-78,58	8.333,33	0,00	50.000,02	-78,58		
-426,97	631,77	1,01	39.581,13	-363,46		
1.791,74	1.100.000,00	1.100.000,00	1.101.791,74	1.791,74		

(fim)

---

# Consulta Tipo Classe

---

## Curvas Não-Calculadas (VCP)

Opções disponíveis para o campo **Tipo/Classe** das funções de registro e alteração dos contratos.

Permite ao Participante consultar a lista de qualificações da curva VCP disponíveis para registro, quando indicada a opção **VCP** nos campos Índice Termo e Curva.

O(s) Registrador (es) do Contrato é (são) responsável (eis) por registrar a descrição completa e detalhada do Parâmetro, de modo a possibilitar que a Cetip, a qualquer tempo, verifique a consistência das metodologias adotadas e dos preços praticados, conforme Comunicado CETIP 126/08 de 04 de Novembro de 2008.

A indicação de uma das opções disponíveis no Módulo para atualização da curva VCP significa, obrigatoriamente, que a atualização toma por base exclusivamente este parâmetro, não existindo outra condição ou critério para a sua apuração, conforme Comunicado Cetip 130/08 de 17 de novembro de 2008.

### Informação obrigatória de dados adicionais

A utilização de curvas do tipo VCP implica aos Participantes a prestação de informações adicionais. As obrigações adicionais estão detalhadas no Comunicado Cetip nº 016/2017 de 13 de março de 2017.

As informações adicionais devem ser informadas no sistema obedecendo os seguintes prazos:

Informação	Curva	Periodicidade	Prazo	Módulo/Função
<b>Marcação a Mercado (MtM)</b>	VCP	Mensal	Do último dia útil do mês de referência até o 4º dia útil do mês subsequente	MID>Marcação a Mercado de IF ou Registro de Informações de Derivativos
<b>Atualização de PU/Fator</b>	VCP e outras (ver item sobre a função "Atualização de PU/Fator")	Mensal	No último dia útil do mês	Swap>Atualização de PU/Fator
<b>% Notional Máximo</b>	VCP-73	Mensal	3 dias úteis após o registro do contrato	MID>Marcação a Mercado de IF ou Registro de Informações de Derivativos
<b>% Notional Mínimo</b>	VCP-73	Mensal	3 dias úteis após o registro do contrato	MID>Marcação a Mercado de IF ou Registro de Informações de Derivativos

---

A ausência de informação no prazo acima estabelecido caracteriza inadimplência regulamentar do Participante, acarretando o pagamento de multa (conforme Tabela de Preços, disponíveis no site da Cetip).

### **Curvas Disponíveis**

A consulta das curvas disponíveis para registro como VCP podem ser consultadas através do seguinte arquivo público:

*Sistema NoMe > Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos > **AAAAMMDD\_  
\_INDEXADORESSWAP\_VCP.TXT***

### **Cadastro de novos ativos subjacentes**

Solicitações para inclusão de novos indexadores (curvas) podem ser feitas através do e-mail [derivativos@cetip.com.br](mailto:derivativos@cetip.com.br).

A seguir também estão listadas as curvas disponíveis para VCP.



## Moedas

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	de	Informações Necessárias
17	US\$ Austrália	Dólar (Austrália)	1) As curvas de moeda desta categoria se referem à paridade entre a moeda estrangeira da curva e o real (BRL/ME).		<p><b>1) Informações sobre a moeda</b></p> <p>Informar no campo “Denominação”: fonte de informação; tipo de cotação (Compra, Venda, Média) e horário de consulta da cotação.</p> <p>Caso seja utilizada a paridade invertida entre a moeda estrangeira e o real (ME/BRL ao invés de BRL/ME), informar “paridade invertida” no campo “Denominação”.</p> <p><b>2) Cross Rate</b></p> <p>Informar no campo “Denominação” se há cross rate, e se houver, informar qual a moeda de passagem utilizada, a fonte de informação, tipo de cotação (Compra, Venda, Média) e horário de consulta da cotação.</p> <p><b>3) Cotação inicial</b></p> <p>Informar exclusivamente no campo “Cupom Limpo”.</p> <p>a) Caso o campo “Cupom Limpo” não seja preenchido, será considerada como cotação inicial a cotação na data de referência resultante do deslocamento informado no campo “Data de Cotação” em relação à data de início. Caso a “Data de Cotação” seja D0, indicar esta informação no campo “Denominação” e o combo do campo “Data de Cotação” não deverá ser preenchido.</p> <p>b) Se houver Cross Rate, informar no campo “Denominação” a cotação inicial da moeda de passagem em relação ao real.</p> <p>c) Na hipótese de início a termo e a cotação inicial formada por uma média de cotações, informar no campo “Denominação” as datas das cotações para média aritmética, ou informar no campo “Denominação” as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.</p> <p><b>4) Fixing para vencimento:</b></p> <p>Informar no campo “Data de Cotação”.</p> <p>a) Caso o fixing para vencimento seja D0, informar no campo “Denominação”.</p> <p>b) Na hipótese de utilização de cross rate com “Data de Cotação” distinta entre as moedas, ambas as datas devem ser informadas no campo “Denominação”.</p> <p>c) Se utilizada a média de cotações: informar no campo “Denominação” as datas das cotações para média aritmética, ou informar no campo “Denominação” as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.</p>
18	US\$ Canadá	Dólar (Canadá)			
21	US\$ Spot	Dólar US Spot			
22	Euro	Euro			
23	Coroa Suécia	Coroa (Suécia)			
24	Lira Turquia	Lira (Turquia)			
25	Libra Inglesa	Libra (Inglaterra)		2) As moedas devem ser utilizadas exclusivamente como fator de correção cambial, contemplando a variação entre a cotação definida para o vencimento e a indicada para a data de início do contrato.	
26	Iene Spot	Iene (Japão)			
27	Yuan China	Yuan (China)			
50	Ringgit Malásia	Ringgit Malásia		3) Permitida a utilização com ou sem cross rate para apuração das cotações para estes códigos de Tipo_Classe.	
53	Coroa Noruega	Coroa Noruega			
54	Franco Suíço	Franco Suíço			
55	Coroa Dinamarca	Coroa Dinamarca			
58	QAR/RIAL-Catar	QAR/RIAL-Catar			
69	Peso/México	Peso/México			
72	SOL PERUANO	SOL PERUANO			
74	Peso Argentino	Peso Argentino			
1011	US\$ Hong Kong	US\$ Hong Kong			
1013	WON/Coreia do Sul	WON/Coreia do Sul			

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
<b>1015</b>	Peso Chileno	Peso Chileno		<p><b>5) Sobre cupom de juros/spread</b>, informar, quando houver:</p> <p>a) cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)",</p> <p>i. Caso o cupom de juros/spread não seja em % a.a., informar no campo "Denominação" a periodicidade (exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.)</p> <p>b) a base de cálculo do cupom de juros/spread no campo "Denominação";</p> <p>c) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear) no campo "Denominação".</p> <p><b>6) Incidência de juros</b></p> <p>a) informar caso a incidência seja sobre parcela no campo "Denominação".</p> <p><b>7) Limitador Inferior ou Superior</b>, quando houver:</p> <p>a) deve ser indicado exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)",</p> <p>i. Caso o limitador informado no campo "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)" seja em valor, mencionar no campo "Denominação". Caso não seja feita nenhuma menção nesse sentido, será entendido que o limitador está na forma de fator arbitrado.</p> <p>b) informar no campo "Denominação" se o limitador é sobre:</p> <p>i. a variação cambial sobre juros e amortização</p> <p>ii. a variação cambial incidente sobre a amortização, somente</p> <p>iii. a variação cambial incidente sobre os juros, somente.</p> <p>c) Para operações com Cross Rate, caso o limitador incida sobre a paridade entre a moeda da curva e a moeda de passagem, informar no campo "Denominação". Se não for feita nenhuma menção nesse sentido, será entendido que o limitador incide sobre a paridade entre a moeda da curva e o real.</p>
<b>59</b>	Peso Colombiano	Peso Colombiano		
<b>6440</b>	PYG	GUARANI/PARAGUAI (BACEN 450)		
<b>7986</b>	RÚPIA	RUPIA INDIA		
<b>8089</b>	Shekel	Shekel (Israel)		
<b>8226</b>	Florim	Florim (Hungria)		
<b>8227</b>	Zloty	Zloty (Polônia)		
<b>8346</b>	RIAL	RIAL ARABIA SAUDITA		
<b>9233</b>	Rand	Rand (África do Sul)		
<b>10876</b>	Dólar de Singapura - SGD	Dólar de Singapura - SGD		
<b>12367</b>	Cólon costarriquenho	Cólon costarriquenho		
<b>15546</b>	XDR BNG Curncy	SPECIAL DRAWING RIGHTS		

## Taxas de Juros Nacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
13	TJLP	TJLP	1) As curvas devem ser utilizados como taxa de juros, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	1) Parâmetros/Critérios de Cálculos necessários para aferição dos PUs informados.
14	DI	DI VCP	2) <b>TR e TJLP</b> devem ser utilizadas somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	a) Caso o fixing seja diferente do vencimento, informa-lo no campo "Denominação" (D-1,...,D-5).
15	Prefixado	Prefixado VCP	2) <b>TR e TJLP</b> devem ser utilizadas somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	2) <b>Percentual da curva:</b> informar exclusivamente no campo " Percentual".
16	Selic	Selic VCP	Para TR e TJLP é permitida a capitalização de juros. Sendo que para a TJLP, a capitalização deve ser feita pela URTJLP - neste caso, indicar "critério BNDES" no campo "Denominação".	3) <b>Sobre cupom de juros/spread</b> , informar, quando houver: a) cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" e; i. Caso o cupom de juros/spread não seja em % a.a., informar no campo "Denominação" a periodicidade (exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.)
70	TR	TR	3) A curva "UMSELIC 143" (código 10535) deve ser utilizada somente como unidade de referência para fins de cálculo de juros e/ou amortização, conforme modelo adotado pelo BNDES. A liquidação dos respectivos valores deverá ser feita, obrigatoriamente, em reais.	b) a base de cálculo do cupom de juros/spread; c) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear).
10535	UMSELIC 143	UNIDADE DE REFERÊNCIA SELIC ACUMULADA D-2 (BNDES)	3) A curva "UMSELIC 143" (código 10535) deve ser utilizada somente como unidade de referência para fins de cálculo de juros e/ou amortização, conforme modelo adotado pelo BNDES. A liquidação dos respectivos valores deverá ser feita, obrigatoriamente, em reais.	4) Em caso de Fluxo de Caixa, a opção de variação acumulada e/ou juros entre fluxos, deverá ser indicada no campo "Denominação".
12227	Fator IPCA - BNDES	Fator IPCA - BNDES	Obs.: para as curvas que já são calculadas pela Cetip, a curva VCP deverá ser utilizada somente se o critério de apuração da taxa for diferente dos estabelecidos em cadernos de fórmulas e manuais de operação da Cetip.	5) <b>Limitador Inferior ou Superior</b> , quando houver: a) devem ser indicados na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)"; b) informar se o limitador é sobre a taxa de juros ou sobre o PU;
14743	Selic REFIS	Selic REFIS		6) <b>Incidência de juros</b> a) informar caso a incidência seja sobre parcela. b) Caso haja capitalização de juros, favor informar no campo "Denominação".
				7) <b>Exclusivamente para o DI</b> a) Metodologia de Accrual i. Caso a metodologia de accrual do DI seja diferente da padrão (exponencial, base 252) informar no campo "Denominação" a metodologia de cálculo utilizada (exemplo: linear) e a base (exemplo: 360). Na ausência dessa informação, será assumida a metodologia padrão.

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
			<p>4) A utilização da curva “Fator IPCA – BNDES” (código 12227) implica a utilização da metodologia de cálculo do fator IPCA adotada pelo BNDES na composição da TLP (mais informações no site do BNDES: <a href="http://goo.gl/LN89pb">goo.gl/LN89pb</a>), conforme Resolução Bacen nº 4.600/17.</p> <p>5) A utilização da curva “Selic REFIS” (código 14743) implica a utilização da metodologia de cálculo adotada pela Receita Federal na concessão do REFIS, através do accrual linear da Taxa Selic Mensal (% a.m) apurada e divulgada pela Receita Federal.</p>	<p>ii. Caso haja accrual também em dias em que não houver divulgação do DI, informar no campo denominação o tratamento utilizado (exemplo: repetição do último conhecido).</p> <p><b>8) Exclusivamente para a TR:</b></p> <p>a) Caso o acúmulo seja mensal, indicar a data base (dia de aniversário de cada mês).</p> <p>i. Indicar também o mês de referência para o acúmulo mensal (M-0, M-1 ou M-2).</p> <p><b>9) Exclusivamente para UMSELIC:</b></p> <p>Além das informações solicitadas acima, quando aplicáveis, informar também:</p> <p>a) A cotação inicial da unidade de referência para conversão do valor base em Reais no campo “Cupom Limpo”.</p> <p>b) O deslocamento em relação ao vencimento e às datas de evento (D-1, ..., D-5) para captura da cotação utilizada para converter o valor de liquidação em unidade de referência UMSELIC para Reais, no campo “Data de Cotação”.</p> <p><b>10) Exclusivamente para Selic Refis:</b></p> <p>Indicar o Mês de referência (<i>fixing</i>) para a cotação nas datas de evento (M-1, ..., M-5) no campo “Denominação”, para fins de apuração da taxa acumulada.</p>

## Taxas de Juros Internacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
1000	TJMI - DOLAR	TJMI - DOLAR	As curvas devem ser utilizados como taxa de juros, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.  Obs.: para as curvas que já são calculadas pela Cetip, a curva VCP deverá ser utilizado somente se o critério de apuração da taxa for diferente dos estabelecidos em cadernos de fórmulas e manuais de operação da Cetip.	<p>1) Parâmetros/Critérios de Cálculos necessários para aferição dos PUs informados no campo "Denominação".</p> <p>2) <b>Fixing para vencimento:</b> Informar o fixing para vencimento da taxa de juros, somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a taxa é cotada no campo "Denominação".</p> <p>3) <b>Taxa de câmbio para conversão</b> a) Informar a cotação inicial da moeda em que a taxa de juros é expressa no campo "Cupom Limpo". b) Informar o fixing da moeda no campo "Data de Cotação". Caso a "Data de Cotação" seja D0, indicar esta informação no campo "Denominação" e o combo do campo "Data de Cotação" não deverá ser preenchido. c) Caso seja utilizado Cross Rate para apuração da cotação da moeda em que a taxa de juros é expressa, informar: a moeda de conversão; a fonte de informação da moeda de conversão; o horário da moeda de conversão; o tipo da moeda de conversão; o fixing da moeda de conversão no campo "Denominação".</p> <p>i. Na hipótese de utilização de Cross Rate com datas de fixing diferentes entre as moedas, ambos os fixings devem ser informados no campo "Denominação".</p> <p>4) <b>Imposto de Renda</b>, informar, quando houver: a) A alíquota de IR no campo "Denominação".</p> <p>5) <b>Interpolação de períodos</b> a) mencionar o critério de interpolação de períodos, quando houver, e o respectivo fluxo ao qual incidirá no campo "Denominação".</p> <p>6) <b>Sobre cupom de juros/spread</b>, informar, quando houver: a) cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" e, i. Caso o cupom de juros/spread não seja em % a.a., informar no campo "Denominação" a periodicidade (exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.)</p>
1001	TJMI - EURO	TJMI - EURO		
1002	TJMI-IENE	TJMI-IENE		
1003	TJMI - LIBRA	TJMI - LIBRA		
1004	LIBOR - DOLAR	LIBOR - DOLAR		
1005	LIBOR - EURO	LIBOR - EURO		
1006	LIBOR - IENE	LIBOR - IENE		
1007	LIBOR - LIBRA	LIBOR - LIBRA		
1008	EURIBOR - DOLAR	EURIBOR - DOLAR		
1009	EURIBOR - EURO	EURIBOR - EURO		
6057	TIIE	Taxa de Juros Interbancário de Equilíbrio (BC México)		
8228	COOVIBR Index	Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate		
9232	JIBA3M Index	South Africa Johannesburg Interbank Agreed Rate		
10360	FEDSOPE N	Garban Intercapital Federal Funds Rate Open		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
11262	FUTURO DE JUROS EURODOLLAR (CME: ED)	EURODOLLAR FUTURES CME (ED)		<p>b) a base de cálculo do cupom de juros/spread no campo "Denominação";</p> <p>c) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear) no campo "Denominação".</p> <p>7) <b>Limitador Inferior ou Superior</b>, quando houver:</p>
12024	LIBOR – FRANCO SUIÇO	LIBOR – FRANCO SUICO		<p>a) caso o valor/fator do limitador seja "zero", informar no campo "Denominação".</p> <p>b) caso o valor/fator do limitador seja qualquer outro número diferente de "zero", este deve ser indicado exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)",</p>
14624	EONIA Index	EMMI EURO OVERNIGHT INDEX AVERAGE		<p>i. Caso o limitador informado no campo "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)" seja em valor, mencionar no campo "Denominação". Caso não seja feita nenhuma menção nesse sentido, será entendido que o limitador está na forma de fator arbitrado.</p> <p>ii. Se o limitador informado no campo "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)" for negativo, informar no campo "Denominação". Caso não haja nenhuma menção nesse sentido, será entendido que o limitador é positivo.</p>
14967	FEDL01 Index	US Federal Funds Effective Rate		<p>c) informar no campo "Denominação" se o limitador é sobre:</p>

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
--------	-----------	------------------------	---------------------------------------	-------------------------

- i. a taxa de juros
  - ii. a variação cambial
  - iii. a variação cambial incidente sobre a amortização, somente
  - iv. a variação cambial incidente sobre o cupom, somente
  - v. a taxa de juros mais o cupom
  - vi. o PU da curva (que abrange juros, cupom e a variação cambial)
- 8) Incidência de juros**
- a) informar caso a incidência seja sobre parcela no campo "Denominação".

# Índices

## Índices de Preço

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
1018	IPCA	Índice de Preço ao Consumidor Amplo	1) Os índices devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	<p><b>1) Indicar a fonte de informação</b> no campo “Denominação”.</p> <p><b>2) Cotação inicial e fixing:</b></p> <p>a) a cotação inicial padrão será considerada o último número-índice conhecido em D-1 da data de registro.</p> <p>i. Caso a cotação (número índice) inicial desejada seja diferente da referência padrão, indicá-la exclusivamente no campo “Cupom Limpo”.</p> <p>ii. Para operações com início a termo em que o número índice inicial não seja conhecido no momento de registro, informar o mês de referência do número índice inicial no campo “Denominação” (informar o mês de referência no formato M-0, M-1, ..., M-12 do mês de início da operação).</p> <p>b) Indicar o mês de referência (fixing) para a cotação na data de evento (M-0, M-1, ..., M-12) no campo “Denominação”. Na ausência desta informação, será entendido como M-1.</p> <p>i. Caso o fixing do vencimento seja diferente do fixing dos eventos intermediários, informar também o fixing do vencimento no campo “Denominação”.</p> <p><b>3) Parâmetros de atualização da curva</b></p> <p>a) Informar o dia de aniversário do contrato (de 1 a 31) no campo “Denominação”. Na ausência, será entendido o dia do vencimento.</p> <p>b) Periodicidade de atualização da curva (ex: bimestral, semestral, etc) no campo “Denominação”. Na ausência, será entendido como mensal.</p> <p>c) Caso haja cálculo de pro rata, informar as referências para o cálculo (ex: “pro rata entre data de divulgação e de aniversário”, ou “pro rata entre data de aniversário e de evento”) no campo “Denominação”.</p> <p>d) Caso seja Fluxo de Caixa, a opção de variação acumulada e/ou juros entre fluxos deverá ser indicada no campo “Denominação”.</p>
1019	IGPM	Índice Geral de Preços do Mercado		
5010	INPC	Índice Nacional de Preços ao Consumidor	2) Somente será permitida a utilização de índice com divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.	
5011	IGP-DI	Índice Geral de Preços - Disponibilidade e Interna		
5012	INCC	Índice Nacional de Custo da Construção		
5013	IPC	Índice de Preços ao Consumidor		



Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
				<p>e) O percentual destacado do índice utilizado exclusivamente no campo "Percentual" (caso o "Percentual" informado seja sobre a variação diária, informar "percentual diário").</p> <p><b>4) Sobre cupom de juros/spread, informar quando houver:</b></p> <p>a) O cupom de juros/spread exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)"</p> <p>b) e a base do cupom (360 ou 252) no campo "Denominação".</p> <p>c) Incidência dos juros (ex: sobre parcela ou saldo devedor) no campo "Denominação". Na ausência, será entendido juros sobre o saldo devedor.</p> <p><b>5) Limitador Inferior ou Superior</b></p> <p>É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior, este deve ser indicado, na forma de fator arbitrado, exclusivamente no campo "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".</p>

## Índices Nacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
75	Ibovespa de Liquidação	Ibovespa de Liquidação		<p>1) Cotação inicial indicada exclusivamente no campo 'Cupom Limpo'.</p> <p>É possível indicar que o valor informado no campo "Cupom Limpo" é um percentual (%) da cotação de D0 da data de início do Swap. Caso não seja feita a menção no campo "Denominação", o preenchimento será assumido como valor.</p> <p>2) Indicação da fonte de informação; tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste) que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual (%); data de cotação, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação";</p> <p>3) Informar, quando houver, cupom de juros/spread na base 252 exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)";</p> <p>4) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior para Contratos devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".</p> <p>5) Se utilizada a média de cotações:</p> <p>a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou</p> <p>b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.</p>
5009	IBrX-50	IBrX-50		
5030	Ibovespa	Ibovespa		
10896	IRF-M	IRF-M		
14400	BZRFIB5+ Index	Anbima IMA-B5+		
14401	BZRFIRFM Index	Anbima IRF-M		
14402	BZRFIMAB Index	Anbima IMA-B		
15325	MSUSBS17 Index	MORGAN STANLEY BRAZIL LARGE CAP 17 VOLATILITY CONTROL		
15326	MSUSBZ20 Index	MS BRAZIL LARGE CAP VT		

## Índices Internacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5029	MXBR0CS – Brazil Consumer Staples Index	MXBR0CS – Brazil Consumer Staples Index		1) Cotação inicial indicada exclusivamente no campo ‘Cupom Limpo’.  É possível indicar que o valor informado no campo “Cupom Limpo” é um percentual (%) da cotação de D0 da data de início do Swap. Caso não seja feita a menção no campo “Denominação”, o preenchimento será assumido como valor.
5153	OREXIO3M INDEX	SGX Asiaclear Iron Ore cfr China 62% Fe Fines Third Month Swap		2) Informar o código do ativo; sua fonte de informação; Bolsa de negociação; Tipo de cotação (fechamento, mínima, média, máxima ou Spot - cotação referente a um horário e fonte de informação específicos) que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual. Caso haja variação cambial, especificar as mesmas informações para a moeda.
5160	OREXIO6M INDEX	SGX Asiaclear Iron Ore cfr China 62% Fe Fines Sixth Month Swap		3) Tipos de Variação de preço:  a) No caso de variação Quanto, informar “ausência de variação cambial” ou “variação quanto” no campo “Denominação”.  b) Se a variação de preços for em reais, informar “variação em reais” no campo “Denominação”.  c) Caso não seja informado nenhuma das situações acima, será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que o ativo é cotado, com variação cambial.
5182	SPX INDEX - S&P 500 INDEX	S&P 500 INDEX		4) Cotação Inicial e fixing:  a) Informar a cotação inicial do ativo exclusivamente no campo “Cupom Limpo”, de acordo com o tipo de variação de preço.  i. Em caso de utilização de variação cambial, informar a cotação inicial da moeda no campo “Denominação”.  b) O fixing para vencimento da moeda deverá ser informado exclusivamente no campo “Data de Cotação”. Caso a “Data de Cotação” seja D0, indicar esta informação no campo “Denominação” e o combo do campo “Data de Cotação” não deverá ser preenchido.  c) Informar o fixing para vencimento do ativo somente quando este for diferente do fixing da moeda em que o ativo é cotado no campo “Denominação”.
5190	SX5E INDEX	EURO STOXX 50 Price EUR		
6077	OREXIO9M INDEX	SGX ASIACLEAR IRON ORE CFR CHINA 62 FE FINES NINE		
6319	OREXIO8M INDEX	SGX Asiaclear Iron Ore cfr China 62% Fe Fines Eight Month Swap		
6380	MXWO	MSCI World Index		
6701	NKY INDEX - NIKKEI	Nikkei 225		
7422	NDDUE15 INDEX	MSCI DAILY TR NET EUROPE USD		
7423	M1APJ INDEX	MSCI AC ASIA PACx JP NR		
8229	CLICP Index	Sinacofi Chile Interbank Rate Avg		
8726	MEXBOL Index	Mexican Stock Exchange Mexican Bolsa IPC Index		
9275	VGK US Equity	VANGUARD FTSE EUROPE ETF		
9276	FJP US Equity	FIRST TRUST JAPAN		
9277	DAX Index	Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
10454	BNPID8UA Index	BNP PARIBAS MULTI-ASSET DIVERSIFIED VOL8 USD FX HE		5) Se utilizada a média de cotações: a) informar as datas das cotações para média aritmética simples no campo "Denominação"; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada no campo "Denominação". c) informar, se houver, limitadores inferior e/ou superior do preço composto pela média das cotações, podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial no campo "Denominação". 6) Limitadores: É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)". 7) É permitido utilizar participações de alta e de baixa (em percentual) sobre as curvas. a) Na hipótese de cada curva ter apenas uma participação, esta deve ser informada exclusivamente no campo "Percentual" em "Curvas para Atualização". b) Caso houver participações de alta e de baixa diferentes sobre as curvas, estas devem ser informadas (em percentual) no campo "Denominação", e o campo "Percentual" em "Curvas para Atualização" deve ser preenchido como "100".
10595	UKX INDEX	FTSE 100 INDEX		
10773	BNPI8DUF Index	BNP Paribas M. Diversified Vol 8 USD FX Hedged Future Index		
11021	DXY Curncy	US Dollar Index (USDIX)		
11041	VIX INDEX	CHICAGO B.O.E SPX VOLATILITY INDEX		
11582	CAC Index	CAC 40 Index		
12126	SPECFR6P	S&P Economic Cycle Factor Rotator Index		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
12127	SP5LVI	S&P 500 Low Volatility Index		
12228	TPX Index	Tokyo Stock Exchange Tokyo Price Index TOPIX		
12567	NDX Index	NASDAQ 100 STOCK INDEX		
8166	SX7E Index	EURO STOXX Banks Price EUR		
12949	SOLWGOAL Index	Solactive Sustainable Development Goals World MV Index		
12948	BNPIECFT Index	BNP Paribas Fd – Emerging Markets Corporate Debt Funds Index (EUR)		
12947	BNPIMAD5 Index	BNP Paribas Multi Asset Diversified 5 Index		
12927	BNPICASE Index	BNP Paribas Core Alternative Strategies Index		
12988	EFJPFU5E Index	J.P. Morgan Fund-Linked Efficiente 5 Index		
12987	EFJPFE5N Index	J.P. Morgan Fund- Linked Efficiente 5 Index (Net ER)		
13107	BNPIMOMA Index	BNP Paribas Momentum Multi Asset 5		
13189	ENHABDAP Index	BEDROCK – DECALIA SILVER GENERATION INDEX		
13211	CPURNSA Index	US CPI URBAN CONSUMERS NSA		
13108	VGT US Equity	VANGUARD INFO TECH ETF		
13109	JNK US Equity	SPDR Bloomberg Barclays High Yield Bond ETF		
13299	SPXT10UE Index	S&P 500 Daily Risk Control 10 USD ER Index		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
13289	GSIS150B Index	GS Risk Premia Basket Series 150 BRL ER Strategy		
13329	MSDIUSP7 Index	Morningstar Ultimate Stock-Pickers Target Vol 7		
13709	JPUSFTRC Index	JP Morgan Global Total Return FT Index		
13749	ENHAEMD5 Index	Emerging Markets Debt Fund Linked 5 TR Index		
13991	Futuro de DXY Index	US DOLLAR INDEX FUTURE		
14544	CSTREND Index	CS BALANCED TREND 5 INDEX		
14643	MJ US Equity	ETFMG ALTERNATIVE HARVEST ETF		
14804	CSEAGG20 Index	CS Global Video Gaming and eSports 20%		
15244	CIEQPU01 Index	CITI EQUITY PUT RATIO US SERIES 1 INDEX		
15245	CIEQDUV3 Index	CITI EQUITY DISPERSION BASKET VN US SERIES 3 INDEX		
15246	CIEQCU01 Index	CITI EQ US 3M EQUITY CONGESTION (D) INDEX		
15327	MSUSMPT6 Index	MS MAP TREND 6 VOL INDEX		
15328	MSFDVT12 Index	DIGITAL VT12		
15329	MSFDMSV9 Index	MSIM GLOBAL OPPORTUNITY VT9		
15330	MSFDMS11 Index	MSIM US GROWTH VT11		
15345	TLT US Equity	ISHARES 20 YEAR TREASURY BOND ETF		
15449	SPXESUP Index	S&P 500 ESG INDEX		
15500	CIMAAIAI Index	ALOC INTERNACIONAL ACTIVE INDEX		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
15504	M1US000V Index	MSCI USA VALUE NET TOTAL RETURN USD INDEX		
15505	M1WO000G Index	MSCI WORLD GROWTH NET TOTAL RETURN USD INDEX		
15506	M1US000G Index	MSCI USA GROWTH NET TOTAL RETURN USD INDEX		
15507	M1WO000V Index	MSCI WORLD VALUE NET TOTAL RETURN USD INDEX		
15508	SOLXPTEC Index	SOLACTIVE XP INDICE DE ACOES AMERICANAS DE TECNOLOGIA		
15552	USCARN8E Index	SOLACTIVE LOW CARBON LEADERS INDEX TARGET VOL 8 (NTR)		
15593	JPMRFTED Index	J.P. MORGAN 10 VT ON MSCI FUTURE EDUCATION INDEX		
15658	SOLXPCOM Index	SOLACTIVE XP ÍNDICE DE COMMODITIES VT 15%		
15667	BNPIWA8U Index	BNP Paribas Global Water Index 8%		
15762	EFIV UP Equity	SPDR S&P 500 ESG ETF		
15802	YOLO US Equity	ADVISORSHAR ES PURE CANNABIS		

## ETFs

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5019	BOVA11	ISHARES BOVA CI	1) As cotações dos ETF's (Exchange Traded Funds) devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	1) Cotação inicial indicada exclusivamente no campo 'Cupom Limpo'.
5015	OGXP3	OGX PETROLEO E GAS PARTICIPAÇÕES S.A		É possível indicar que o valor informado no campo "Cupom Limpo" é um percentual (%) da cotação de D0 da data de início do Swap. Caso não seja feita a menção no campo "Denominação", o preenchimento será assumido como valor.
5017	SMAL11	ISHARES SMAL CI		
5100	EWV US EQUITY	ISHARES MSCI MEXICO INVESTAB		
5116	SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF TRUST		2) Informar o código do ativo; Fonte de Informação; Bolsa de negociação; Tipo de cotação (fechamento, mínima, média, máxima ou Spot - cotação referente a um horário e fonte de informação específicos) que será utilizada para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual. Caso haja variação cambial, especificar as mesmas informações para a moeda.
5137	PPLT US EQUITY	ETFS PLATINUM TRUST	2) Somente é permitida a utilização de ETF com divulgação pública das negociações, possibilitando a aferição do contrato.	
5140	GLD US EQUITY	SPDR GOLD TRUST		
5170	XLP US EQUITY	CONSUMER STAPLES SPDR		
5177	IYR US EQUITY	ISHARES DJ US REAL ESTATE		3) Tipos de Variação de preço:
5201	EWZ US EQUITY	iShares MSCI Brazil Capped Index Fund		a) No caso de variação Quanto, informar "ausência de variação cambial" ou "variação quanto" no campo "Denominação".
5204	FXG US EQUITY	FIRST TRUST CONSUMERS STAPLES		b) Se a variação de preços for em reais, informar "variação em reais" no campo "Denominação".
5632	IYR UP EQUITY	ISHARES DJ US REAL ESTATE		c) Caso não seja informado nenhuma das situações acima, será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que o ativo é cotado, com variação cambial no campo "Denominação".
5632	IYR UP EQUITY	ISHARES DJ US REAL ESTATE		
7222	AAXJ US Equity	ISHARES MSCI ALL COUNTRY ASI		
5651	STR FP EQUITY	SPDR ETFs - SPDR MSCI Europe Consumer Discretionary ETF		4) Cotações Inicial e fixing:



Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5757	DAXEX GY EQUITY	ISHARES DAX DE		<p>a) Informar a cotação inicial do ativo exclusivamente no campo “Cupom Limpo”, de acordo com o tipo de variação de preço.</p> <p>i. Em caso de utilização de variação cambial, informar a cotação inicial da moeda no campo “Denominação”.</p> <p>b) O fixing para vencimento da moeda deverá ser informado exclusivamente no campo “Data de Cotação”. Caso a “Data de Cotação” seja D0, indicar esta informação no campo “Denominação” e o combo do campo “Data de Cotação” não deverá ser preenchido.</p> <p>c) Informar o fixing para vencimento do ativo somente quando este for diferente do fixing da moeda em que o ativo é cotado no campo “Denominação”.</p> <p>5) No caso de cupom de juros, informar quando houver:</p> <p>a) cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos “+/-“ e “Juros (% a.a.)” e;</p> <p>i. Caso o cupom de juros/spread não seja em % a.a., informar no campo “Denominação” a periodicidade (exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.).</p> <p>b) base de cálculo do cupom de juros/spread, exclusivamente no campo “Denominação”, e;</p> <p>c) informar a metodologia de cálculo (exponencial ou linear) exclusivamente no campo “Denominação”.</p> <p>6) Limitadores: É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.</p> <p>7) Tratamento de Proventos:</p> <p>O procedimento para aferição dos contratos levará em consideração a possibilidade de ajustes em função do pagamento de proventos, tais como bonificação, subscrição, juros sobre capital próprio e dividendo.</p> <p>a) As partes deverão indicar os casos em que haja existência (ou não) de cláusulas de proteção contra proventos em dinheiro, e indicar se a proteção contra proventos dar-se-á sobre proventos pagos durante a operação, sobre proventos anunciados e não pagos durante a operação (proventos pagos ex), ou sobre os dois casos.</p>

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
6137	FXI US EQUITY	ISHARES CHINA LARGE-CAP ETF		<p>b) Para os proventos em dinheiro, os ajustes serão efetuados pela incorporação dos valores pagos a curva corrigida pela variação do ativo. O montante do provento a ser incorporado levará em consideração a quantidade de ativos passíveis de serem adquiridas na data de início do contrato através do valor base do mesmo ou da quantidade remanescente, para o caso de médias asiáticas, bem como as alterações da quantidade inicial em função de bonificação ou qualquer evento que altere a referida quantidade.</p> <p>i. Informar o indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) nos casos em que a correção do provento em dinheiro seja por outro indicador diferente da valorização do próprio ativo;</p> <p>ii. Informar também os casos em que haja cláusula que a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento;</p> <p>ii. Informar também os casos em que haja cláusula que a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento;</p> <p>iii. Informar a taxa utilizada de descapitalização do provento pago ex, se houver este tratamento.</p> <p>iv. Informar em valor o Limitador Inferior ou Superior para os proventos em dinheiro, quando houver.</p> <p>c) Os ajustes relativos à subscrição ou qualquer outro direito de preferência serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela incorporação do valor teórico do direito de subscrição, na curva corrigida pela variação do ativo passível de provento;</p> <p>i. Informar os casos em que não haja previsão de ajuste em função de subscrição ou qualquer outro direito de preferência;</p> <p>d) Para bonificação ou qualquer evento que altere a quantidade de ações os ajustes serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela correção do preço de referência pelo fator de bonificação.</p>
6379	EEM:US	iShares MSCI Emerging Markets ETF		
6459	XLI:US	Industrial Select Sector SPDR Fund		
6460	XLY:US	Consumer Discretionary Select Sector SPDR Fund		
6560	FRI:US	First Trust S&P REIT Index Fund		
6781	BOND US EQUITY	Pimco Total Return ETF		
8186	STS FP Equity	SPDR MSCI EUROPE CONSUMER ST		
8206	FXH US Equity	FIRST TRUST HEALTH CARE ALPH		
8246	STZ FP Equity	SPDR MSCI EUROPE FINANCIALS (IE00BKWQ0G16)		
8686	XLF US Equity	FINANCIAL SELECT SECTOR SPDR		
8806	EWY US Equity	ISHARES MSCI SOUTH KOREA CAP		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
9213	AAXJ UQ Equity	ISHARES MSCI ALL COUNTRY ASI		
9315	SX5EEX GY EQUITY	ISHARES EUROSTOXX50 UCITS D		
9396	STQ FP EQUITY	SPDR MSCI EUROPE INDUSTRIALS		
9478	QQQ US Equity	POWERSHARES QQQ TRUST SERIES		
9518	MCHI US Equity	ISHARES CHINA ETF		
9539	VGK UP Equity	VANGUARD FTSE EUROPE ETF		
9541	EWJ UP Equity	ISHARES MSCI JAPAN ETF		
9580	HYG US EQUITY	ISHARES IBOXX HIGH YIELD COR		
9589	IYT US EQUITY	ISHARES TRANSPORTATION AVERA		
9667	ACWI US Equity	ISHARES MSCI ACWI ETF		
9828	INDA UP Equity	ISHARES MSCI INDIA ETF		
9830	ISF LN Equity	ISHARES CORE FTSE 100 UCITS		
9868	ASHR US Equity	DEUTSCHE X-TRACKERS HARVEST		
9888	SJNK US EQUITY	SPDR BARCLAYS SHORT-TERM HIG		
10130	AAXJ UP Equity	ISHARES MSCI ALL COUNTRY ASI		
10191	XLE US Equity	ENERGY SELECT SECTOR SPDR		
10292	USO UP Equity	UNITED STATES OIL FUND LP		
10359	USO US Equity	UNITED STATES OIL FUND LP		
10455	FAZ US Equity	DIREXION DAILY FINANCIAL BEAR 3X SHARES		
10473	GLD UP Equity	SPDR GOLD SHARES		
10577	LQD US Equity	ISHARE IBOXX INVESTMENT GRA		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
10580	EWT US Equity	ISHARES MSCI TAIWAN ETF		
10693	JPXN US Equity	ISHARES JPX – NIKKEI 400 ETF		
10733	IWM US Equity	ISHARES RUSSEL 2000 ETF		
10753	VIXY US Equity	PROSHARES VIX SHORT - TERM FUT		
10493	IVV US Equity	iShares Core S&P 500 ETF		
10856	BRZU US Equity	DIREXION DAILY BRAZIL BULL 3		
10961	EWA US Equity	Ishares MSCI Australia ETF		
11141	XRT US Equity	SPDR S&P RETAIL ETF		
11562	EMB US Equity	IShares JP Morgan USD Emerging Markets Bond ETF		
11804	ECH US Equity	ISHARES MSCI CHILE CAPPED ET		
12085	VXX US Equity	IPATH S&P 500 VIX S/T FU ETN		
12327	EZU US Equity	ISHARES MSCI EUROZONE ETF		
12447	GLOBAL X MSCI ARGENTINA ETF	ARGT US Equity		
12767	QQQ UQ Equity	INVESCO QQQ TRUST SERIES 1		
13649	GXG US Equity	GLOBAL X MSCI COLOMBIA ETF		
13729	ACWX US Equity	ISHARES MSCI ACWI EX US ETF		
13769	SMIN US Equity	ISHARES MSCI INDIA SMALL-CAP		
14090	SQQQ US Equity	ProShares UltraPro Short QQQ		
14130	SRTY US EQUITY	PROSHARES ULTRAPRO SHRT R2K		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
14159	SPXU US EQUITY	PROSH ULTRAPRO SHORT S&P 500		
14190	QID US EQUITY	PROSHARES ULTRASHORT QQQ		
14250	GDX US EQUITY	VANECK GOLD MINERS ETF		
14312	IJR US Equity	ISHARES S&P SMALL-CAP E		
14391	IB5M11 BZ Equity	It Now ETF IMA-B5 Fundo de Índice		
14392	IRFM11 BZ Equity	It Now IRF-M P2 Fundo de Índice		
14393	IMAB11 BZ Equity	It Now ID ETF IMA-B Fundo de Índice		
14847	IYW UP Equity	ISHARES USTECHNOLOGY ETF		
14848	JJC US Equity	IPATH SERIES B BBG COPPER ETN		
14849	OESA GR Equity	WT BRENT CRUDE IOL 1MTH ETC		
14850	TUR US Equity	ISHARES MSCI TURKEY ETF		
14886	SLX US Equity	VANECK STEEL ETF		
14887	COPX US Equity	GLOBAL X COPPER MINERS ETF		
14904	CRAK US Equity	VANECK OIL REFINERS ETF		
14965	FEZ US Equity	SPDR EURO STOXX 50 ETF		
14968	IEF US Equity	ISHARES 7-10 YEAR TREASURY B		
14988	XOP US Equity	SPDR S&P OIL & GAS EXP & PR		
14990	GREK US Equity	GLOBAL X MSCI GREECE ETF		
14991	EWU US Equity	ISHARES MSCI UNITED KINGDOM		
15004	EWUS US Equity	ISHARES MSCI UNITED KINGDOM		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
15007	IVVB11 BZ Equity	ISHARES S&P 500 FIC FI IE		
15024	EWZ UP Equity	ISHARE MSCI BRAZIL ETF		
15044	XPH UP Equity	SPDR S&P PHARMACEUTICALS ETF		
15064	XLV UP Equity	HEALTH CARE SELECT SECTOR		
15065	IWM UP Equity	ISHARES RUSSEL 2000 ETF		
15066	BKLN US Equity	INVESCO SENIOR LOAN ETF		
15124	RSX US Equity	VANECK VECTORS RUSSIA ETF		
15127	SIL US Equity	GLOBAL X SILVER MINERS ETF		
15164	DBB US Equity	INVESCO DB BASE METALS FUND		
15185	ESGU US Equity	ISHARES TRUST ISHARES ESG MS		
15186	ESGE US Equity	ISHARES ESG MSCI EM ETF		
15187	ESGD US Equity	ISHARES ESG MSCI EAFE ETF		
15204	MCHI UP Equity	ISHARES MSCI CHINA ETF		
15224	URTH US Equity	ISHARES MSCI WORLD ETF		
15285	DSI UP Equity	ISHARES MSCI KLD 400 SOCIAL		
15324	GDXJ US Equity	VANECK JR GOLD MINERS		
15388	KWEB US Equity	KRANESHARES CSI CHINA INTERNET ETF		
15408	VNQ US Equity	VANGUARD REAL ESTATE ETF		
15417	ICLN US Equity	ISHARES GLOBAL CLEAN ENERGY ETF		
15418	UUP UP Equity	INVESCO DB US DOLLAR INDEX BULLIS FUND		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
15419	JJN US Equity	IPATH SERIES B BLOOMBERG NICKEL SUBINDEX		
15421	XHB US Equity	SPDR S&P HOMEBUILDERS ETF		
15423	DBA US Equity	INVESCO DB AGRICULTURE FUND		
15429	SHE US Equity	SPDR SSGA GENDER DIVERSITY ETF		
15430	QQQ UP Equity	INVESCO QQQ TRUST SERIES 1		
15431	MCHI UN Equity	ISHARES MSCI CHINA ETF		
15432	Ewt up equity	ISHARES MSCI TAIWAN ETF		
15492	SKYY UP Equity	FIRST TRUST CLOUD COMPUTING ETF		
15495	IXJ US Equity	ISHARES GLOBAL HEALTHCARE ETF		
15498	SUSC US Equity	ISHARES ESG AWARE USD CORPORATE BOND ETF		
15554	IEUR US Equity	ISHARES CORE MSCI EUROPE ETF		
15594	ITB US Equity	ISHARES U.S. HOME CONSTRUCTION ETF		
15613	URA US Equity	GLOBAL X URANIUM ETF		
15614	ICLN UP Equity	ISHARES GLOBAL CLEAN ENERGY ETF		
15617	IPO UP Equity	RENAISSANCE IPO ETF		
15618	BETZ UP Equity	ROUNDHILL SPORTS BET & IGAM		
15619	ARKG UP Equity	ARK GENOMIC REVOLUTION ETF		
15620	XSOE UP Equity	WISDMTREE EMERG MKT EX-ST OW		
15621	SCHA UP Equity	SCHWAB US SMALL-CAP ETF		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
15622	REMX UP Equity	VANECK RARE EARTH/STR METAL ETF		



## Futuro de Índices

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
1010	Futuro de Euro Stoxx50	Futuro de EuroStoxx50	1) Os índices devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.  2) Somente será permitida a utilização de índice com divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.	1) Informação do Índice Futuro utilizado e, se for o caso, sua cotação inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo",  2) Indicação da Fonte de Informação; Bolsa de negociação; Código do Contrato (na Fonte de Informação); Mês/Ano de Vencimento do Contrato; Quantidade do Contrato; Fonte Cotação; Horário da Cotação; Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste); Data de cotação futura, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação"; Moeda em que é negociada na referida Bolsa; Câmbio para Conversão, com a indicação da respectiva referência (Fechamento; Média; Mínima ou Máxima).  3) Informar, quando houver, cupom de juros/spread na base 360, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)",  4) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.  Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".  5) Caso o contrato seja "Quanto", especificar no campo "Denominação" a ausência da variação cambial.
1012	Futuro de HangSeng	Futuro de HangSeng		
341	Futuro S&P 500	Índice Futuro Standard & Poors 500		
342	Futuro VIX	Índice Futuro VIX		
1016	Futuro de DAX	Futuro de DAX		
1017	Barclays Capital GOLD BRL INDEX	Barclays Capital GOLD BRL INDEX		
1026	Futuro de MEXBOL	Futuro de MEXBOL		
5001	Futuro de RUSSELL 2.000	Futuro de RUSSELL 2.000		
5003	Dow Jones UBS F3	Dow Jones UBS F3		
5004	Futuro Mini S&P	Futuro Mini S&P		
5005	Futuro Nikkei 225 (USD)	Futuro Nikkei 225 (USD)		
5006	Futuro Mini Nasdaq	Futuro Mini Nasdaq		
5007	Futuro Mini Dow	Futuro Mini Dow		
5014	Futuro CAC 40	Futuro CAC 40		
5026	Futuro de Pulp Europe NBSK	Futuro de Pulp Europe NBSK		
5027	Futuro de IBEX 35	Futuro de IBEX 35		
5028	Futuro de OMXS30	Futuro de OMXS30		
5031	Futuro de FTSE/MIB Index	Futuro de FTSE/MIB Index		
5084	ASX SPI 200 FUTURES	SPI 200 FUTURES		
5087	BOVESPA INDEX FUT	IBOVESPA FUTURES CONTRACT		
5097	EURO-OAT FUTURO	EURO-OAT FUTURO		
5173	AS51 INDEX - S&P/ASX 200 INDEX	S&P/ASX 200 INDEX		
5198	MES INDEX - mini MSCI Emg Mkt	mini MSCI Emerging Markets (EM) Index Future		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
<b>6259</b>	FTSE 100 INDEX FUTURE	FTSE 100 INDEX FUTURE		
<b>7421</b>	EURO STOXX Banks Index Futures (FESB)	Futuro do Índice Euro Stoxx Banks		
<b>9395</b>	The SGX Nifty Index Future	The SGX Nifty Index Future		
<b>9438</b>	The FTSE/JSE Top 40 Index Future	The FTSE/JSE Top 40 Index Future		
<b>9540</b>	SPY UP Equity	SPDR S&P 500 ETF TRUST		
<b>10898</b>	Futuro Mini Russell 2000	Futuro Mini Russell 2000		

## Outros Índices

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5094	Unidade de Fomento (UF) - Chile	Unidade de Fomento (UF) - Chile	<p>1) O índice deve ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.</p> <p>2) Somente será permitida a utilização de índice com divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.</p>	<p>1) A cotação inicial padrão será considerada como D-1. Caso a cotação inicial desejada seja diferente da referência padrão, indicá-la exclusivamente no campo “Cupom Limpo”.</p> <p>2) Indicação da Fonte de Informação e o Código do Índice (na Fonte de Informação);</p> <p>3) Data de cotação para vencimento, indicada exclusivamente no campo “Data de Cotação”.</p> <p>4) Informação do moeda em que é negociado e o câmbio para Conversão, com a indicação da respectiva referência (Fechamento; Média; Mínima; Máxima ou Spot – cotação referente a um horário e fonte de informação específicos). Caso haja Cross Rate, informar a moeda de passagem para cross rate e as respectivas cotações utilizadas e, neste caso a “Data de Cotação” informada será utilizada para as duas paridades de moedas. Caso a “Data de Cotação” seja D0, indicar esta informação no campo “Denominação” e o combo do campo “Data de Cotação” não deverá ser preenchido.</p> <p>5) Informar, quando houver, cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos “+/-“ e “Juros (% a.a.)”:</p> <p style="padding-left: 40px;">a) Na base 360 ou 252.</p> <p>6) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.</p> <p style="padding-left: 40px;">a) Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior, devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.</p> <p>7) Caso o contrato seja “Quanto”, especificar no campo “Denominação” a ausência da variação cambial.</p>

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
7943	Energia Elétrica PLD - CCEE	Energia Elétrica PLD da CCEE	<p>1) O índice deve ser utilizado somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início e a data de vencimento (ou de evento, no caso de swap fluxo de caixa). Ou, caso a variação calculada seja entre fluxos, informar “variação entre fluxos” exclusivamente no campo “Denominação”.</p> <p>2) Somente será permitida a utilização de índice com divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.</p>	<p>1) Informar a cotação inicial deverá ser obrigatoriamente indicada no campo “Cupom Limpo”, exclusivamente.</p> <p>2) Informar o percentual do índice utilizado, exclusivamente no campo “Percentual”.</p> <p>3) No caso de cupom de juros, informar quando houver:</p> <p>a) cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos “+/-“ e “Juros (% a.a.)” e;</p> <p>i. Caso o cupom de juros/spread não seja em % a.a., informar no campo “Denominação” a periodicidade (exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.).</p> <p>b) base de cálculo do cupom de juros/spread, exclusivamente no campo “Denominação”, e;</p> <p>c) informar a metodologia de cálculo (exponencial ou linear) exclusivamente no campo “Denominação”, e;</p> <p>d) caso a incidência dos juros seja sobre parcela, favor informar exclusivamente no campo “Denominação” (na ausência dessa informação entender-se-á que a incidência é sobre o saldo devedor).</p> <p>e) Caso o spread seja em valor (e não taxa), informar exclusivamente no campo “Denominação”. Indicar também o sinal “+” ou “-“.</p> <p>4) Indicar o tipo de cotação (semanal ou média mensal) para o fixing (caso seja semanal, usar S-0, S-1, S-2, etc.; caso seja mensal, usar M-0, M-1, M-2, etc.), exclusivamente no campo “Denominação”.5) Indicar a Fonte de Informação, o Submercado (SE/CO, S, NE ou N) e o Patamar de Carga (Pesada, Média ou Leve – para o tipo de cotação média mensal, essa informação não é necessária), exclusivamente no campo “Denominação”.</p> <p>6) Se utilizada a <b>média de cotações</b> para formação de fixing:</p>

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
				<p>a) Se o tipo de cotação for <b>semanal</b>:</p> <p>i. Informar as semanas (no formato S-0; S-1, etc.) que se quer utilizar para o cálculo da média aritmética (informar também os respectivos pesos, no caso de média aritmética ponderada);</p> <p>ii. Informar, se houver, limitador inferior e/ou superior sobre a média calculada dos preços (podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial).</p> <p>b) Se o tipo de cotação for <b>mensal</b>:</p> <p>i. Informar o(s) mês (es) (no formato M-0; M-1, etc.) que se quer utilizar para o cálculo da média aritmética (informar também os respectivos pesos, no caso de média aritmética ponderada);</p> <p>ii. Informar, se houver, limitador inferior e/ou superior sobre a média calculada dos preços (podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial).</p> <p>7. É permitido utilizar um (1) limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".</p>

## Futuro de Taxas de Juros

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
<b>6300</b>	Futuro de ISDAFIX - EURO (EUR)	Futuro de ISDAFIX - EURO (EUR)	A taxa deve ser utilizada somente como fator de correção, contemplando a variação percentual, do valor presente da diferença entre a taxa final e inicial, e a taxa final.	<p>1) Informação do Futuro utilizado e, se for o caso, sua cotação inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo";</p> <p>2) Tipos de Variação de preço:</p> <p>a) No caso de variação Quanto, informar "ausência de variação cambial" ou "variação quanto" no campo "Denominação".</p> <p>b) Se a variação de preços for em reais, informar "variação em reais" no campo "Denominação".</p> <p>c) Caso não seja informado nenhuma das situações acima, será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que o futuro é cotado, com variação cambial no campo "Denominação".</p>
<b>6301</b>	Futuro de ISDAFIX - JAPANESE YEN (JPY)	Futuro de ISDAFIX - JAPANESE YEN (JPY)		
<b>6302</b>	Futuro de ISDAFIX - BRITISH POUND (GBP)	Futuro de ISDAFIX - BRITISH POUND (GBP)		
<b>6303</b>	Futuro de ISDAFIX - US DOLLAR (USD)	Futuro de ISDAFIX - US DOLLAR (USD)		<p>3) Indicação da Fonte de Informação; Bolsa de negociação; Código do Contrato (na Fonte de Informação); Mês/Ano de Vencimento do Contrato; Quantidade do Contrato; Fonte Cotação; Horário da Cotação; Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste); Data de cotação futura, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação"; Moeda em que é negociada na referida Bolsa; Câmbio para Conversão da Moeda negociada em Reais, com a indicação da respectiva referência (Fechamento; Média; Mínima ou Máxima).</p>
<b>6304</b>	Futuro de ISDAFIX - SWISS FRANC (CHF)	Futuro de ISDAFIX - SWISS FRANC (CHF)		
<b>14271</b>	Futuro de Cupom IPCA (DAP)	Futuro de CUPOM IPCA		<p>a) No caso de tratar-se de cotação de opção de futuro, informar adicionalmente o Código deste Contrato (na Fonte de Informação).</p> <p>4) Informar, quando houver, cupom de juros/spread na base 360, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)",</p> <p>5) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.</p> <p>a) Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".</p>

## Futuro de Moedas

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5108	Futuro de AUD	Futuro de Dólar (Austrália)	1) O índice deve ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	1) Informação do Futuro utilizado e, se for o caso, sua cotação inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo";
5110	Futuro de JPY	Futuro de Iene (Japão)	2) Somente será permitida a utilização de índice com divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.	2) Tipos de Variação de preço: a) No caso de variação Quanto, informar "ausência de variação cambial" ou "variação quanto" no campo "Denominação".
5119	Futuro de CAD	Futuro de Dólar (Canada)	3) Curvas para utilização <u>exclusiva com variação cambial</u> (Não aceita variação quanto).	b) Se a variação de preços for em reais, informar "variação em reais" no campo "Denominação".
5120	Futuro de EURO	Futuro de EURO		c) Caso não seja informado nenhuma das situações acima, será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que o futuro é cotado, com variação cambial no campo "Denominação".
5121	Futuro de GBP	Futuro de Libra		
5122	Futuro de MXN	Futuro de Peso (México)		3) Indicação da Fonte de Informação; Bolsa de negociação; Código do Contrato (na Fonte de Informação); Mês/Ano de Vencimento do Contrato; Quantidade do Contrato; Fonte Cotação; Horário da Cotação; Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste); Data de cotação futura, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação"; Moeda em que é negociada na referida Bolsa; Câmbio para Conversão da Moeda negociada em Reais, com a indicação da respectiva referência (Fechamento; Média; Mínima ou Máxima).
5877	Futuro de COROA NORUEGUE SA	NOK/USD Norwegian Krone Future		
6117	FUTURO DE FLORIM HÚNGARO	HUF HUNGARIAN FORINT		
6681	Futuro de RUB	Futuro de Rublo (Rússia)		a) No caso de tratar-se de cotação de opção de futuro, informar adicionalmente o Código deste Contrato (na Fonte de Informação).
13409	Futuro de CHF	CHF/USD Future		4) Informar, quando houver, cupom de juros/spread na base 360, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)",  5) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.  a) Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".

## Futuro de Mercadorias

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5155	FUTURO DE GOLD	FUTURO DE GOLD	1) O índice deve ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	1) Informação do Futuro utilizado e, se for o caso, sua cotação inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo"; 2) Tipos de Variação de preço:
5156	FUTURO DE IRON ORE	FUTURO DE IRON ORE – MINÉRIO DE FERRO	2) Somente será permitida a utilização de índice com divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato	a) No caso de variação Quanto, informar "ausência de variação cambial" ou "variação quanto" no campo "Denominação". b) Se a variação de preços for em reais, informar "variação em reais" no campo "Denominação".
5158	FUTURO DE LEAD	FUTURO DE LEAD - CHUMBO		c) Caso não seja informado nenhuma das situações acima, será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que o futuro é cotado, com variação cambial no campo "Denominação".
5159	FUTURO DE ALUMINUM	FUTURO DE ALUMINUM		
5175	FUTURO DE CORN	FUTURO DE CORN - MILHO		3) Indicação da Fonte de Informação; Bolsa de negociação; Código do Contrato (na Fonte de Informação); Mês/Ano de Vencimento do Contrato (exceto quando se tratar de um primeiro futuro); Quantidade do Contrato; Fonte Cotação; Horário da Cotação; Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste); Data de cotação futura, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação"; Moeda em que é negociada na referida Bolsa; Câmbio para Conversão, com a indicação da respectiva referência (Fechamento; Média; Mínima ou Máxima); e "Praça" de negociação da mercadoria para referência de preço, se houver.
5199	FUTURO DE COPPER	FUTURO DE COPPER - COBRE		
5200	FUTURO DE LIVE CATTLE	FUTURO DE LIVE CATTLE - BOI GORDO		
5205	NG	Natural Gas Futures		a) No caso de tratar-se de cotação de opção de futuro, informar adicionalmente o Código deste Contrato (na Fonte de Informação).
5713	FUTURO DE CRUDE OIL	FUTURO DE CRUDE OIL - PETROLEO		b) Caso haja <i>cross rate</i> , informar também a moeda de passagem e as respectivas informações sobre a cotação utilizada (como a Fonte de Informação e a referência - Fechamento; Média; Mínima ou Máxima). A "Data de Cotação" informada será utilizada para as duas paridades de moedas.
6643	Futuro de Palm Oil	Futuro de Óleo de Palma		4) Informar, quando houver, cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" e também:
7381	FUTURO DE SOYBEAN	FUTURO DE SOJA		a) Informar a base de cálculo da taxa (252, 360 ou 365); e
7442	FUTURO DE COFFEE	FUTURO DE CAFÉ		b) Informar a metodologia de cálculo (exponencial ou linear)
8586	FUTURO DE HEATING OIL	FUTURO DE HEATING OIL		



<b>10050</b>	MINI FUTURO DE OURO	MINI FUTURO DE OURO	c) Caso o spread seja em valor, informar exclusivamente no campo "Denominação". Indicar também o sinal "+" ou "-". d) Caso o spread seja sobre o preço inicial e final, informar exclusivamente no campo "Denominação". 5) Se utilizada a média de cotações:
<b>10636</b>	FUTURO DE RUBBER	FUTURO DE RUBBER - BORRACHA	a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.
<b>14310</b>	FUTURO DE AÇUCAR	FUTURO DE AÇUCAR (SUGAR FUTURE)	6) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.
<b>14311</b>	FUTURO DE ZINCO	FUTURO DE ZINCO (ZINC FUTURE)	a) Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
<b>14925</b>	Futuro de Palladium	Futuro de Palladium	
<b>15006</b>	Futuro de Platina	PLATINUM FUTURE	
<b>15428</b>	Mini Futuro de Prata	E-MINI SILVER FUTURES	

## Futuro de Ativos

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5857	Futuro de Euro-Bund - RX COMDTY	Futuro de Euro-Bund	1) O índice deve ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	1) Informação do Futuro utilizado e, se for o caso, sua cotação inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo"; 2) Tipos de Variação de preço:
6158	Futuro de Título do Tesouro Americano	U.S. Treasury Note Futures	2) Somente será permitida a utilização de índice com divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.	a) No caso de variação Quanto, informar "ausência de variação cambial" ou "variação quanto" no campo "Denominação". b) Se a variação de preços for em reais, informar "variação em reais" no campo "Denominação".
7804	Futuro de Título do Tesouro Espanhol	Spanish Bond Futures		c) Caso não seja informado nenhuma das situações acima, será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que o futuro é cotado, com variação cambial no campo "Denominação".
10574	Fut. de Título do Tesouro do Reino Unido	Gilt Future		3) Indicação da Fonte de Informação; Bolsa de negociação; Código do Contrato (na Fonte de Informação); Mês/Ano de Vencimento do Contrato; Quantidade do Contrato; Fonte Cotação; Horário da Cotação; Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste); Data de cotação futura, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação"; Moeda em que é negociada na referida Bolsa; Câmbio para Conversão, com a indicação da respectiva referência (Fechamento; Média; Mínima ou Máxima).
10575	Futuro de Título do Tesouro Italiano	Euro – BTP – Futures		a) No caso de tratar-se de cotação de opção de futuro, informar adicionalmente o Código deste Contrato (na Fonte de Informação).
10576	Futuro de Título do Tesouro Francês	Euro – OAT – Futures		4) Informar, quando houver, cupom de juros/spread na base 360, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)", 5) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. a) Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".

## Ações Nacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5035	BICB4		1) As ações devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	1) Informação da ação e sua cotação inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo".  É possível indicar que o valor informado no campo "Cupom Limpo" é um percentual (%) da cotação de D0 da data de início do Swap. Caso não seja feita a menção no campo "Denominação", o preenchimento será assumido como valor.
5036	BRKM5			
5037	AMAR3			
5038	DAYC4			
5039	PINE4			
5040	BEEF3			
5041	SMTO3			
5042	HYPE3	HYPER MARCAS		
5043	SANB11			
5045	BBDC4	BRADERSCO PN		
5046	CSNA3	SID NACIONAL ON		
5047	GGBR4	GERDAU PN		
5048	PETR4	PETROBRAS PN		
5049	VALE5	VALE PNA		
5056	BVMF3	BMFBOVESPA ON		
5057	PDGR3	PDG REALT ON		
5058	VALE3	VALE ON		
5059	PETR3	PETROBRAS ON		
5060	USIM5	USIMINAS PNA		
5061	CYRE3	CYRELA REALT ON		
5062	MRVE3	MRV ON		
5063	GFA3	GAFISA ON		
5064	RSID3	ROSSI RESID OND		
5065	CIEL3	CIELO ON		
5066	AMBV4	AMBEV PN		
5067	MMXM3	MMX MINER ON		
5068	LREN3	LOJAS RENNER ON	4) Se utilizada a média de cotações:  a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou  b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.  c) informar, se houver, limitadores inferior e/ou superior do preço composto pela média das cotações, podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial.	
5069	BRFS3	BRF FOODS ON		
5070	TIMP3	TIM PART S/A ON		
5071	LAME4	LOJAS AMERIC PN		
5072	CMIG4	CEMIG PN		
5073	BRML3	BR MALLS PAR ON		
5074	NTCO3	NATURA ON		
5075	PCAR4	P.ACUCAR-CBD ON		
5076	MRFG3	MARFRIG ON		
5077	HGTX3	CIA HERING ON		
5078	GOAU4	GERDAU MET PN	5) Tratamento de Proventos:  O procedimento da Cetip para aferição dos contratos levará em consideração a possibilidade de ajustes em função do pagamento de proventos, tais como bonificação, subscrição, juros sobre capital próprio e dividendo.  a) As partes deverão indicar os casos em que haja existência (ou não) de cláusulas de proteção contra proventos em dinheiro, e indicar se a proteção contra proventos dar-se-á sobre proventos pagos durante a operação, sobre proventos anunciados e não pagos durante a operação (proventos pagos ex), ou sobre os dois casos.	
5079	BISA3	BROOKFIELD ON		
5080	JBSS3	JBS ON		
5081	CCRO3	CCR SA ON		
5082	VIVT4	TELEF BRASIL		
5083	GOLL4	GOL PN		
5088	TRPN3	TARPON INV ON		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5092	TPIS3	TRIUNFO PART ON		b) Para os proventos em dinheiro, os ajustes serão efetuados pela incorporação dos valores pagos a curva corrigida pela variação da ação, por ocasião da conversão para ex direito na bolsa. O montante do provento a ser incorporado levará em consideração a quantidade de ações passíveis de serem adquiridas na data de início do contrato através do valor base do mesmo ou da quantidade remanescente de ações, para o caso de médias asiáticas, bem como as alterações da quantidade inicial em função de bonificação ou qualquer evento que altere a referida quantidade.
5093	SUZB5	SUZANO PAPEL PNA		i. Informar o indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) nos casos em que a correção do provento em dinheiro seja por outro indicador diferente da valorização da própria ação;
5095	PMAM3	PARANAPANEMA ON		ii. Informar também os casos em que haja cláusula que a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento;
5096	CZZ US EQUITY	COSAN LTD		iii. Informar a taxa utilizada de descapitalização do provento pago ex, se houver este tratamento.
5117	RADL3	RAIA DROGASIL S/A		iv. Informar em valor o Limitador Inferior ou Superior para os proventos em dinheiro, quando houver.
5715	BRIN3 BZ EQUITY	BRASIL INSURANCE PARTICIPACO		c) Os ajustes relativos à subscrição ou qualquer outro direito de preferência serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela incorporação do valor teórico do direito de subscrição, na curva corrigida pela variação da ação;
6097	JHSF3	JHSF PARTICIPACOES S.A.		i. Informar os casos em que não haja previsão de ajuste em função de subscrição ou qualquer outro direito de preferência;
6381	BBAS3	BRASIL ON		ii. Informar o indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) nos casos em que a correção do valor referente ao ajuste de subscrição incorporado à curva seja por outro indicador diferente da valorização da própria ação.
6382	ELET3	ELETROBRÁS ON		d) Para bonificação ou qualquer evento que altere a quantidade de ações os ajustes serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela correção do preço de referência pelo fator de bonificação.
6383	NETC4	NET PN		6) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.
6399	DIRR3	DIRECIONAL ENGENHARIA SA		Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
6400	ARTR3	ARTERIS S.A.		7) É permitido utilizar participações de alta e de baixa (em percentual) sobre as curvas.
6540	MMXM11	MMX MINER TPR NM		a) Na hipótese de cada curva ter apenas uma participação, esta deve ser informada exclusivamente no campo "Percentual" em "Curvas para Atualização".
7241	TBLE3 BZ EQUITY	Tractebel Energia SA		
7343	BRAP4	BRADESPAR PN		
7344	USIM3	USIMINAS ON		
7463	ABCB4 BZ EQUITY	BANCO ABC BRASIL SA		
7464	GSHP3 BZ EQUITY	GENERAL SHOPPING BRASIL SA		
7465	EVEN3 BZ EQUITY	EVEN CONSTRUTORA E INCORPORADORA SA		
7466	BTOW3 BZ EQUITY	B2W CIA DIGITAL		
7483	UGPA3 BZ EQUITY	UTRAPAR PARTICIPACOES SA		
7484	ABEV3 BZ EQUITY	AMBEV SA		
7485	AEDU3 BZ EQUITY	ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTICIPACOES SA		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
7486	ALLL3 BZ EQUITY	ALL AMERICA LATINA LOGISTICA SA		b) Caso houver participações de alta e de baixa diferentes sobre as curvas, estas devem ser informadas (em percentual) no campo "Denominação", e o campo "Percentual" em "Curvas para Atualização" deve ser preenchido como "100".
7487	BBDC3 BZ EQUITY	BANCO BRADESCO SA		
7488	BBSE3 BZ EQUITY	BB SEGURIDADES PARTICIPACOES SA		
7489	BRPR3 BZ EQUITY	BR PROPERTIES SA		
7490	OIBR4 BZ EQUITY	OI SA		
7491	CESP6 BZ EQUITY	CESP		
7492	CPFE3 BZ EQUITY	CPFL ENERGIA SA		
7493	CPLE6 BZ EQUITY	COPEL		
7494	CRUZ3 BZ EQUITY	SOUZA CRUZ SA		
7495	CSAN3 BZ EQUITY	COSAN AS INDÚSTRIA E COMERCIO		
7496	CTIP3 BZ EQUITY	CETIP SA		
7497	DASA3 BZ EQUITY	DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA		
7498	DTEX3 BZ EQUITY	DURATEX SA		
7499	ECOR3 BZ EQUITY	ECORODOVIAS INFRAESTRUTUR A E LOGISTICA SA		
7500	ELET6 BZ EQUITY	ELETROBRAS SA		
7501	ELPL4 BZ EQUITY	ELETROPAULO METROPOLITANA SA		
7502	ESTC3 BZ EQUITY	ESTACIO PARTICIPACOES SA		
7503	EMBR3 BZ EQUITY	EMBRAER SA		
7504	ENBR3 BZ EQUITY	ENERGIAS DO BRASIL SA		
7505	FIBR3 BZ EQUITY	FIBRIA CELULOSE SA		
7506	ITSA4 BZ EQUITY	INVESTIMENTOS ITAU SA		
7507	KROT3 BZ EQUITY	KROTON EDUCACIONAL SA		
7508	LIGT3 BZ EQUITY	LIGHT SA		
7509	QUAL3 BZ EQUITY	QUALICORP SA		
7510	RENT3 BZ EQUITY	LOCALIZA RENT A CAR SA		
7511	ITUB4 BZ EQUITY	ITAU UNIBANCO HOLDING SA		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
7512	SBSP3 BZ EQUITY	SABESP		
7563	KLBN11 BZ EQUITY	KLABIN S.A. UNITS		
7743	ABRE11 BZ EQUITY	Abril Educação		
7744	QGEP3 BZ EQUITY	QGEP Participações SA		
7803	TCSA3 BZ EQUITY	TECNISA SA		
8646	ABRE3 BZ Equity	ABRIL EDUCAÇÃO SA		
8826	GGBR3 BZ Equity	GERDAU S.A.		
8828	RLOG3 BZ Equity	COSAN LOGISTICA SA		
9208	ANIM3 BZ Equity	GAEC EDUCACAO SA		
9335	SHOW3 BZ EQUITY	T4F ENTRETENIMENT O SA		
9588	EQTL3 BZ EQUITY	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD		
10352	RUMO3 BZ Equity	RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL		
10413	SLED4 BZ Equity	SARAIVA SA LIVREIROS - PREF		
10514	TUPY3 BZ Equity	TUPY SA		
11201	CSMG3 BZ Equity	CIA DE SANEAMENTO DE MINAS GERAIS - COPASA		
11642	ODPV3 BZ Equiy	ODONTOPREV S.A.		
11903	SAPR4 BZ Equity	CIA SANEAMENTO DO PARANA-PRF		
11923	SUZB3 BZ Equity	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA		
11943	SAPR11 BZ Equity	CIA DE SANAMENTO DO PA-UNIT		
12004	ITUB3	ITAU UNIBANCO HOLDINGS SA		
13047	SMLS3 BZ Equity	SMILES FIDELIDADE SA		
13250	HAPV3 BZ Equity	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE		
13251	POMO4 BZ Equity	MARCOPOLO AS-PREF		
13252	MGLU3 BZ Equity	MAGAZINE LUIZA AS		
13253	STBP3 BZ Equity	SANTOS BRASIL PARTICIPACOES		
13429	B3SA3 BZ Equity	B3 AS BRASIL BOLSA BALCAO		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
<b>13850</b>	SLCE3 BZ Equity	SLC AGRICOLA SA		
<b>13851</b>	BRDT3 BZ Equity	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA		
<b>13890</b>	IRBR3 BZ Equity	IRB BRASIL RESSEGUROS SA		
<b>13912</b>	EGIE3 BZ Equity	ENGIE BRASIL ENERGIA SA		
<b>13913</b>	GRND3 BZ Equity	GRENDENE SA		
<b>13914</b>	RAPT4 BZ Equity	RANDON PARTICIPACOES AS-PREF		
<b>13932</b>	ENAT3 BZ Equity	ENAUTA PARTICIPACOES SA		
<b>14075</b>	TAAE11 BZ Equity	TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA		
<b>14231</b>	BIDI11 BZ Equity	BANCO INTER SA- UNITS		
<b>14970</b>	TOTS3 BZ Equity	TOTVS SA		
<b>15025</b>	YDUQ3 BZ Equity	YDUQS PART		
<b>15026</b>	COGN3 BZ Equity	COGNA EDUCACAO		
<b>15050</b>	MTRE3 BZ Equity	MITRE REALTY EMPREENDIMENT OS		
<b>15144</b>	VVAR 3 BZ Equity	VIA VAREJO SA		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
<b>15284</b>	NEOE3 BZ Equity	NEOENERGIA SA.		
<b>15425</b>	BIDI4 BZ Equity	BANCO INTER SA		
<b>15493</b>	IGTA3 BZ Equity	IGUATEMI EMPRESA DE SHOPPING CENTERS SA		
<b>15530</b>	LOGG3 BZ Equity	LOG COMMERCIAL PROPERTIES E PARTIPACOES S/A		
<b>15531</b>	GNDI3 BZ Equity	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES S/A		
<b>15636</b>	VAMO3 BZ Equity	VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHÕES MAQ E EQP SA		



## Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira)

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5735	GGBR4 (contínuo)	GERDAU PN (contínuo)	1) As ações devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	1) Informação da ação e sua cotação inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo".
5736	CSNA3 (contínuo)	SID NACIONAL ON (contínuo)	2) Somente será permitida a utilização de ação com divulgação pública das negociações, possibilitando a aferição do contrato.	É possível indicar que o valor informado no campo "Cupom Limpo" é um percentual (%) da cotação de D0 da data de início do Swap. Caso não seja feita a menção no campo "Denominação", o preenchimento será assumido como valor
13669	PETR4 (contínuo)	PETROBRAS PN (contínuo)	<p>2) Somente será permitida a utilização de ação com divulgação pública das negociações, possibilitando a aferição do contrato.</p> <p><b>3) As curvas VCP deste grupo são específicas para contratos com Funcionalidade Documentacional e com Verificação Contínua de Barreira.</b></p>	<p>2) Indicação da fonte de informação; Cotação de fechamento, mínima, média, máxima ou Spot (cotação referente a um horário e fonte de informação específicos) que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual (%); Horário da Cotação; Data de cotação, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação"; e quando for o caso, Câmbio para conversão.</p> <p>3) Informar, quando houver, cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)"</p> <p>a) Na base 360; b) Na base 252</p> <p>4) Se utilizada a média de cotações:</p> <p>a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou</p> <p>b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.</p> <p>c) informar, se houver, limitadores inferior e/ou superior do preço composto pela média das cotações, podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial.</p> <p>5) Tratamento de Proventos: O procedimento da Cetip para aferição dos contratos levará em consideração a possibilidade de ajustes em função do pagamento de proventos, tais como bonificação, subscrição, juros sobre capital próprio e dividendo.</p>

a) As partes deverão indicar os casos em que haja existência (ou não) de cláusulas de proteção contra proventos em dinheiro, e indicar se a proteção contra proventos dar-se-á sobre proventos pagos durante a operação, sobre proventos anunciados e não pagos durante a operação (proventos pagos ex), ou sobre os dois casos.

b) Para os proventos em dinheiro, os ajustes serão efetuados pela incorporação dos valores pagos a curva corrigida pela variação da ação, por ocasião da conversão para ex direito na bolsa.

“Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.

## Ações Internacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
2476	NVS US EQUITY	NOVARTIS AG-SPONSORED ADR	<p>1) As Ações devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.</p> <p>2) Somente é permitida a utilização de Ações com divulgação pública das negociações, possibilitando a aferição do contrato</p>	<p><b>Informações Necessárias</b></p> <p><b>1) Informações do ativo subjacente:</b></p> <p>a) Informar o Código da Ação; Fonte de informação; Tipo de Cotação (fechamento, mínima, média, máxima ou Spot - cotação referente a um horário e fonte de informação específicos) – que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for informada em percentual (%) no campo “Denominação”.</p> <p>Caso haja variação cambial, especificar as mesmas informações para a moeda. Se houver cross rate, especificar as mesmas informações também para a moeda de passagem.</p> <p>b) No caso de tratar-se de opção sobre a ação, informar adicionalmente o código deste contrato no campo “Denominação”.</p> <p><b>2) Tipos de Variação de preço:</b></p> <p>a) No caso de variação Quanto, informar “ausência de variação cambial” ou “variação quanto” no campo “Denominação”.</p> <p>b) Se a variação de preços for em reais, informar “variação em reais” no campo “Denominação”.</p> <p>i. Caso haja <i>cross rate</i> para verificação da variação em reais, informar que há <i>cross rate</i> na variação em reais e a respectiva moeda de passagem utilizada.</p> <p>c) Caso não seja informado nenhuma das situações acima, será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que a ação é cotada, com variação cambial no campo “Denominação”.</p> <p><b>3) Cotação Inicial e fixing para vencimento:</b></p>
2515	CNV US EQUITY	CNOVA NV		
5096	CZZ US EQUITY	COSAN LTD		
5101	AAPL US EQUITY	APPLE INC		
5102	BOLSAA MM EQUITY	BOLSA MEXICANA DE VALORES SA		
5103	PEN NO EQUITY	PANORO ENERGY ASA		
5104	BSMX US EQUITY	GRUPO FIN SANTANDER-ADR B		
5105	AVP US EQUITY	AVON PRODUCTS INC		
5109	JCP US EQUITY	J.C. PENNEY CO INC		
5111	GM US EQUITY	GENERAL MOTORS CO		
5112	BUD US EQUITY	ANHEUSER - BUSCH INBEV SPN ADR		
5113	RIO US EQUITY	RIO TINTO PLC - SPON ADR		
5118	AHL US EQUITY	ASPEN INSURANCE HOLDINGS LTD		
5126	CO FP EQUITY	CASINO GUICHARD PERRACHON		
5131	LGO CN EQUITY	LARGO RESOURCES LTD		
5136	CPA US EQUITY	COPA HOLDINGS SA		
5138	TX US EQUITY	TERNIUM SA		
5139	EC US EQUITY	ECOPETROL SA		
5141	LFL USEQUITY	LATAM AIRLINES GROUP SA		
5142	NUE USEQUITY	NUCOR CORP		
5145	PAM US EQUITY	PAMPA ENERGIA SA		

5146	MEXCHEM* MM EQUITY	MEXICHEM SAB DE CV
5147	WFC US EQUITY	WELLS FARGO & CO
5152	SIX US EQUITY	SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP
5154	DUFN VX EQUITY	DUFNY AG
5163	PTC PL EQUITY	PORTUGAL TELECOM SGPS S/A
5164	FTE FP EQUITY	FRANCE TELECOM S/A
5165	TEF SM EQUITY	TELEFONICA S/A
5166	DTE GR EQUITY	DEUTSCHE TELEKOM AG
5167	TIT IM EQUITY	TELECOM ITALIA SPA
5176	PBR US EQUITY - Petróleo	PETRÓLEO BRASILEIRO S/A - ADR
5178	CULTIBAB MM EQUITY	ORGANIZACION CULTIBA SAB CV
5179	BP US EQUITY	BP PLC - SPONS ADR
5180	VALE US EQUITY	VALE SA-SP ADR
5181	GSANBOB1 MM EQUITY	GRUPO SANBORNS SA DE CV
5184	PRE CN EQUITY	Pacific Rubiales Energy Corp
5185	BKW US EQUITY	Burger King Worldwide Inc.
5195	AMX US EQUITY	América Movil SAB de CV
5196	DL NA EQUITY	DELTA LLOYD NV
5197	TSCDY US EQUITY	TESCO PLC - SPONSORED ADR
5202	TV US EQUITY	GRUPO TELEVISA SA-SPON ADR
5203	TSCO LN EQUITY	TESCO PLC

a) Informar a cotação inicial da ação exclusivamente no campo “Cupom Limpo”, de acordo com o tipo de variação de preço. É possível indicar que o valor informado no campo “Cupom Limpo” é um percentual (%) da cotação de D0 da data de início do Swap. Caso não seja feita a menção no campo “Denominação”, o preenchimento será assumido como valor

i. Caso a cotação inicial no campo “Cupom Limpo” for indicada em uma unidade diferente da qual o ativo é cotado na bolsa da referência, informar no campo “Denominação” o fator de conversão.

ii. Em caso de utilização de variação cambial, informar a cotação inicial da moeda no campo “Denominação”.

iii. Caso haja *cross rate* para verificação da variação em reais, informar no campo “Denominação”: (1) a cotação inicial da paridade entre a moeda em que a ação é cotada e a moeda de *cross rate*, e (2) a cotação inicial da paridade entre a moeda de *cross rate* e o real.

b) O fixing para vencimento da moeda deverá ser informado exclusivamente no campo “Data de Cotação”.

i. Caso haja *cross rate* para verificação da variação em reais, com fixings para vencimento distintos entre as moedas, ambos os fixings devem ser informadas no campo “Denominação” ( fixing para vencimento da paridade entre a moeda em que a ação é cotada e a moeda de *cross rate*, e fixing para vencimento da paridade entre a moeda de *cross rate* e o real).

c) Informar o fixing para vencimento da ação somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a ação é cotada no campo “Denominação”.

**4) Sobre Cupom de Juros/Spread**, informar, quando houver cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos “+/-” e “Juros (% a.a.)”.

**5) Se utilizada a média de cotações:**

a) informar as datas das cotações para média aritmética simples no campo “Denominação”; ou

b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada no campo “Denominação”.

c) informar, se houver, limitadores inferior e/ou superior do preço composto pela média das cotações, podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial no campo “Denominação”.

5206	IENOVA * MM	INFRAESTRUTU RA ENERGETICA N
5629	NIHD US EQUITY	NII HOLDINGS INC
5609	RAL FP EQUITY	RALLYE SA
5631	LAN CI EQUITY	LATAM AIRLINES GROUP S/A
5672	MT US EQUITY	ARCELORMITTAL NY REGISTERED
5693	FMX US EQUITY	Fomento Econômico Mexicano SAB de CV
5694	WALMEXV MM EQUITY	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV
5695	KOF US EQUITY	Coca-Cola Femsa SAB de CV
5696	GFNORTEO MM EQUITY	Grupo Financeiro Banorte SAB de CV
5737	OHLMEX: MM Equity	OHL MEXICO SAB DE CV
5777	UHR VX Equity	SWATCH GROUP AG/THE-BR
5797	SORIANAB MM EQUITY	ORGANIZACION SORIANA SAB DE CV
5798	COMERUBC MM EQUITY	CONTROLADORA COMERCIAL MEXICANA SAB DE CV
5837	GOOG US EQUITY	GOOGLE INC
5917	UHRN SW EQUITY	SWATCH GROUP AG/THE-REG
5937	ABE SM EQUITY	ABERTIS INFRAESTRUTU RAS SA
5977	CEMEX SAB CPO MEXICO	Cemex SAB de CV MEXICO
5997	FALAB CI EQUITY	SACI Falabella
6017	AA US EQUITY	ALCOA INC
6157	ORA FP EQUITY	ORANGE S/A
6177	DO US EQUITY	DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC
6217	GRAM US EQUITY	GRANA Y MONTERO SA
6218	FSHOP13 MM EQUITY	FIBRA SHOP PORTAFOLIOS INMOBILIARIOS SAPI DE CV
6257	VALE/P US EQUITY	VALE SA - SP PREF ADR
6258	FBR US EQUITY	FIBRIA CELULOSE SA - SPON ADR

**6) Limitadores:** É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.

**7) Metodologia de Cálculo:** Caso metodologia de cálculo seja dada pela quantidade de contratos, indicar essa metodologia e a respectiva quantidade no campo “Denominação”.

**8) Tratamento de Proventos:** O procedimento da Cetip para aferição dos contratos levará em consideração a possibilidade de ajustes em função do pagamento de proventos, tais como bonificação, subscrição, juros sobre capital próprio e dividendo.

a) As partes deverão indicar os casos em que haja existência (ou não) de cláusulas de proteção contra proventos em dinheiro, e indicar se a proteção contra proventos dar-se-á sobre proventos pagos durante a operação, sobre proventos anunciados e não pagos durante a operação (proventos pagos ex), ou sobre os dois casos no campo “Denominação”.

b) Para os proventos em dinheiro, os ajustes serão efetuados pela incorporação dos valores pagos a curva corrigida pela variação da ação, por ocasião da conversão para ex direito na bolsa. O montante do provento a ser incorporado levará em consideração a quantidade de ações passíveis de serem adquiridas na data de início do contrato através do valor base do mesmo ou da quantidade remanescente de ações, para o caso de médias asiáticas, bem como as alterações da quantidade inicial em função de bonificação ou qualquer evento que altere a referida quantidade.

i. Informar o indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) nos casos em que a correção do provento em dinheiro seja por outro indicador diferente da valorização da própria ação no campo “Denominação”;

ii. Informar também os casos em que haja cláusula que a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento no campo “Denominação”;

iii. Informar a taxa utilizada de descapitalização do provento pago ex, se houver este tratamento no campo “Denominação”.

6305	FMG AU EQUITY	Fortescue Metals Group Ltd
6339	GGAL US EQUITY	Grupo Financeiro Galicia SA
6340	IRS US EQUITY	IRSA Inversiones y Representaciones SA
6341	MELI US EQUITY	MERCADOLIBRE INC
6342	LIVEPOLC MM EQUITY	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV
6343	BMA:US	Banco Macro SA
6344	TEO:US	Telecom Argentina SA (ADR)
6345	YPF:US	YPF SA (ADR)
6359	PHM:US	PulteGroup Inc.
6439	ENI:US	Enersis SA (ADR)
6479	ASR:SJ	Assore Ltd
6480	ARI:SJ	African Rainbow Minerals Ltd
6499	CCU US EQUITY	Cia Cervecerias Unidas SA
6500	GGB:US	Gerdau AS (ADR)
6580	HTZ:US	Hertz Global Holding Inc.
6600	BRK/B US EQUITY	Berkshire Hathaway Inc.
6620	PT US	Portugal Telecom SGPS SA
6623	NKE US EQUITY	NIKE Inc.
6641	EXX SJ EQUITY	EXXARO RESOURCES LTD
6645	LALAB MM EQUITY	Grupo Lala S.A
6660	CEMEX - CX US EQUITY	CEMEX SAB DE CV ADR EUA
6721	GRUMAB MM EQUIY	Gruma SAB de CV
6722	CHDRAUIB MM EQUITY	Grupo Comercial Chedraui SA de CV
6761	CIB US EQUITY	BANCOLOMBIA SA - ADR
6762	CL US EQUITY	COLGATE-PALMOLIVE CO
6763	RBGLY US EQUITY	RECKITT BENCKISER GROUP PLC - ADR
6821	TSLA US EQUITY	TESLA MOTORS INC
6841	AXP US EQUITY	AMERICAN EXPRESS CO
6901	CORPBANC CI EQUITY	Corpbanca SA
6982	FORUS CI EQUITY	Forus SA
7061	AVH US EQUITY	AVIANCA HOLDINGS SA - SPON ADR
7141	NE US EQUITY	NOBLE CORP PLC

iv. Informar em valor o Limitador Inferior ou Superior para os proventos em dinheiro, quando houver no campo "Denominação".

c) Os ajustes relativos à subscrição ou qualquer outro direito de preferência serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela incorporação do valor teórico do direito de subscrição, na curva corrigida pela variação da ação;

i. Informar os casos em que não haja previsão de ajuste em função de subscrição ou qualquer outro direito de preferência no campo "Denominação";

d) Para bonificação ou qualquer evento que altere a quantidade de ações os ajustes serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela correção do preço de referência pelo fator de bonificação no campo "Denominação".

9-) É permitido utilizar participações de alta e de baixa (em percentual) sobre as curvas.

a) Na hipótese de cada curva ter apenas uma participação, esta deve ser informada exclusivamente no campo "Percentual" em "Curvas para Atualização".

b) Caso houver participações de alta e de baixa diferentes sobre as curvas, estas devem ser informadas (em percentual) no campo "Denominação", e o campo "Percentual" em "Curvas para Atualização" deve ser preenchido como "100".

<b>7201</b>	DIS US EQUITY	Walt Disney Co/The
<b>7261</b>	BVC CB EQUITY	Bolsa de Valores de Colômbia
<b>7281</b>	BAP PE Equity	CREDICORP LTD
<b>7282</b>	PFDVVND CB Equity	BANCO DAVIVIENDA AS
<b>7321</b>	HABITAT CI EQUITY	Administradora de Fondos de Pensiones Habitat SA
<b>7342</b>	GFI US Equity	GOLD FIELDS LTD ADR
<b>7361</b>	BAP US Equity	CREDICORP LTD ADR
<b>7402</b>	IBM US Equity	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP
<b>7523</b>	KIMBERA MM EQUITY	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A
<b>7643</b>	PFAVAL CB Equity	Grupo Aval Acciones - PF
<b>7644</b>	MEGACPO MM Equity	Megacable Holding CPO
<b>7703</b>	SDRL US EQUITY	SEADRILL LTD
<b>7783</b>	SAB LN EQUITY	SABMILLER PLC
<b>7805</b>	CIE SM Equity	CIE AUTOMOTIVE SA
<b>7823</b>	DVR US EQUITY	CAL DIVE INTERNATIONAL INC
<b>7923</b>	GOL US Equity	GOL LINHAS AEREAS INTEL- ADR
<b>7984</b>	OMAB US Equity	GRUPO AEROPORTUARIO CEN-ADR
<b>8049</b>	PGN US Equity	PARAGON OFFSHORE PLC
<b>8146</b>	ASURB MM Equity	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B
<b>8147</b>	EMBONOB CI Equity	COCA-COLA EMBONOR AS-B
<b>8148</b>	SMSAAM CI Equity	SOCIEDAD MATRIZ SAAM SA
<b>8167</b>	XLK US Equity	TECHNOLOGY SELECT SECT SPDR
<b>8266</b>	BCH US Equity	BANCO DE CHILE - ADR
<b>8307</b>	FIBRAMQ MM Equity	MACQUARIE MEXICO REAL STATE
<b>8311</b>	LBTYA US Equity	LIBERTY GLOBAL PLC-A
<b>8367</b>	ADM LN Equity	ADMIRAL GROUP PLC

<b>8386</b>	RIG US Equity	TRANSOCEAN LTD
<b>8626</b>	GAPB MM Equity	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B
<b>8627</b>	AMXL MM Equity	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L
<b>8628</b>	GMEXICOB MM Equity	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B
<b>8629</b>	PREC CB Equity	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP
<b>8666</b>	BSBR US Equity	BANCO SANTANDER BRASIL - ADS
<b>8708</b>	BRK/A US Equity	Berkshire Hathaway Inc – CL A
<b>8709</b>	ZTS US Equity	ZOETIS INC
<b>8766</b>	IFS PE Equity	INTERCORP FINANCIAL SER INC
<b>8787</b>	ESRX US Equity	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO
<b>8888</b>	KO US Equity	COCA-COLA CO/THE
<b>8906</b>	VRX US Equity	VALEANT PHARMACEUTICA LS INTE
<b>8967</b>	BSAN CI Equity	BANCO SANTANDER CHILE
<b>8968</b>	SMCHILEB CI Equity	SM-CHILE SA-B
<b>8987</b>	COLBUN CI Equity	COLBUN SA
<b>9007</b>	GPC US Equity	GENUINE PARTS CO
<b>9027</b>	SID US Equity	CIA SIDERURGICA NAACL-SP - ADR
<b>8247</b>	AGUAS/A CI Equity	AGUAS ANDINAS SA-A
<b>9047</b>	PBR/A US Equity	PETROLEO BRASIL-SP PREF ADR
<b>9067</b>	ECL CI Equity	E.CL SA
<b>9087</b>	VRSN US Equity	VERISIGN INC
<b>9127</b>	FRES LN Equity	FRESNILLO PLC
<b>9168</b>	TPX US Equity	TEMPUR SEALY INTERNATIONAL I
<b>9187</b>	CME US Equity	CME GROUP INC
<b>9210</b>	BCA US Equity	CORPBANCA SA- ADR
<b>9235</b>	STX US Equity	Seagate Technology



<b>9255</b>	FCFS US Equity	FIRST CASH FINL SVCS INC
<b>9278</b>	ANN GY Equity	DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILE
<b>9279</b>	P1Z GY Equity	PATRIZIA IMMOBILIEN AG
<b>9295</b>	DWNI GY Equity	DEUTSCHE WOHNEN AG-BR
<b>9296</b>	LEG GY Equity	LEG IMOBILIEN AG
<b>9297</b>	TEG GY EQUITY	TAG IMMOBILIEN AG
<b>9298</b>	GFJ GY EQUITY	GAGFAH SA
<b>9316</b>	PCLN US Equity	PRICELINE GROUP INC/THE
<b>9355</b>	KRFT US EQUITY	KRAFT FOODS GROUP INC
<b>9417</b>	POST US Equity	POST HOLDINGS INC
<b>9418</b>	DHR US Equity	DANAHER CORP
<b>9419</b>	DFE US Equity	WISDOMTREE EUR S/C DIVIDEND
<b>9437</b>	IBA US Equity	INDUSTRIAS BACHOCO SAB SP AD
<b>9498</b>	LBRDA US Equity	LIBERTY BROADBAND-A
<b>9542</b>	BACHOCOB MM Equity	INDUSTRIAS BACHOCO – SER B
<b>9559</b>	CLNX SM Equity	CELLNEX TELECOM SAU
<b>9582</b>	VITROA MM Equity	VITRO S.A.B. - SERIES
<b>9584</b>	TWC US Equity	Time Warner Cable
<b>9627</b>	UNIFINA MM Equity	UNIFIN FINANCIERA SAPI DE CV
<b>9727</b>	ANTM US Equity	ANTHEM INC
<b>9728</b>	CNA US Equity	CNA FINANCIAL CORP
<b>9729</b>	PFE US Equity	PFIZER INC
<b>9730</b>	SNY US Equity	SANOFI – ADR
<b>9731</b>	SUNE US Equity	SUNEDISON INC
<b>9747</b>	INRETC1 PE EQUITY	INRETAIL PERU CORP
<b>9789</b>	MDLZ US EQUITY	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A
<b>9791</b>	BAM US Equity	BROOKFIELD ASSET MANAGE- CL A
<b>9792</b>	LILA US Equity	LIBERTY LILAC GROUP-A

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
9812	KHC US Equity	KRAFT HEINZ CO/THE		
9849	ML FP Equity	MICHELIN (CGDE)		
9928	AAPL UQ Equity	Apple INC		
9929	AAPL UW Equity	Apple INC		
9948	OMAB MM EQUITY	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT		
9990	PE&OLES* MM EQUITY	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		
9991	TSN US EQUITY	TYSON FOODS INC-CL A		
9992	PPC US EQUITY	PILGRIM'S PRIDE CORP		
9993	NEM US EQUITY	NEWMONT MINING CORP		
9994	BVN US EQUITY	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR		
10170	VOLARA MM EQUITY	CONTROLADORA VUELA CIA DE-A		
10211	ATVI US Equity	ACTIVISION BLIZZARD INC		
10247	ELP US Equity	CIA PARANAENSE ENER-SP ADR		
10251	ITUB US Equity	ITAU UNIBANCO H-SPON PRF ADR		
10375	UVE US Equity	UNIVERSAL INSURANCE HOLDING		
10381	DBK GY Equity	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		
10382	GOOGL US Equity	ALPHABET INC – CL A		
10453	ITCB US Equity	ITAU CORPBANCA – ADR		
10513	TRUP US Equity	TRUPANION INC		
10553	SCHA NO Equity	SHIBSTED ASA-CL A		
10614	CMCSA US EQUITY	COMCAST CORP – CLASS A		
10615	MSFT US Equity	MICROSOFT CORP		
10633	TAP US Equity	MOLSON COORS BREWING CO - B		
10638	BHP US Equity	BHP BILLITON LTD-SPON ADR		
10673	CHTR US EQUITY	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		
10695	NG US Equity	NOVAGOLD RESOURCES INC		
10713	FB US Equity	FACEBOOK INC - A		
10714	AGRO US Equity	ADECOAGRO SA		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
10734	WPPGY US Equity	WPP PLC – SPONSORED ADR		
10756	COTY US Equity	COTY INC – CL A		
10637	RYA ID Equity	RYANAIR HOLDINGS PLC		
10793	PZE US Equity	PETROBRAS ARGENTINA - ADR		
10857	AIG US Equity	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP		
10981	SMU CI Equity	SMU S.A.		
11023	TGS US Equity	TRANSPORTAD OR GAS SUR SP B-ADR		
11081	EDN US Equity	EMP DISTRIB Y COMERC NOR-ADR		
11101	QSR US Equity	RESTAURANT BRANDS INTERN		
11121	DLTR US Equity	DOLLAR TREE INC		
11241	GS US Equity	GOLDMAN SACHS GROUP INC		
11282	ALPEKA MM Equity	ALPEX SAB de CV		
11302	BSAC US Equity	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR		
11061	PINFRA MM Equity	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF		
11261	VESTA MM Equity	CORP INMOBILIARIA VESTA SAB		
11322	NTES US Equity	NETEASE INC-ADR		
11343	CIG US Equity	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - ADR		
11342	AZUL US Equity	AZUL SA - ADR		
11402	BBAJIO MM Equity	BANCO DEL BAJIO S.A.		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
11422	ILC CI Equity	INVERSIONES LA CONSTRUCCION SA		
11423	600519 CH Equity	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A		
11462	BABA US Equity	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR		
11442	LYV US Equity	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC		
11482	SNAP US Equity	SNAP INC - A		
11542	AMZN US Equity	AMAZON.COM INC		
11623	VISTAA MM Equity	VISTA OIL & GAS SAB DE CV		
11622	TRICOT CI Equity	EMPRESAS TRICOT SA		
11684	SNH GY Equity	STEINHOFF INTERNACIONAL H NV		
11685	SNH GR Equity	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV		
11763	NFLX US Equity	NETFLIX INC		
11783	CBD US Equity	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIÇÃO – ADR		
11863	GLO LN Equity	CONTOURGLOBAL PLC – WI		
11843	LOMA US Equity	LOMA NEGRA CIA INDUSTRIAL AR		
11883	ATTO US Equity	ATENTO SA		
12047	TCEHY US Equity	TECENT HOLDINGS LTD-UNS ADR		
12044	FCAU UN Equity	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		
12045	JD US Equity	JD.COM INC-ADR		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
12046	TTWO US Equity	TAKE – TWO INTERACTIVE SOFTWARE		
12084	GICSAB MM Equity	GRUPO GICSA SA DE CV5		
12044	FCAU UN Equity	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		
12165	PAGS US Equity	PAGSEGURO DIGITAL LTD-CL A		
12105	SFTBY US Equity	SOFTBANK GROUP CORP-UNSP ADR		
12207	6758 JT Equity	SONY CORP		
12208	BBVA SM Equity	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		
12267	SQM US Equity	QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR		
12307	LTM US Equity	LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR		
12187	FCFE18 MM Equity	CFE CAPITAL S DE RL DE CV		
12167	CAAP US Equity	CORP AMERICA AIRPORT SA		
12166	ARCO US Equity	ARCOS DOURADOS HOLDINGS INC-A		
12411	PAC US Equity	GRUPO AEROPORTUARIO PAC-ADR		
12387	SPOT US Equity	SPOTIFY TECHNOLOG SA		
12347	SUPV US Equity	GRUPO SUPERVIELLE AS – SP ADR		
12507	BIDU US Equity	BAIDU INC – SPON ADR		
12487	SCCO US Equity	SOUTHERN COPPER CORP		
12467	BOX US Equity	BOX INC – CLASS A		

12568	PX US Equity	PRAXAIR INC
12667	CRM US Equity	SALESFORCE.COM INC
12787	MALLPLAZ CI Equity	PLAZA SA Y FILIALES
12950	GLP UP Equity	GLOBAL PARTNERS LP
13088	ACBFF US Equity	AURORA CANNABIS INC
13067	LINU GR Equity	LINDE AG - TENDER
13087	NFLX UW Equity	NETFLIX INC
13209	CRESY US Equity	CRESUD S.A. – SPONS ADR
13210	CEPU US Equity	CENTRAL PUERTO – SPONSORED ADR
13149	AGG US Equity	ISHARES CORE U.S. AGGREGATE
13129	BNR GR Equity	BRENNTAG AG
13269	AMZN UW Equity	AMAZON.COM INC
13270	BABA UN Equity	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR
13309	STNE US Equity	STONECO LTD-A
13349	SE US Equity	SEA LTD-ADR
9361	BKNG US Equity	BOOKING HOLDINGS INC
13469	IRCP US Equity	IRSA PROPIEDADES COMERCI-ADR
13609	EA US Equity	ELECTRONIC ARTS INC
13629	WB US Equity	WEIBO CORP- SPON ADR

13689	6758 JP Equity	SONY CORP
13569	005930 KP Equity	SAMSUNG ELETRONICS CO LTD
13849	NETS US Equity	NETSHOES CAYMAN LTD
13911	IPOA US Equity	SOCIAL CAPITAL HEDOSOPHIA HO
13973	SUZ US Equity	SUZANO SA – SPON ADR
13951	WCAGY US Equity	WIRECARD AG – UNSPON ADR
13993	WORK US Equity	SLACK TECHOLOGIES INC – CL A
13990	DIS UM Equity	WALT DISNEY CO/THE
13995	EXITO CB Equity	ALMACENES EXITO SA
14191	7974 JT	NINTENDO CO LTD
14210	IFS US Equity	INTERCORP FINANCIAL SERVICES
14230	KER FP Equity	KERING
14291	SBS US Equity	CIA SANEAMENTO BASICO SP - ADR
14331	MCD UN Equity	McDonald's Corp
14423	FTCH US Equity	FARFETH LTD- CLASS A
14443	V US Equity	VISA INC-CLASS A SHARES
14503	BA US Equity	BOEING COMPANY

<b>14543</b>	DESP US Equity	DESPEGAR.COM
<b>14583</b>	GOOGL UW Equity	ALPHABET INC
<b>14603</b>	NEXA US Equity	NEXA RESOURCES SA
<b>14663</b>	V UN Equity	VISA INC-CLASS A SHARES
<b>14683</b>	BAC US Equity	BANK OF AMERICA CORP
<b>14684</b>	SCHW US Equity	SCHWAB – CHARLES – CORP
<b>14685</b>	KO UN Equity	COCA-COLA CO/THE
<b>14686</b>	XP US Equity	XP INC – CLASS A
<b>14763</b>	ACEL/WS US Equity	ACCEL ENTERTAINMENT INC
<b>14783</b>	GM UN	GENERAL MOTORS CO
<b>14803</b>	UBER UN Equity	UBER TECHNOLOGIES INC
<b>14824</b>	VVNT US Equity	VIVINT SMART HOME INC
<b>14825</b>	SCR CN Equity	SCORE MEDIA AND GAMING INC
<b>14864</b>	CNE CN Equity	CANACOL ENERGY LTD
<b>14885</b>	FCX US Equity	FREEPORT- MCMORAN INC
<b>14984</b>	ENIC US Equity	ENEL CHILE SA- ADR
<b>14986</b>	JNJ UN Equity	JOHNSON & JOHNSON



<b>15005</b>	NLMK LI Equity	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR
<b>15048</b>	AGI US Equity	ALAMOS GOLD IND-CLASS A
<b>15049</b>	AEM US Equity	AGNICO EAGLE MINES LTD
<b>15125</b>	FNV US Equity	FRANCO - NEVADA CORPORATION
<b>15126</b>	GOLD US Equity	BARRICK GOLD CORPORATION
<b>15166</b>	USFD US Equity	US FOODS HOLDING CORP
<b>15184</b>	TECK US Equity	TECK RESOURCES LTD-CLS B
<b>15331</b>	SHOP UN Equity	SHOPIFY INC – CLASS A
<b>15332</b>	SQ UN Equity	SQUARE INC - A
<b>15344</b>	VSTA US Equity	VASTA PLATAFORM LTD
<b>15347</b>	ARCE US Equity	ARCO PLATAFORM LTD – CLASS A
<b>15348</b>	FM CN Equity	FIRST QUANTUM MINERALS LTD
<b>15364</b>	TAST US Equiy	CARROLS RESTAURANT GROUP INC
<b>15384</b>	GILD US Equity	GILEAD SCIENCES INC
<b>15385</b>	AZN US Equity	ASTRAZENECA PLC-SPONS INC
<b>15413</b>	NEM UN Equity	NEWMONT CORP

15414	GOLD UN Equity	BARRICK GOLD CORP
15415	AU UN Equity	ANGLOGOLD ASHANTI-SPONT ADR
15416	AEM UN Equity	AGNICO EAGLE MINES LTD
15420	BLMN US Equity	BLOOMIN' BRANDS INC
15422	NGD US Equity	NEW GOLD INC
15424	CCJ US Equity	CAMECO CORP
15468	GME US Equity	GAMESTOP CORP – CLASS A
15488	CLF US Equity	CLEVELAND- CLIFFS INC
15490	VRTX UW Equity	VERTEX PHARMACEUTICA LS INC
15491	DXCM UW Equity	DEXCOM INC
15497	EQX US Equity	EQUINOX GOLD CORP
15497	EQX US Equity	EQUINOX GOLD CORP
15499	ZEN US Equity	ZENDESK INC
15501	SBER LI Equity	SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR
15502	SKG LN Equity	SMURFIT KAPPA GROUP PLC
15503	AAL LN Equity	ANGLO AMERICAN PLC
15517	WRK US Equity	WESTROCK CO

<b>15518</b>	IP US Equity	INTERNATIONAL PAPER CO
<b>15532</b>	CCL US Equity	CARNIVAL CORP
<b>15533</b>	YNDX US Equity	YANDEX NV-A
<b>15534</b>	INAQ US Equity	INSU ACQUISITION CORP – CL A
<b>15535</b>	JOF US Equity	JAPAN SMALLER CAPITALIZATION
<b>15539</b>	CMI US Equity	CUMMINS INC
<b>15538</b>	NKLA US Equity	NIKOLA CORP
<b>15537</b>	BLPD US Equity	BALLARD POWER SYSTEM INC
<b>15540</b>	LIN US Equity	LINDE PLC
<b>15541</b>	PYPL US Equity	PAYPAL HOLDING INC
<b>15542</b>	POG LN Equity	PETROPAVLOVS K PLC
<b>15543</b>	POLY LN Equity	POLIMETAL INTERNATIONAL PLC
<b>15544</b>	MAIL LI Equity	MAIL.RU GROUP-GDR REGS
<b>15545</b>	ITM LN Equity	ITM POWER PLC
<b>15547</b>	PVG US Equity	PRETIUM RESOURCES INC
<b>15553</b>	TENB US Equity	TENABLE HOLDINGS INC

<b>15615</b>	PFE UN Equity	PFIZER INC
<b>15616</b>	MELI UW Equity	MERCADO LIBRE INC
<b>15633</b>	EBR US Equity	CENTRAIS ELETRICAS BR- SP ADR
<b>15634</b>	MNOD LI Equity	MMC NORILSK NICKEL PJSC- ADR
<b>15635</b>	VINP US Equity	VINCI PARTNERS INVESTMENTS – A
<b>15637</b>	MWK US Equity	MOHAWK GROUP HOLDINGS INC
<b>15655</b>	SQ US Equity	SQUARE INC - A
<b>15656</b>	SF SS Equity	STILLFRONT GROUP AB
<b>15659</b>	NVDA US Equity	NVDA US Equity
<b>15665</b>	TSLA UW Equity	TESLA INC
<b>15801</b>	OXY US Equity	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP
<b>15803</b>	HP US Equity	HELMERICH & PAYNE

## Ativos

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
2456	BANBRA 8 1/2 10/29/49 Corp - REGS	BANCO DO BRASIL (CAYMAN) ISIN 3772WAA01	1) Os indicadores devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação cumulada do PU/Cota do ativo entre a data de início do contrato e o vencimento.  2) Somente será permitida a utilização de ativo cujo PU/Cota tenha divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.	1) Informação do ativo e seu PU/Cota inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo".
2495	INCMBZ 5 3/4 07/17/24 Corp - REGS	CIMPOR FINANCIAL OPERTNS ( ISIN USN20137AD23 )		2) Tipos de Variação de preço:
2535	DAYCOV 5 3/4 03/19/19 Corp - REGS	BANCO DAYCOVAL SA (ISIN XS1046809171)		a) No caso de variação Quanto, informar "ausência de variação cambial" ou "variação quanto" no campo "Denominação".
2555	PETBRA 5 3/4 01/27/21 Corp	PETROBRAS GLOBAL FINANCE ( ISIN US71645WAR25 )		b) Se a variação de preços for em reais, informar "variação em reais" no campo "Denominação".
2556	ABCBBZ 7 7/8 04/08/20 Corp - REGS	BANCO ABC-BRASIL SA (ISIN USP0763MBW03)		c) Caso não seja informado nenhuma das situações acima, será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que o ativo é cotado, com variação cambial no campo "Denominação".
5124	WN Ultra T Bond	WN Ultra T Bond		3) Indicação da Fonte de Informação; Mês/Ano de Vencimento do papel; Horário da Cotação; Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste ou Spot - cotação referente a um horário e fonte de informação específicos); Data de cotação, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação"; Câmbio para Conversão, com a indicação da respectiva referência (Fechamento; Média; Mínima ou Máxima).
5174	JB COMB COMDTY - JPN 10Y BOND (TSE)	10 - year JGB Future Contract		4) Informar, quando houver, cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)":
5714	COSAN LUXEMBOURG SA	COSAN LUXEMBOURG SA - ISIN US22112EAA64		a) Na base 360 – Atvs Pub Inter e Cts Fdos Inter.;
6237	OGX AUSTRIA GMBH	ISIN USP7356YAA12		b) Na base 252 – Atvs Priv Nac.e Cts Fdos Nac.
6419	Títulos do Tesouro Americano	Títulos do Tesouro Americano		5) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.
6644	BNDES 5,75 26/09/2023	BNDES 2023 Notes (US059614AM99)		Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
7041	KLAB 12.24 01/08/19 Corp	KLABIN S.A. - ISIN BRKLBNDM007		6) Se utilizada a média de cotações:
7341	ADT 3 1/2 07/15/22 CORP	ADT CORPORATION ISIN US00101JAF30		a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou
7382	BRPRSA 9 10/29/49 CORP	BR PROPERTIES SA ISIN USP1909VAA28		
7383	FTR 7 1/8 01/15/23 Corp	FRONTIER COMM ISIN US35906AAM09		
7401	WIN 7 1/2 04/01/23 CORP	WINDSTREAM CORP ISIN US97381WAU80		
7623	GSHPBR 10 11/29/49 Corp	GENERAL SHOPPING GSHPBR 10 11/49 USG3812BAB65		
7704	GSHPBR 12 12/20/49 CORP	GENERAL SHOPPING GSHPBR VAR 12/49 (USG3812TAA90)		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
7763	CNK 5 1/8 15/12/2022 Corp	CINEMARK USA INC 5 1/8 15/12/22 - US172441AX54		b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.
7824	CASCN 5 1/2 07/15/22 Corp US146900AM71	CASCADES INC		7) Tratamento de Pagamento de juros do papel:
7924	ASCMA 9 1/8 04/01/20 Corp	MONICTRONICS INTL ASCMA 9 1/8 20-18 (US609453AGO2)		a) Caso seja incorporado pagamento de juros do papel à variação do preço do ativo, favor informar no campo "Denominação"
7985	ATCNA 7 3/4 05/15/22 Corp	ALTICE USL0179ZAA23		b) Se for o caso, informar no campo "Denominação" se o juros incorporado será corrigido pelo %CDI ou CDI + cupom (exemplo: 120% CDI ou CDI+1,00%aa)
8025	INTEL 6 ¾ 06/01/18 Corp	INTELSAT LUXEMBOURG US458204AN49		
8026	SCI 4 1/2 11/15/20 Corp	SERVICE CORP US817565BW39		
8027	FMEGR 5 5/8 07/31/19 Corp	FRESENIUS MED CARE II USU31434AB68		8) Caso seja Fluxo de Caixa, informar se será considerada a variação do preço do ativo nos fluxos ou somente no vencimento/amortização.
8230	GPIXLX 10 01/29/49 Corp	GP INVESTMENTS LTD (XS0282340230)		
8087	GYI 7 10/15/20 Corp	GETTY IMAGES INC US398176AA53		
8088	NOKIA 5 3/8 05/15/19 Corp	NOKIA OYJ US654902AB18		
8286	GYI 7 10/15/20 Corp - REGS	GETTY IMAGES INC (USU03896AA28)		
8308	DBPHLD 7 ¾ 10/15/20 Corp – REGS	DBP HOLDING CORP (ISIN USU24000AA68)		
8309	DBPHLD 7 ¾ 10/15/20 Corp – 144A	DBP HOLDING CORP (ISIN US23306BAA61)		
8310	AUTGIL 6 ¾ 01/15/23 Corp - REGS	AUTOMOTORES GILDEMEISTER (USP06006AC75)		
8326	AUTGIL 8 ¼ 05/24/21 Corp - REGS	AUTOMOTORES GILDEMEISTER (ISIN USP06006AA10)		
8347	BKW 6 04/01/22 Corp - REGS	1011778 BC / NEW RED FIN (USC6900PAA78)		
8366	BKW 6 04/01/22 Corp – 144A	1011778 BC / NEW RED FIN (ISIN US68245XAA72)		
8406	VRXCN 7 ½ 07/15/21 Corp (REGS)	VALEANT PHARMACEUTICALS (ISIN USC96715AA29).		
8407	VRXCN 7 ½ 07/15/21 Corp (144A)	VALEANT PHARMACEUTICALS (ISIN US92912EAA10)		
8426	BANBRA 9 06/29/49 Corp - REGS	BANCO DO BRASIL – CAYMAN (ISIN USP3772WAF97)		
8447	CBB 8 3/8 10/15/20 Corp	CINCINNATI BELL INC (ISIN US171871AN65)		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
8486	CCI 4 7/8 04/15/22 Corp	CROWN CASTLE INTL CORP (ISIN US228227BE31)		
8487	SBAC 5 5/8 10/01/19 Corp	SBA COMMUNICATIONS CORP (ISIN US78388JAQ94)		
8488	CLF 3.95 01/15/18 Corp	CLIFFS NATURAL RESOURCES (ISIN US18683KAF84)		
8526	INTEL 8 1/8 06/01/23 Corp	INTELSAT LUXEMBOURG SA (ISIN US458204AQ79)		
8566	JEFFIN 7 1/2 04/15/21 Corp - 144A	JEFFERIES FIN LL/JFIN US47232MAC64		
8706	FRTR 1 3/4 11/25/24 Corp	FRANCE O.A.T. ISIN FR0011962398		
8707	T 2 3/8 08/15/24 Govt	US TREASURY N/B ISIN US912828D564		
8886	TDG 5 1/2 10/15/20 Corp	TRANSDIGM INC (ISIN US893647AR89)		
8887	VRXCN 6 3/4 08/15/21 Corp (REGS)	VALEANT PHARMACEUTICALS (ISIN USU9098WAA81)		
9148	DLTR 5 3/4 03/01/23 CORP - REGS	FAMILY TREE ESCROW LLC (ISIN USU3080PAA67)		
9149	CITHOL 10 3/4 02/15/20 CORP - 144A	CITGO HOLDING INC (ISIN US17302WAA62)		
9211	USFOOD 8 1/2 06/30/19 Corp	US FOOD INC ISIN US90290MAA99		
9212	QSRCN 6 04/01/22 Corp - 144A	1011778 BC / NEW RED FIN (ISIN US68245XAA72)		
9375	DUFSCA 5 1/2 10/15/20 Corp - REGS	DUFRY FINANCE SCA (ISIN USL2660RAA25)		
9420	DVA 5 05/01/25 Corp	DAVITA HEALTHCARE PARTNE ISIN US23918KAR95		
9458	DBRI 1 3-4 04 15 20 Corp	DEUTSCHLAND I L BOND DBRI 1 3-4 04 20		
9459	DBRI 0.1 04 15 23 Corp	DEUTSCHLAND I L BOND DBRI 0.1 04 15 23		
9538	NLSN 5 04/15/22 Corp - REGS	NIELSEN FINANCE LLC/CO ISIN USU65393AM96		
9543	STZ 4 1/4 05/01/23 Corp	CONSTELLATION BRANDS INC ISIN US21036PAL22		
9558	SEE 4 7/8 12/01/22 Corp - REGS	SEALED AIR CORP ISIN USU81193AM38		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
9560	PETBRA 8 3/8 12/10/18 Corp	PETROBRAS GLOBAL FINANCE ISIN US71645WAH43		
9581	SUZANO 5 7/8 01/23/21 Corp - REGS	SUZANO TRADING LTD ISIN USG8600UAA19		
9578	CSANBZ 8 1/4 11/29/49 Corp	COSAN OVERSEAS LTD ISIN XS0556373347		
9579	BRMLBZ 8 1/2 01/29/49 Corp - REGS	BR MALLS INTL FI BRMLBZ8 ½ 43-16 (ISIN USG1593PAB43)		
9583	TUPY 6 5/8 07/17/24 Corp	TUPY OVERSEAS SA (ISIN USL9326VAA46)		
9585	ITAU 5 ¾ 01/22/21 Corp	ITAU UNIBANCO HLDG AS/KY (ISIN US46556MAB81)		
9586	BRADES 5.9 01/16/21 Corp	BANCO BRADESCO CI BRADES 5.9 01/21 (ISIN USGO732RAF58)		
9587	GGBRBZ 5 3/4 01/30/21 Corp - REGS	GERDAU TRADE INC (ISIN USG3925DAA84)		
9647	BRFSBZ 3.95 05/22/23 Corp - REGS	BRF SA (ISIN USP1905CAD22)		
9732	BCOBMG 8 04/15/18 CORP	BANCO BMG SA ISIN USP07785AF85		
9768	CIELBZ 3 3/4 11/16/22 Corp - REGS	CIELO SA/ CIELO USA INC (ISIN USP28610AA46)		
9790	ITAU 5 1/2 08/06/22 - REGS	ITAU UNIBANCO HLDG AS/KY (ISIN US46556MAH51)		
9809	EMBRBZ 5.15 06/15/22 Corp	EMPRESA BRAS DE AERONAU (ISIN US29082AAA51)		
9810	PETBRA 7 7/8 03/15/19 Corp	PETROBRAS GLOBAL FINANCE ISIN US71645WAN11		
9811	BANBRA 5 7/8 01/26/22 Corp - REGS	BANCO DO BRASIL (CAYMAN) (ISIN USG07402DN01)		
9848	INTEL 7 ¼ 04/01/19 Corp	INTELSAT JACKSON HLDG (ISIN US45824TAE55)		
9850	DVA 5 1/8 07/15/24 Corp	DAVITA HEALTHCARE PARTNE ISIN US23918KAQ13		
9908	CAIXBR 2 3/8 11/06/17 Corp	CAIXA ECONOMICA FEDERAL ( ISIN US12803X2A85 )		
9989	BRSRBZ 7 3/8 02/02/22 Corp - REGS	BANCO EST RIO GRANDE SUL (ISIN USP12445AA33)		
10051	PETBRA 4 7/8 03/17/20 Corp	PETROBRAS GLOBAL FINANCE (ISIN US71647NAH26)		



Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
10090	BCOBMG 9.95 11/05/19 Corp	BANCO BMG S.A. ( ISIN USP07785AD38 )		
10091	CSNABZ 6 7/8 09/21/19 Corp	CSN ISLAND XI CORP (ISIN USG2583XAA93 )		
10110	ELEBRA 5 3/4 10/27/21 Corp - REGS	CENT ELET BRASILEIRAS SA (ISIN USP22854AG14)		
10150	SAMMIN 4 1/8 11/01/22 Corp - REGS	SAMARCO MINERAÇÃO SA ( ISIN USP84050AA46 )		
10190	ADT 4 7/8 07/15/42 Corp	ADT CORP ( ISIN US00101JAG13 )		
10192	JEFFIN 7 3/8 04/01/20 Corp - 144 <sup>a</sup>	JEFFERIES FIN LLC / JFIN ISIN US47232MAA09		
10193	FMEGR 5 5/8 07/31/19 Corp - 144 <sup>a</sup>	FRESENIUS MED CARE II ISIN US35802XAD57		
10252	ITAU 5.65 03/19/22 Corp	ITAU UNIBANCO HLDG SA/KY ( ISIN: US46556MAF95)		
10312	VALEBZ 4 3/8 01/11/22 Corp	VALE OVERSEAS LIMITED ( ISIN: US91911TAM53 )		
10332	BCOPAN 8 ½ 04/23/20 Corp - REGS	BANCO PAN SA ( ISIN: USP14996AG02 )		
10353	BNDES 6.369 06/16/18 Corp	BANCO NACIONAL DE DESENVOLVIMENTO ECONÔMICO (ISIN: USP14486AA54)		
10354	CAIXBR 4 ¼ 05/13/19 Corp	CAIXA ECONOMICA FEDERAL (ISIN:US12803X2D25)		
10355	ITAU 2.85 05/26/18 Corp - REGS	ITAU UNIBANCO HLDG AS/KY ( ISIN: US46556MAK80 )		
10373	BRAZIL 4 1/4 01/07/25 Corp	FEDERAL REPUBLIC OF BRAZIL (ISIN:US105756BV13)		
10374	EMBRBZ 6 3/8 01/24/17 Corp	EMBRAER OVERSEAS ISIN:US29081YAB20		
10376	SBSPBZ 6 1/4 12/16/20 Corp	CIA SANEAMENTO BÁSICO (ISIN:BBG001B80HG2)		
10377	TAEEBZ Float 10/15/17 Corp	TRANS. ALIANÇA DE ENERGIA ELÉTRICA S/A (ISIN: BRTAEEDBS050)		
10378	CAIXBR 7 1/4 07/23/24 Corp	CAIXA ECONOMICA FEDERAL ISIN: USP1932YAA75		
10379	BRASKM 7 3/8 10/29/49 Corp	BRASKEM FINANCE LTD (ISIN USG1315RAC54)		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
10393	BRADES 6 3/4 09/29/19 Corp	BANCO BRADESCO CAYMAN (ISIN USG08010BH52)		
10394	BRASKM 5 3/4 04/15/21 Corp	BRASKEM FINANCE LTD ISIN USG1315RAD38		
10474	BANSAF 6 3/4 01/27/21 Corp	BANCO SAFRA SA (ISIN USP1507FAA32)		
10475	VALEBZ 6 7/8 11/21/36 Corp	VALE OVERSEAS LIMITED (ISIN: US91911TAH68)		
10476	GGBRBZ 4 3/4 04/15/23 Corp	GERDAU TRADE INC (ISIN USG3925DAB67)		
10477	SAMMIN 5 3/8 09/26/24 Corp	SAMARCO MINEIRAÇÃO SA ISIN USP84050AC02		
10478	GGBRBZ 7 1/4 04/16/44 Corp	GTL TRADE FINANCE INC (ISIN: USG2440JAG07)		
10533	GOLLBZ 9 1/4 07/20/20 Corp	GOL FINANCE (ISIN: USG3980PAD71)		
10536	BBDBCN 7 3/4 03/15/20 Corp	BOMBARDIER INC (ISIN: USC10602AP29)		
10537	BEEFBZ 7 3/4 01/31/23 Corp	MINERVA LUXEMBOURG SA (ISIN: USL6401PAC79)		
10573	VOTORA 7 1/4 04/05/41 Corp	VOTORANTIN CIMENTOS SA (ISIN:USP98088AA83)		
10578	PETBRA 8 3/4 05/23/26 Corp	PETROBRAS GLOBAL FINANCE (ISIN:US71647NAQ25)		
10579	PETBRA 6.85 06/05/15 Corp	PETROBRAS GLOBAL FINANCE (ISIN:US7164NAN93)		
10583	ALTICE 8 1/8 01/15/24 Corp	ALTICE FINCO SA (ISIN:US02154EAB56)		
10584	FTR 10 1/2 09/15/22 Corp	FRONTIER COMMUNICATIONS (ISIN:US35906AAW80)		
10593	USIM 7 1/4 01/18/18 Corp	USIMINAS COMERCIAL LTD (ISIN: USG93085AA94)		
10594	ELEBRA 6 7/8 07/30/19 Corp	CENT ELET BRASILEIRAS SA ISIN USP22854AF31		
10596	SPGB 1.95 04/30/26 Corp	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO (ISIN: ES00000127Z9)		
10613	PETBRA 8 3/8 05/23/21 Corp	PETROBRAS GLOBAL FINANCE (ISIN:US71647NAP42)		
10616	EMBRBZ 5.05 06/15/25 Corp	EMBRAER NETHERLANDS FINA (ISIN:US29082HAA05)		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
10617	BANBRA 5 7/8 01/19/23 Corp	BANCO DO BRASIL (CAYMAN) – ISIN: USP3772WAE23		
10634	VALEBZ 8 ¼ 01/17/34 Corp	VALE OVERSEAS LIMITED (ISIN:US91911TAE38)		
10653	BRASKM 7 1/8 07/22/41 Corp	BRASKEM AMERICA FINANCE (ISIN:USU1065PAA94)		
10694	GOLLBZ 9 1/2 07/20/21 Corp	GOL LUXCO AS (ISIN: USL4441PAC43)		
10813	BANBRA 6 1/4 10/29/49 Corp - REGS	BANCO BRASIL CAYMAN (ISIN USG07402DP58)		
11001	BCOBMG 8 7/8 08/05/20 Corp	BANCO BMG AS (ISIN USP077855AE11)		
1102	Saener 7.4943 04/15/24	SANTO ANTONIO ENERGIA (ISIN:BRSTENDBS020)		
11602	ECELUP 8 5/8 06/16/21 Corp. – REGS	ELDORADO INTL FIN GMBH ISIN USA18007AA16		
11803	AZULSA 5 7/8 10/26/24 Corp - REGS	AZUL INVESTMENTS LLP (ISIN: USU0551UAA17)		
11963	CMIGBZ 9 ¼ 12/05/24 Corp	CEMIG GERACAO E TRANSM (ISIN: USP2205LAC92)		
12125	GSHPBR 10 08/10/26	GENERAL SHOPPING INVST (ISIN USG3812TAB73)		
12427	LIGTBZ 7 ¼ 05/03/23 Corp – REGS	LIGHT SERVICOS ENERGIA (ISIN: USP62763AA81)		
12707	VOTORA 4 ¾ 06/17/24 CORP	CIA BRASILEIRA DE ALUMIN		
12647	RAILBZ 5 7/8 01/08/25 CORP – REGS	RUMO LUXEMBOURG SARL ISIN USL79090AB95		
12807	CMIGBZ 9 ¼ 12/05/24 (ISIN USP2205LAT2 8)	CEMIG GERACAO E TRANSM (ISIN USP2205LAT28)		
13007	BUENOS 10 7/8 01/26/21 REGS Corp	PROVINCIA DE BUENOS AIRE ISIN XS0584493349		
12887	BUENOS 9 1/8 03/16/24	PROVINCIA DE BUENOS AIRE (ISIN: XS1380274735)		
13510	EDNAR 9 ¾ 10/25/22 Corp	EMP DISTRIBUIDORA NORTE (ISIN: USP3710FAJ32)		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
13509	BUENOS 7 78 06/15/27 Corp	PROVINCIA DE BUENOS AIRE (ISIN: XS1433314314)		
13490	BUENOS 4 05/15/35 Corp	PROVINCIA DE BUENOS AIRE (ISIN: XS0234084738)		
13489	ARGENT 2 12 12/31/38 Corp	REPUBLIC OF ARGENTINA (ISIN: US040114GK09)		
13589	PETBRA 7 14 03/17/44 Corp	PETROBRAS GLOBAL FINANCE (ISIN: US71647NAK54)		
13610	ITAU 6 18 PERP CORP	ITAU UNIBANCO HLDG SA/KY (ISIN: USP5R6DPAA84)		
13549	VALEBZ 5 78 06/10/21 Corp	VALE OVERSEAS LIMITED (ISIN: US91911TAN37)		
13530	MENDOZ 8 38 05/19/24 Cor	PROVINCIA DE MENDOZA (ISIN: USP6480JAG24)		
13809	PDCAR 7 1/8 06/10/21 CORP	PROVINCIA DE CORDOBA ISIN USP79171AD96		
13829	KLAB 5 3/4 04/03/29 CORP	KLABIN AUSTRIA GMBH ISIN USA35155AA77		
13930	BUENOS 9 58 04/18/28 CORP	PROVINCIA DE BUENOS AIRE ISIN XS0290125391		
13931	BUENOS 6 12 02/15/23 CORP	PROVINCIA DE BUENOS AIRE ISIN XS1566193295		
13972	UNIGEL 10 1/2 01/22/24 REGS – Corp	UNIGEL LUXEMBOURG AS ISIN USL9467UAA53		
13992	JSLGBZ 7 3/4 07/26/24 REGS – CORP	JSL EUROP ISIN USL5800PAB87		
14110	USIM 5 7/8 07/18/26 REGS - CORP	USIMINAS INTERNACIONAL (ISIN: USL95806AA06)		
14351	BONSUC 9 1/4 11/03/20 REGS-CORP	BANCO BONSUCESSO (ISIN: USP07041AA72)		
14444	MVFP SO 6.748 06/01/34 REGS – CORP	MV24 CAPITAL BV (ISIN: USN53766AA41)		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
14623	BAKIDE 7.45 11/15/29 CORP	BRASKEM IDESA SAPI ISIN USP1850NAA92		
14723	BMEBMZ 9 5/8 07/16/20 REGS-CORP	BANCO MERCANT DO BRASIL – ISIN – USP1400AAA27		
14805	PETBRA 6 7/8 01/20/40 CORP	PETROBRAS GLOBAL FINANCE (ISIN:US7164WAQ42)		
14806	HIDRVS 5.95 01/24/25 CORP	HIDROVIAS INT FIN SARL -ISIN USL48008AA19		
14823	PETRA 6.9 03/19/49 CORP	PETROBRAS GLOBAL FINANCE (ISIN: US71647NBD03)		
14843	CSNABZ 6 3/4 01/28/28 REGS-CORP	CSN ISLANDS XI CORP (ISIN – USG2583XAB76)		
14846	ELEBRA 4 5/8 02/04/2030 REGS-CORP	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS (ISIN: USP22835AB13)		
14884	ITAU 4 5/8 PERP REGS- CORP	ITAU UNIBANCO HLDG SA/KY (ISIN: USP59699AB77)		
14924	PETBRA 5 3/4 02/01/29 CORP	PETROBRAS GLOBAL FINANCE (ISIN: US71647NAZ24)		
14944	ARGENT 2 1/2 12/31/38 GOVT	REPUBLIC OF ARGENTINA (ISIN: XS0501195647)		
14966	SBSPBZ 6 1/4 16/12/20 REGS CORP	CIA SANEAMENTO BASICO (ISIN: USP3058WAC12)		
14969	BVMFBZ 5 1/2 07/16/20 REGS CORP	B3 SA (ISIN: USP1728MAA10)		
15045	BEEFBZ 6 1/2 09/20/26 REGS CORP	MINERVA LUXEMBOURG SA (ISIN:USL6401PAF01)		
15104	BRFSBZ 4 7/8 01/24/30 REGS CORP	BRF – BRASIL FOODS SA (ISIN:USP1905CJX94)		
15105	AEGEBZ 5 3/4 10/10/24 REGS CORP	AEGEA FINANCE SARL (ISIN:USP01014AA03)		
15305	RDEDOR 4 1/2 01/22/30 REGS CORP	REDE D'OR FINANCE SARL (ISIN: USL7915TAA09)		
15306	BANVOR 4 3/8 07/29/25	BANCO VOTORANTIM (ISIN: XS2210789934)		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
15433	BRFSBZ 5 ¾ 09/21/50 REGS CORP	BRF SA		

## Estratégia

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
73	Estratégia	Estratégia	<p>1) Utilização de mais de um parâmetro para cálculo da atualização da curva do contrato.</p> <p>2) Apuração de um determinado parâmetro de forma distinta daquela prevista pela Cetip.</p> <p>3) Critério de apuração diferente dos estabelecidos em cadernos de fórmulas e manuais de operação da Cetip.</p> <p>Observação: A utilização desta opção somente é possível mediante a prévia e expressa autorização da Cetip, que fornecerá um código específico para cada Estratégia aprovada.</p>	<p>1) Código da Estratégia.</p> <p>2) Informações definidas como necessárias pela Cetip por ocasião da aprovação da Estratégia.</p> <p>3) Para mais informações, acesse o Fluxo de Aprovação de Estratégias, localizado no site da Cetip, <a href="http://www.cetip.com.br/">http://www.cetip.com.br/</a></p>

## Paridade de Moedas

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
344	Paridade Moedas – s/ Cross Rate	Paridade de Moedas - sem Cross Rate	<p>a) Código utilizado para o registro de curva cujo critério de apuração preveja a cotação entre duas moedas distintas do Real (R\$).</p> <p>b) A cotação deve ser utilizada exclusivamente como fator de correção cambial, contemplando a variação entre a cotação definida para a data de vencimento e a indicada para a data de início do contrato.</p> <p>c) Permitida somente a utilização <b>sem</b> cross rate para este código de Tipo_Classe.</p>	<p>1) Informar a paridade; cotação inicial da paridade indicada exclusivamente no campo “Cupom Limpo”; indicação da fonte de informação da paridade; horário da cotação da paridade; tipo de cotação da paridade (compra, venda, média); data de cotação da paridade indicada exclusivamente no campo “Data de Cotação”.</p> <p>2) Se utilizada a média de cotações:</p> <p>a) informar as datas das cotações para média aritmética; ou</p> <p>b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.</p> <p>4) Informar, quando houver, cupom de juros/spread na base 360, exclusivamente nos campos “+/-“ e “Juros (% a.a.)”;</p> <p>5) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.</p> <p>Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.</p>



Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
327	US\$ EMTA	Dólar EMTA	<p>1) A moeda deve ser utilizada exclusivamente como fator de correção cambial, contemplando a variação entre a cotação definida para o vencimento e a indicada para a data de início do contrato.</p> <p>2) Não é permitida a utilização de cross rate.</p> <p>3) O fixing padrão para liquidação será a PTAX-Venda, divulgada pelo Sisbacen. A utilização de dados divulgados pelo EMTA será considerada como fixing para liquidação sob duas condições:</p> <p>a) ausência de divulgação da cotação pelo Sisbacen; ou</p> <p>b) a divulgação da cotação pelo EMTA superar uma variação, em módulo, de 3% em relação à divulgação pelo Sisbacen.</p> <p>4) Permitida somente a utilização <b>sem</b> cross rate para este código de Tipo_Classe</p>	<p>1) Informação da Cotação inicial indicada exclusivamente no campo “Cupom Limpo”, Horário da cotação; data de cotação da paridade indicada exclusivamente no campo “Data de Cotação”.</p> <p>2) Informar, quando houver, cupom de juros/spread na base 360, exclusivamente nos campos “+/-“ e “Juros (% a.a.)”.</p> <p>3) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.</p>

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5008	Razão entre paridades	Razão entre paridades PTAX e EMTA BRL	<p>Código utilizado para o registro de curva cujo critério de apuração preveja a razão entre a paridade PTAX 800, de fechamento, opção 5 divulgada pelo Banco Central do Brasil e a paridade EMTA BRL, provida pela Trade Association for the Emerging Markets.</p> <p>Permitida somente a utilização <u>sem</u> cross rate para este código de Tipo_Classe</p>	<p>1) Informar a razão inicial entre as duas paridades; data de cotação das duas paridades (d0, d-1, d-2 ou d-3);</p> <p>2) Informar, quando houver, cupom de juros/spread, base e expressão da taxa.</p> <p>3) Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)":</p> <p>4) Indicar, se houver, a taxa adicional:</p> <p>a) posfixada: necessariamente deverá ser % da Taxa DI;</p> <p>b) pré-fixada: taxa, a sua expressão, a base e o período.</p> <p>5) Indicar a data da cotação que está sendo utilizada (D-0, D-1, D-2 ou D-3).</p>
5183	CNH-BRL	CNHBRL Spot Exchange Rate (Fx Cross Rate)	<p>1) Código utilizado para o registro de curva cujo critério de apuração preveja a cotação entre as moedas CNH e BRL, exclusivamente.</p> <p>2) A Paridade deve ser utilizada exclusivamente como fator de correção cambial, contemplando a variação entre a cotação definida para o vencimento e a indicada para a data de início do contrato.</p> <p>3) Utilização obrigatória de cross rate para este código de Tipo_Classe.</p>	<p>1) Informação da Cotação inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo", Horário da cotação; data de cotação da paridade indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação".</p> <p>2) Informar a moeda de passagem para cross rate e as respectivas cotações utilizadas. A "Data de Cotação" informada será utilizada para as duas paridades de moedas.</p> <p>3) Informar, quando houver, cupom de juros/spread na base 360, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)".</p> <p>4) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".</p>

Código	Curva VCP	Descrição d Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5630	CNY EMTA	RENMIMBI IUAN (CNY) EMTA	<p>1) Código utilizado para o registro de curva cujo critério de apuração preveja a cotação entre as moedas CNY e BRL, com ou sem cross rate.</p> <p>2) A moeda deve ser utilizada exclusivamente como fator de correção cambial, contemplando a variação entre a cotação definida para o vencimento e a indicada para a data de início do contrato.</p> <p>3) O fixing padrão para liquidação será a PTAX-Venda, divulgada pelo Sisbacen. A utilização de dados divulgados pelo EMTA será considerada como fixing para liquidação sob duas condições:</p> <p>a) ausência de divulgação da cotação pelo Sisbacen; ou</p> <p>b) a divulgação da cotação pelo EMTA superar uma variação, em módulo, de 3% em relação à divulgação pelo Sisbacen.</p> <p>4) Sem Cross Rate, a utilização de dados divulgados pelo EMTA será considerada como fixing para liquidação da paridade CNY-BRL.</p> <p>5) Com Cross Rate, a utilização de dados divulgados pelo EMTA será considerada como fixing para liquidação somente para a paridade CNY contra a “moeda de passagem” e, somente nos casos em que não houver o fixing padrão para liquidação desta paridade na fonte primária de informação. Por exemplo: CNY-USD (EMTA) e USD-BRL (Sisbacen).</p>	<p>1) Informação da Cotação inicial indicada exclusivamente no campo “Cupom Limpo”, Horário da cotação; data de cotação da paridade indicada exclusivamente no campo “Data de Cotação”.</p> <p>2) Se houver cross rate, indicar a “moeda de passagem” e as respectivas informações: Cotação inicial, Horário da cotação e Data de Cotação da paridade.</p> <p>3) Informar, quando houver, cupom de juros/spread na base 360, exclusivamente nos campos “+/-“ e “Juros (% a.a.)”.</p> <p>4) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.</p> <p>Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.</p>

**Observação referente à utilização da cotação EMTA nas curvas VCP 327, 343, 5008 e 5630:**

- 1) Não estão contempladas neste VCP cláusulas de diferimento de pagamentos da liquidação financeira de eventos e;
- 2) No caso do contrato apresentar condições diferentes das estabelecidas para este VCP, inclusive com relação ao percentual de materialidade, as mesmas devem ser submetidas à apreciação prévia por parte da Cetip.

## Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
<b>2455</b>	CFF 1204310F63	FIP MZO LOGÍSTICA I - CNPJ 12.993.435/000 1-63	1) Os indicadores devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação cumulada do PU/Cota do ativo entre a data de início do contrato e o vencimento.	1) Sobre a cota, informar: a) Valor de referência, exclusivamente no campo "Cupom Limpo"; b) Fonte de Informação no campo "Denominação"; c) Tipo de cota (abertura, fechamento e média) no campo "Denominação"; d) Fixing para captura do valor da cota (indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação").
<b>5135</b>	FX FIM CP - INVESTIMEN TO NO EXTERIOR (CNPJ: 07.096.479/00 01-50)	FX FIM CP - INVESTIMENT O NO EXTERIOR (CNPJ: 07.096.479/000 1-50)	2) Somente será permitida a utilização de ativo cujo PU/Cota tenha divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.	2) Sobre o juros/cupom/spread, Informar (quando houver): a) cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)"; b) base (252, 360, etc) no campo "Denominação".
<b>10010</b>	DOMC11 BZ EQUITY	DOMO FII (CNPJ 17.374.696/000 1-19)		3) Se utilizada a média de cotações: a) informar as datas das cotações para média aritmética simples no campo "Denominação"; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada no campo "Denominação".
<b>10011</b>	BTGPALP BZ EQUITY	BTG ALPHA MASTER FIC DE FIA (CNPJ 16.565.058/000 1-12)		4) Sobre Limitadores: a) É permitido utilizar somente um (1) limitador no contrato (Inferior ou Superior), sendo aplicado em apenas uma das curvas; b) O limitador deve ser indicado na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
<b>10030</b>	LSTGLB BZ Equity	LESTE GLOBAL FIC FIM – INV NO EXT (CNPJ 21.006.934/000 1-00)		5) Exclusivamente para o Fundo de Investimento Imobiliários negociados em Bolsa:
<b>10031</b>	BTG ALPHA MASTER FIC DE FIA (CNPJ 16.565.058/00 01-12)	KAPITALO KAPPA FIN FIQ DE FIM (CNPJ 12.105.940/000 1-24)		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
<b>10897</b>	CARE11 BZ Equity	Brazilian Graveyard Death Care - FII E1 S1 (CNPJ: 13.584.584/000 1-31)		a) Caso a curva reflita apenas os rendimentos pagos pelo fundo (desconsiderando a variação do preço da cota), informar "troca somente de rendimentos";  i. Nesse caso, deverá ser informado no campo "Cupom Limpo" o valor de referência do rendimento (e não o valor da cota);  ii. O valor de referência da cota deverá ser informado no campo "Denominação".
<b>11221</b>	FIDIC ANGA SABEMI CO VI SN 1(2409916SE N)	FIDIC ANGA SABEMI CO VI SN 1 CNPJ 25248974/0001 -10		
<b>11382</b>	FIDC ESMERALDA SUB1 (CETIP 2473417SJR)	FIDC ESMERALDA SUB 1 CNPJ 24.426.716/000 113		
<b>10941</b>	BRAZIL REALTY FII	BRAZIL REALTY FII (CNPJ: 14.074.706/000 1-02)		
<b>12064</b>	MAUÁ CAPITAL P FIM CP IE	MAUÁ CAPITAL P FIM CP IE 236489330001 95		
<b>13370</b>	AQLL11 (CNPJ 13.555.918/0 001-49)	AQUILLA FII EMISSÃO 1 (CNPJ: 13.555.918/00 01-49)		
<b>13369</b>	ARFI11B (CNPJ 14.069.202/0 001-02)	AQ3 RENDA FII EMISSÃO 1 (CNPJ: 14.069.202/00 01-02)		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
<b>13389</b>	FISD11 (CNPJ 16.543.270/0 001-89)	SÃO DOMINGOS FII (CNPJ 16.543.270/00 01-89)		
<b>14985</b>	BRCR11 (CNPJ 08.924.783/0 001-0)	FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND (CNPJ 08.924.783/00 01-0)		
<b>15084</b>	F2036CP BZ Equity	Canvas Vector S FIC FIM (CNPJ: 28.951.182/00 01-03)		

## Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
6441	FRTIEEQ:LX	Nordea 1 SICAV - European Value Fund (ISIN LU0064319337)		1) Informação da cota e seu respectivo valor inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo"; 2) Indicar a fonte de informação; informar o tipo da cota (se houver); Data de referência do valor da cota, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação"; e quando for o caso, Câmbio para conversão.
6442	NBUSU1A:ID	Neuberger Berman US Multi Cap Opportunities Fund (ISIN IE00B775SV38)	Os indicadores devem ser utilizados somente como fator de	a) Caso a divulgação da cota seja mensal, informar exclusivamente no campo "Denominação" o mês de referência para fixing no formato M-1 ou M-2.
6621	SCSGUSA:ID	Sands Capital Fund PLC - US Select Growth Fund (IE00B7YJCM77)	correção, contemplando a variação	b) Caso a divulgação da cota seja semanal, informar exclusivamente no campo "Denominação" a semana de referência para fixing no formato S-1 ou S-2.
6622	BBHCOSI:LX	BBH Luxemburg Funds - US Select Growth Fund (LU0407242659)	cumulada do PU/Cota do ativo entre a data de início do contrato e o	3) Informar, quando houver, cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)"
6741	MIGOEUH LX EQUITY	BlackRock Global Funds - Continental European Flexible Fund (LU0406496546)	vencimento.	a) Na base 360; b) Na base 252; 4) Se utilizada a média de cotações: a) informar as datas das cotações para média aritmética simples no campo "Denominação"; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada no campo "Denominação".
6881	POCFJIU ID EQUITY	Polar Capital Funds PLC - Japan Fund (IE00B3FH9T88)		c) informar, se houver, limitadores inferior e/ou superior do preço composto pela média das cotações, podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial no campo "Denominação".
7301	WAGTX US Equity	Wasatch World Innovators Fund ISIN US9367933069		5) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.
7362	SIEEXCE LX EQUITY	SISF EUROPEAN EQUITY EX UK C EUR DIS LU0995124400		Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
7604	BTGINTG KY EQUITY	BTG Pact International PTF CL G		6) Caso o contrato seja "Quanto", especificar no campo "Denominação" a ausência da variação cambial.
8446	INAPACI LX Equity	INVESTEC GSF-ASIA PACIFIC-I		7) É permitido utilizar participações de alta e de baixa (em percentual) sobre as curvas.
8448	PSH NA Equity	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD (ISIN GG00BPFJTF46)		
8547	TERRA13 MM Equity	TERRAFINA (ISIN MXCFTE0B0005)		
8866	BTGINTH KY Equity	BTG Pact International PTF CL H		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
10380	AAA NA EQUITY	AP ALTERNATIVE ASSETS LP (ISIN GB00B15Y0C52)		a) Na hipótese de cada curva ter apenas uma participação, esta deve ser informada exclusivamente no campo "Percentual" em "Curvas para Atualização".
10581	ETW US EQUITY	EATON VANCE TAX MAN GLBL BR (FIGI: BBG000BQJOY1)		b) Caso houver participações de alta e de baixa diferentes sobre as curvas, estas devem ser informadas (em percentual) no campo "Denominação", e o campo "Percentual" em "Curvas para Atualização" deve ser preenchido como "100".
10582	ETB US EQUITY	EATON VANCE T/M BUY – WR IN (ISIN:US27828X1000)		
10697	PCI US Equity	PIMCO DYNAMIC CREDIT AND M.I.FUND ISIN US722202D1063		
10698	DSL US Equity	DOUBLELINE INCOME SOLUTIONS (ISIN:US2586221093)		
10757	CIF US Equity	MFS INTERMEDIATE HIGH INCOME FUND (ISIN:US59318T1097)		
10755	EAD US Equity	WELLS FARGO INCOME OPPORTUNITIES (ISIN:US94987B1052)		
10754	VGI US Equity	VIRTUS GLOBAL MULTI-SECTOR (ISIN:US92829B1017)		
10901	RA US Equity	BROOKFIELD REAL ASSETS INCOME FUNDS INC (ISIN: US1128301041)		
11161	BTGINTB KY Equity	BTG PACTUAL INTERNATIONAL PORT FUND – CL B		
11744	FUNO11 MM Equity	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA ISIN MXCFFU 000001		
11743	PINEEHA ID Equity	PIMCO GIS-INCOME FUND-EEHA ISIN IE00B84J9L26		
11985	FIHO12 MM Equity	CONCENTRADORA FIBRA HOTELERA		
12247	HEJSA2J LX Equity	JAN HND HRZN JAP SM CM-A2JPY		



Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou Fator	Informações Necessárias
12610	SCHGCAH LX Equity	SISF-GLBL CONV BOND-AEUR AH		
12609	OMEAEHA ID Equity	OLD MUT GB EQY ABS RE-AEURHD		
12608	NORMABP LX Equity	NORDEA 1 ALPHA 10 MA-BPE		
12607	MGOIAEA LN Equity	M&G OPTIMAL INCOME-A-EURO-A		
12588	GAMSCOE ID Equity	GAM STAR CREDIT OPP-EUR ACC		
12587	BKRSPEA LX Equity	BLACKROCK STR-EUR O EX-A2		
12638	CSGRBHE LX Equity	CS GLOBAL ROBO EQ FD-BH EUR		
12637	JPGIAEA LX Equity	JPM INV/GLB INCOME-A EUR ACC		
12636	JPMECAA LX Equity	JPM INV-JPM GLBL MAC OPP-A		
12635	JUPLEUR LX Equity	JUPITER JGF DY B FD-LEUR		
12634	LEODEUB LX Equity	DNCA INVEST – EUROSE-B		
12633	MERGAAA LX Equity	BGF-GLBL ALLOC-A2 EUR		
12632	NIMEHYB LX Equity	NORDEA 1 EUR HGH YLD-BI-EUR		
12631	NOCEBPE LX Equity	NORDEA 1 SIC-GCL&ENV-BP-EUR		
12630	PFSECPC LX Equity	PICTET-SECURITY-PE		
12629	SCIEHYA LX Equity	SCHRODER ISF EURO HIGH YD-A		
12628	WAMOAEH ID Equity	LM-WA MACRO OPPORT BD-AAHEUR		
12627	XCRER1C LX Equity	DB PLATINUM IV-CROCI EUR-R1C		
12727	MSGBRCA LX Equity	MSIM GLOB BAL RISK C FF-A		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
12867	NH2ADRC FP Equity	H2O ADAGIO-RC		
12847	ABMGA2A LX Equity	ABERDEEN DVRSFD GROWTH-AAEUR		
12969	MSUEGAH LX Equity	MORGAN ST-US GROWTH FD-AH		
12968	ALSFFCT LX Equity	ALLIANZ STRATEGY 50-CT EUR		
12967	MSGOPAH LX Equity	MSIF GLOBAL OPPORTUNITY-A		
13027	DIICELC LX Equity	DEUTSCHE INV I- CROCI EURO-LC		
13290	GSGLC EE LX Equity	GS GLB CORE E ESN		
13789	EURBARR LX Equity	EURIZON BOND AGGREGATE RMB-R ISIN LU1529955046		
13971	PGIP SVA ID Equity	Principal Preferred Securities (ISIN:IE00B00Z9M92)		
13970	MORAMAH LX Equity	MS-US Advantage (ISIN:LU0266117927)		
14272	MGOIEAA LX Equity	M&G (Lux) Optimal Income Fund (ISIN:LU1670724373)		
15409	BTGPGRD KY Equity	BTG PACTUAL GLOBAL RATES FUND		
15410	BTGPGA1 KY Equity	BTG PACTUAL GLOBAL RATES FUND		
15411	BTGPA1A KY Equity	BTG PACTUAL GLOBAL RATES FUND		
15412	BTGPGRA KY Equity	BTG PACTUAL GLOBAL RATES FUND		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou Fator	Informações Necessárias
15448	MATRDHC ID Equity	MAN AHL TARGETRISK (ISIN:IE00BRJT7720)		
15496	GMATDEA ID Equity	MAN AHL TARGETRISK-DEUR (ISIN:IE00BRTJ7613)		
15409	BTGPGRF KY Equity	BTG PACTUAL GLOBAL RATES MASTER		

## Commodity

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5125	Alumínio			<b>1) Informação da commodity</b> utilizada, <b>Ativo-Base, Código Ativo-Base/vencimento, Quantidade da commodity</b> (Descrição opcional somente quando não houver previsão de spread) e sua <b>cotação inicial</b> , na moeda em que a commodity é negociada na referida bolsa.
5133	SLVRLN INDEX	LONDON SILVER MARKET FIXING LTD - LBMA		2) Tipos de Variação de preço: a) No caso de variação Quanto, informar “ausência de variação cambial” ou “variação quanto” no campo “Denominação”. b) Se a variação de preços for em reais, informar “variação em reais” no campo “Denominação”.
5134	GOLDLNP INDEX	LONDON GOLD MARKET FIXING LTD - LBMA	Os indicadores devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação cumulada do PU/Cota do ativo entre a data de início do contrato e o vencimento.	c) Caso não seja informado nenhuma das situações acima, será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que a commodity é cotada, com variação cambial no campo “Denominação”.
5143	COTTON NO.2 FUTR	COTTON NO.2 FUTR (NYB-ICE Futures)		<b>3) Indicação da fonte de informação, Bolsa de negociação e Fonte da Cotação, Horário da Cotação, Tipo de Cotação</b> (Compra, Venda, Média, Preço de Ajuste, Asiática) <b>Data de cotação e Fonte Câmbio para conversão</b> da commodity.
5144	LOCADY LME COMDTY - COPPER	LOCADY LME COMDTY		<b>4) Indicação da Data da Cotação e Cupom Limpo</b> para câmbio de conversão observam-se as seguintes formas de indicação: a) Quando houver cotação inicial do câmbio de conversão, indicar exclusivamente no campo “Cupom Limpo” com, no mínimo, 4 casas decimais; b) Indicar exclusivamente no campo “Data de Cotação”, quando a data de fixing entre as moedas for a mesma; ou c) Nas situações em que a cotação inicial do câmbio de conversão for diferente da cotação de vencimento, conforme exemplo: Data de cotação inicial do câmbio de conversão é (D-1) e a data de cotação do vencimento do câmbio de conversão é (D-2).
5148	LONIDY LME COMDTY - NICKEL	LONIDY LME COMDTY		Deverá ser informado obrigatoriamente no campo “Data de Cotação” a cotação que será utilizada no vencimento. Já a informação da cotação inicial do câmbio de conversão deverá ser informada no campo “Descrição”; e
5149	PLAT COMDTY - PLATINUM	PLAT COMDTY - PLATINUM SPOT - LPPM		
5150	SOYBEAN FUTURE - CBOT	S COMDTY - SOYBEAN FUTURE - CBT		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5151	LMZSDS03 LME COMDTY - ZINC	LMZSDS03 LME COMDTY		<b>5) Se utilizada a média de cotações:</b>  a) informar as datas das cotações para média aritmética; ou  b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada; e  c) informar, quando houver, spread, no formato de preço ou taxa (indicar também se o spread é positivo "+" ou negativo "-") nos preços de fechamento/ajuste nas respectivas datas de verificação.
5157	PLDMLNPM INDEX - PALLADIUM	PALLADIUM		<b>6) Informar, quando houver, cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)":</b>  a) Informar a base de cálculo da taxa (252, 360 ou 365); e  b) Informar a metodologia de cálculo (exponencial ou linear)  c) Caso o spread seja em valor, informar exclusivamente no campo "Denominação". Indicar também o sinal "+" ou "-".
5171	WTI CRUDE FUTURE - NYMEX	WTI CRUDE FUTURE		<b>7) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.</b>  Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
5172	CORN FUTURE - CBOT	CORN FUTURE		
5186	SB COMDTY - SUGAR No.11 – NYB ICE Fut	SUGAR No.11		
5187	LOSNDY LME COMDTY – TIN	TIN = ESTANHO		
5188	RR COMB COMDTY – ROUGH RICE – CBOT	ROUGH RICE = ARROZ		
5189	KC COMDTY – COFFEE "C" FUT – NYB ICE Fut	COFFEE "C" = CAFÉ		
6981	LMCADY LME Comdty	LMCADY LME Comdty - Copper		
7221	GCFPAMTP Index	Ammonia CFR Tampa		
8947	OTC Iron Ore Swap (SGX Asiaclear)	SWAP OTC DE MINERIO DE FERRO SGX ASIACLEAR		
11181	Iron Ore Futures (SGX Asiaclear)	Futuro de minério de ferro SGX Asiaclear		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
<b>11502</b>	FUTURO DE CARVÃO	FUTURO DE CARVÃO		
<b>11522</b>	FUTURO DE JET FUEL	FUTURO DE JET FUEL		
<b>11984</b>	LOAHDY LME Comdty	LOAHDY LME Comdty - Aluminum		
<b>11964</b>	FUTURO DE PRATA	SILVER FUTURES		

## Títulos Públicos Nacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5191	LTN	Letra do Tesouro Nacional	1) Os indicadores devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada do PU do ativo entre a data de início do contrato e o vencimento.	1) Informação do ativo e seu PU inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo". 2) Informar, quando houver, o vencimento do título público.
5192	NTN-F	Nota do Tesouro Nacional - Série F	2) Somente será permitida a utilização de ativo cujo PU tenha divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.	3) Indicação da fonte de informação, e quando for o caso, Horário da Cotação, Data de cotação, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação".
5193	NTN-B	Nota do Tesouro Nacional - Série B		4) Informar, quando houver, cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)", informando também a base (360 ou 252).
5194	LFT	Letra Financeira do Tesouro		5) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. 6) Indicar no campo Denominação a subsérie do título público, quando houver.
11483	NTN – A	Notas do Tesouro Nacional – Série A		7) Informar o código ISIN  Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".

### Observações Gerais:

- 1) As Informações necessárias que não estão discriminadas com preenchimento exclusivo nos campos específicos do registro do contrato deverão ser informadas, conforme determinadas acima, no campo Denominação;
- 2) Nas tabelas acima, quando o termo **Vencimento** for mencionado nos campos Critério de Cálculo de PU ou de Fator, está se referindo a:
  - a) **Pagamento Final** – vencimento do contrato; e
  - b) **Fluxo de Caixa** – evento de juros/amortização.
- 3) No caso de contrato no qual o juros incide sobre o valor base remanescente, originado de um evento de amortização que não gera financeiro, as duas curvas deverão ser registradas como VCP e essa informação constar no campo "Denominação" junto as demais características específicas de cada curva.
- 4) Para os contratos registrados com VCP dos grupos "Ativos" ou "Ações", será considerado pela Cetip, por ocasião de antecipação, que a quantidade antecipada é dada pela resultante da divisão do valor base antecipado pelo valor inicial do ativo subjacente em Reais.

## Bloqueio e Desbloqueio VCP

### Visão Geral

Permite consultar os participantes, do seu serviço de digitação, que sofreram a ação de Bloqueio e Desbloqueio de registro de contratos de Swap com curva VCP.

#### Tela Filtro

**Consulta Bloqueio/Desbloqueio VCP**

Nome Simplificado

Conta

Código IF

Data do Evento  -

#### Tela Consulta Desbloqueio VCP

**Consulta Bloqueio/Desbloqueio VCP**

Página 1 de 120 ( Linhas 1 a 25 de 2976 )  
 Data e Hora da Consulta: 18/11/2014 - 16:25:41

 **Critério de pesquisa**

Nome Simplificado	Conta	Tipo IF	Motivo	Código IF	Data do Bloqueio	Data do Desbloqueio
RIOBM	05000.00-5	SWAP	AUSÊNCIA DE PU	10K00006307	31/12/2010	02/04/2014
RIOBM	05000.00-5	SWAP	AUSÊNCIA DE PU	10K00006307	31/12/2010	02/04/2014
RIOBM	05000.00-5	SWAP	AUSÊNCIA DE PU	10K00006307	31/01/2011	02/04/2014



## **Informações Adicionais**

---

---

## Código dos contratos

### Sobre a codificação do contrato de Swap

O código do contrato é gerado após o lançamento de uma das partes, conforme formato a seguir:

**Formato - 00A11111111**

---

**Onde:**

00 - são os dois últimos dígitos do ano de registro; e

A - significa o mês do registro, conforme a lista abaixo:

- A - Janeiro;
- B - Fevereiro;
- C - Março;
- D - Abril;
- E - Maio;
- F - Junho;
- G - Julho;
- H - Agosto;
- I - Setembro;
- J - Outubro;
- K - Novembro; e
- L - Dezembro.

11111111 – sequência numérica criada pelo sistema.

---

## Prazos para Alteração

Os contratos podem ser alterados a partir de D+1 útil do registro e até em D+3 útil do registro, inclusive, observado que tal retificação somente possa ser efetuada até a véspera do vencimento. Não é permitida mais de uma alteração no mesmo dia.

Agente Mercado = Participantes detentores de conta própria.

Agente alteração	Tipo da Operação	D0	D1	D2	D3	Dn
Mercado	Mercado x Mercado	Não	Não	Não	Não	Não
	Cliente 2 (A) x Cliente 2 (B)	Não	Não	Não	Não	Não
	Mercado x Cliente 1 ou 2 (Próprio)	Não	Possível	Possível	Possível	Não
	Mercado x Cliente 2 de outros	Não	Não	Não	Não	Não

---

## Contratos com Funcionalidades

### ➤ **Swap com opção de arrependimento**

Participante titular paga prêmio na data de registro para ter direito de, poder exercer a opção de arrependimento sobre o contrato, o que o rescindir sem apuração de resultado financeiro deste. Para contratos com esta funcionalidade, na data de vencimento, exclusivamente, o sistema realiza o exercício automático da Opção de Arrependimento caso o ajuste do Swap seja negativo para o titular da Opção de Arrependimento. O Exercício da Opção de Arrependimento antes da data de vencimento deve ser realizado mediante comando das partes do contrato na função “Exercício de Opção”.

### **Swaption a Termo**

Participante titular paga prêmio 1 na data de registro para entrar em uma opção cujo ativo objeto é um contrato de Swap com início a partir de uma data futura. Nesta, se pretender entrar no Swap, deve exercer a opção, pagando o prêmio 2.

### ➤ **Compound Swaption**

Participante titular paga prêmio 1 na data de registro para entrar em uma opção que lhe dê o direito de permanecer no contrato de Swap com início a partir da própria data de registro.

Na data de exercício, pré-determinada no registro, se pretender permanecer no Swap, deve exercer a opção, pagando o prêmio 2.

### ➤ **Knock In**

Contrato somente produz direitos e obrigações a partir de um determinado patamar de variação da curva ou do parâmetro que a compõe, informados como trigger (gatilho).

### ➤ **Knock Out**

Contrato somente deixa de produzir direitos e obrigações a partir de um determinado patamar de variação da curva ou do parâmetro que a compõe, informados como trigger (gatilho).

### ➤ **Knock In-Out**

Combinação do uso de **Knock In** e **Knock Out**, nesta ordem.

### ➤ **Swap com Knock In e com Opção de Arrependimento**

Contrato em que uma das partes, mediante o pagamento de prêmio à outra parte:

Estabelece em que condição (ões) (trigger) o contrato produzirá efeitos; e

Adquire o direito de, ocorrendo o trigger, rescindir o Swap a qualquer tempo, inclusive na data de vencimento.

### ➤ **Swap com Knock Out com Opção de Arrependimento**

Contrato em que uma das partes, mediante o pagamento de prêmio à outra parte:

Estabelece em que condição (ões) (trigger) o contrato será rescindido; e

Adquire o direito de, caso o trigger não ocorra, rescindir o Swap a qualquer tempo, inclusive na data de vencimento.

### ➤ **Swap com Knock In, Knock Out ou Knock In-Out Forma de Verificação de Disparo Discreto**

**Diária** - Verifica diariamente se o trigger foi disparado (DI, Selic, TJLP, Ouro, Dólar, Dólar Comercial Exponencial, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, EURO WMR, Iene, Franco Suíço, Franco Suíço BCE, Franco Suíço WMR, Peso Mexicano e Ibovespa de Liquidação).

Regra de Disparo do Trigger:

Se, taxa ou Valor de fechamento em D-1  $\leq$  Trigger  $\leq$  D0  $\rightarrow$  Dispara Trigger na Alta.

Se, taxa ou Valor de fechamento em D-1  $\geq$  Trigger  $\geq$  D0  $\rightarrow$  Dispara Trigger na Baixa.

**Final** - Verifica apenas na data do vencimento do contrato, se o trigger foi disparado (DI, Selic, TJLP, Ouro, Dólar, Dólar Comercial Exponencial, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, EURO WMR, Iene, Franco Suíço, Franco Suíço BCE, Franco Suíço WMR e Peso Mexicano, Ibovespa de Liquidação, IGP-M, IGP-DI, INPC e TR).

Regra de Disparo do Trigger:

Se 1,00000000  $\leq$  Fator Trigger  $\leq$  Fator Resultante da Curva  $\rightarrow$  Dispara Trigger na Alta.

Se 1,00000000  $\geq$  Fator Trigger  $\geq$  Fator Resultante da Curva  $\rightarrow$  Dispara Trigger na Baixa.

➤ **Swap com Knock In, Knock Out ou Knock In-Out - Forma de Verificação de Disparo Contínuo (Ibovespa de Liquidação Contínuo)**

Exclusivo quando a curva utilizada para trigger for "IBOVESPA Liquidação Contínuo".

A verificação do viés do trigger determinará qual cotação do Ibovespa será utilizada para o disparo do trigger:

Se for trigger de Baixa - cotação utilizada para disparo será o Ibovespa Mínimo;

Se for trigger de Alta - cotação utilizada para disparo será o Ibovespa Máximo.

Contrato somente deixa de produzir direitos e obrigações a partir de um determinado patamar de variação da curva ou do parâmetro que a compõe, informados como trigger (gatilho).

**Diária** - Verifica diariamente se o trigger foi disparado.

Regra de Disparo do Trigger:

Se Valor máximo em (D-1, D-2 ou D-3)  $\leq$  Trigger  $\leq$  D0  $\rightarrow$  Dispara Trigger na Alta.

Se Valor mínimo em (D-1, D-2 ou D-3)  $\geq$  Trigger  $\geq$  D0  $\rightarrow$  Dispara Trigger na Baixa.

**Final** - Verifica apenas na data do vencimento do contrato, se o trigger foi disparado

Regra de Disparo do Trigger:

Se 1,00000000  $\leq$  Fator Trigger  $\leq$  Fator Resultante da Curva  $\rightarrow$  Dispara Trigger na Alta.

Se 1,00000000  $\geq$  Fator Trigger  $\geq$  Fator Resultante da Curva  $\rightarrow$  Dispara Trigger na Baixa.

➤ **Swap com Limitador de Alta ou de Baixa**

Contrato em que as partes estabelecem patamar máximo e/ou mínimo para uma ou ambas as curvas.

➤ **Swap com Limitador por Terceira Curva**

Contrato em que as partes estabelecem uma terceira curva como patamar máximo ou mínimo para uma das curvas.

➤ **Swap com Prêmio**

Contrato que estabelece que uma das partes efetue o pagamento de prêmio na data de registro.

**Observações:** EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)

EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)

EURO-WMR = Paridade USD/EUR (WMR) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)

FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]

FRANCO SUÍÇO WMR = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (WMR) / Paridade USD/EUR (WMR)]

### Pagamento de Rebate

#### Pagamento de Rebate

**Knock In** No vencimento do contrato de Swap.

Independente da forma de verificação do trigger.

**Knock Out** Três possibilidades:

1 - Na data de disparo do trigger de Knock Out;

2 - No vencimento original do contrato; e

3 - Em **n** dias úteis após o disparo, limitado à data de vencimento.  
Independente da forma de verificação do trigger.

Knock In-Out	Knock In	Knock Out	Data do Rebate
	Verificação dos Triggers	Verificação dos Triggers	Na data do Knock Out; No vencimento;
	Diária	Diária	Em <b>n</b> dias úteis após Knock Out, limitado à data de vencimento.
	Diária	Final	No vencimento.
	Final	Final	No vencimento.

**Observação:** O Pagamento de Rebate é realizado na modalidade de Liquidação Bilateral.

### Registro de Funcionalidades Documentacional

As funcionalidades **Knock In**, **Knock Out**, **Knock In com Opção**, **Knock Out com Opção**, **Limitador por fator arbitrado (inferior ou superior)**, quando utilizadas com **indexador VCP** é de **registro documentacional**, ou seja, não há verificação de disparo do trigger ou de utilização dos limitadores, exceto para a funcionalidade **Knock Out com Arrependimento**, onde o Participante pode exercer a opção de arrependimento de acordo com a regra já estabelecida no Módulo de Swap.

O Registro Documentacional das funcionalidades **Knock In**, **Knock Out**, **Knock In com Opção**, **Knock Out com Opção**, **Limitador por Fator Arbitrado (inferior ou superior)**, esta disponível para uso em todos os VCPs.





## Cruzamento de Funcionalidades x Operações

Operações e Funcionalidades	Knock In com/ sem opção	Knock Out com/sem opção	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio	Opção de Arrependimento
Registro em D com início em D-1 ou D-2	P	P	P	I	P	P	P
Antecipação	P	P	P	P	P	P	P
Antecipação entre clientes (em D-1).	P	P	P	P	P	P	P
Intermediação de Contrato	P	P	P	P	P	P	P
Opção de Arrependimento	I	I	I	I	I	I	N.A
Limite Fator Arbitrado	P	P	P	P	P	P	P
Limite 3ª Curva	P	P	P	P	P	P	P
Cessão de Contratos	P	P	P	P	P	P	P
Operação a Termo	I	I	I	P	I	P	P
Operação a Termo com Valor Base Corrigido	I	I	I	P	I	P	P
Início em dia não útil	I	I	I	I	I	I	I
Término em dia não útil	P	P	P	P	P	P	P
TR escolhida	P	P	P	P	P	P	P
Rebate de Prêmio	I	P	P	I	I	I	I
Knock In	N.A	I	I	I	I	I	P
Knock Out	P	N.A	I	I	I	I	P
Swaption a Termo	I	I	I	N.A	I	I	I
Compound Swaption	I	I	I	I	N.A	I	I
Swap com prêmio	I	I	I	I	I	N.A	I
Cupom Limpo	P	P	P	P	P	P	P

Legenda: P = Possível; I = Impossível e N.A. = Não se aplica.

## Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 1

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Agenda de Prêmios	Reset	Limitador Fator	Limitador Terceira Curva	Termo
Agenda de Prêmios	N.A	S	S	S	S
Reset	S	N.A	N	N	S
Limitador Fator	S	N	N.A	N	S
Limitador Terceira Curva	S	N	N	N.A	S
Termo	S	S	S	S	N.A
DI	S	S	S	S	S
DI 360d	S	N	S	S*****	S
SELIC	S	N	S	S	S
PREFIXADO 252	S	S	N	S*****	S
PREFIXADO 360	S	S	N	N*****	S
DOLAR	S	S	S	S	S
DOLAR COMERCIAL EXPONENCIAL	S	N	S	S	S
EURO/COM.EUROPEIA	S	N	S	S	S
EURO-BCE	S	N	S	S*****	S
IENE	S	N	S	S	S
FRANCO SUIÇO	S	S	S	S	S
PESO MEXICANO	S	S	S	S	S
TR	S	N	S	S	S
TJLP	S	N	S	S	S
LIBOR	S	S	S**	S*****	S
TJMI	S	S	S**	S*****	S
IGPM	S	N	S	S	S
IGPDI	S	N	S	S	S
INPC	S	N	S	S	S
OURO	S	S	S	S	S
IBOVESPA Liquidação	S	N	S	S*****	S
IBOVESPA Liquidação Contínuo	S	N	N	N	N
VCP	S	S	S***	S*****	S

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Agenda de Prêmios	Reset	Limitador Fator	Limitador Terceira Curva	Termo
COMMODITY	S	N	S	S	S

**Legenda:** S = Sim; N = Não e N.A = Não se aplica.

\* exceto no caso de variação cambial Outros

\*\* somente o específico da curva

\*\*\* funcionamento do limitador fator documental

\*\*\*\* exceto nos contratos que envolvam contas de cliente 1

\*\*\*\*\* Nos casos de contratos com funcionalidade Terceira Curva há possibilidade de utilização desta curva somente como indexador do contrato.

#### Observações:

- EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)
- EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)
- EURO-WMR = Paridade USD/EUR (WMR) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)
- FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
- FRANCO SUÍÇO WMR = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (WMR) / Paridade USD/EUR (WMR)]

## Contratos com limitador

Os contratos de swap permitem utilização de limitador superior e/ou inferior, dependendo do tipo de swap (pagamento final, fluxo constante ou não constante) e do indexador, conforme detalhado na tabela abaixo:

<b>Categoria do indexador</b>	<b>Pagamento final</b>	<b>Fluxo Constante</b>	<b>Fluxo não Constante</b>
Commodities	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>ou</b> Superior
Índices	Inferior <b>ou</b> Superior	N/A	N/A
Índices de Preços	Inferior <b>ou</b> Superior	N/A	N/A
Juros			
<i>DI</i>	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>e/ou</b> Superior <sup>1</sup>
<i>DI 360D</i>	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>e/ou</b> Superior <sup>1</sup>
<i>Prefixado 252D</i>	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>e/ou</b> Superior <sup>1</sup>
<i>Prefixado 360D</i>	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>e/ou</b> Superior <sup>1</sup>
<i>SELIC</i>	Inferior <b>ou</b> Superior	N/A	N/A
<i>TJLP</i>	Inferior <b>ou</b> Superior	N/A	N/A
<i>TR</i>	Inferior <b>ou</b> Superior	N/A	N/A
Juros Internacionais	Inferior <b>e/ou</b> Superior	Inferior <b>e/ou</b> Superior <sup>2</sup>	Inferior <b>e/ou</b> Superior <sup>1</sup>
Taxas de Câmbio	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>ou</b> Superior <sup>2</sup>	Inferior <b>ou</b> Superior <sup>2</sup>
VCP	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>ou</b> Superior	Inferior <b>ou</b> Superior

<sup>1</sup> Permitido informar limitadores diferentes por fluxo.

<sup>2</sup> Os limitadores devem ser iguais para todos os fluxos.

## Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Opção de Arrependimento	Knock In e/ou Knock Out	Knock In com Opção ou Knock Out com Opção	Swap com Prêmio	Swaption a Termo	Compound Swaption
Agenda de Prêmios	S	S	S	S	S	S
Reset	N	N	N	N	N	N
Limitador Fator	S	S	S	S	S	S
Limitador Terceira Curva	S	S	S	S	S	S
Termo	S	N	N	S	S	N
DI	S	S	S	S	S	S
DI 360d	S	N	N	S	S	S
SELIC	S	S	S	S	S	S
PREFIXADO 252	S	N	N	S	S	S
PREFIXADO 360	S	N	N	S	S	S
DOLAR	S	S	S	S	S	S
DOLAR COMERCIAL EXPONENCIAL	S	S	S	S	S	S
EURO/COM.EUROPEIA	S	S	S	S	S	S
EURO-BCE	S	S	S	S	S	S
IENE	S	S	S	S	S	S
FRANCO SUIÇO	S	S	S	S	S	S
PESO MEXICANO	S	S	S	S	S	S
TR	S	S	S	S	S	S
TJLP	S	S	S	S	S	S
LIBOR	N	N	N	S	N	N
TJMI	N	N	N	S	N	N
IGPM	S	S	S	S	S	S
IGPDI	S	S	S	S	S	S
INPC	S	S	S	S	S	S
OURO	S	S	S	S	S	S
IBOVESPA	S	S	S	S	S	S
Liquidação	S	S	S	S	S	S

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Opção de Arrependimento	Knock In e/ou Knock Out	Knock In com Opção ou Knock Out com Opção	Swap com Prêmio	Swaption a Termo	Compound Swaption
<b>IBOVESPA</b>						
Liquidação Contínuo	<b>N</b>	<b>S</b>	<b>S</b>	<b>N</b>	<b>N</b>	<b>N</b>
<b>VCP</b>	<b>S</b>	<b>N*</b>	<b>N*</b>	<b>S</b>	<b>S</b>	<b>S</b>
<b>COMMODITY</b>	<b>S</b>	<b>S</b>	<b>S</b>	<b>S</b>	<b>S</b>	<b>S</b>

**Legenda: S = Sim e N = Não**

\* exceto no caso de Registro de Funcionalidades Documentacional

**Observações:**

- EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)
- EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)
- EURO-WMR = Paridade USD/EUR (WMR) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)
- FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
- FRANCO SUÍÇO WMR = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (WMR) / Paridade USD/EUR (WMR)]

## Cancelamento referente aos prêmios e comissões

### Cancelamento de contrato e a situação dos prêmios e comissões

Pagamento da COMISSÃO de intermediação de contrato na **DATA DE REGISTRO**.

Quando o cancelamento do contrato coincidir com a data de registro, seja à vista ou a termo:

- **Se o registro de contrato é entre clientes ou entre Participante e cliente próprio:** O sistema cancela automaticamente a comissão de intermediação.
- **Se o registro de contrato é do Participante:** O estorno da comissão de intermediação é obrigatório, se ainda não liquidada financeiramente.

Quando o cancelamento do contrato é posterior a data de registro, seja à vista ou a termo, e registro de contrato que envolva clientes, não há cancelamento da comissão de intermediação.

Pagamento do PRÊMIO da **OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO**.

Quando o cancelamento ocorrer:

- Na data de registro, o sistema estorna automaticamente o prêmio da opção de arrependimento, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.
  - Em data posterior à data de registro, o prêmio da opção de arrependimento gerado não será estornado.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN**.  
(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK OUT**.  
(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN-OUT**.  
(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

---

**Cancelamento de contrato e a situação dos prêmios e comissões**

---

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **SWAPTION A TERMO**.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).

Quando o cancelamento ocorrer:

- Em data posterior à data de registro, pagamento de Prêmio 1 tem curso normal e do Prêmio 2 é cancelado automaticamente.
  - Na data de registro, o sistema cancela automaticamente o pagamento do Prêmio 2 e do Prêmio 1, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

---

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **COMPOUND SWAPTION**.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro, o sistema cancela automaticamente o pagamento do Prêmio 2 e do Prêmio 1, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

---

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **SWAP C/ PRÊMIO**.

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro e se o prêmio ainda não foi liquidado financeiramente o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio.

---



## Registro Contrato com curva VCP

Nos registros de contratos com curva VCP os campos **Denominação**, do grupo de informações **Se Curva = VCP**, obedece ao seguinte critério de preenchimento:

Parte	Contraparte	Curva da Parte VCP	Curva da Contraparte VCP	Preenchimento Denominação Parte	Preenchimento Denominação Contraparte
Mercado	Mercado	X	X	X	X
Mercado	Mercado	X		X	
Mercado	Mercado		X		X
Mercado	Cliente 1	X	X	X <sup>1</sup>	
Mercado	Cliente 1	X		X	
Mercado	Cliente 1		X		X
Mercado	Cliente 2	X	X	X	X
Mercado	Cliente 2	X		X	
Mercado	Cliente 2		X		X
Cliente 1	Cliente 1	X	X	X <sup>1</sup>	
Cliente 1	Cliente 1	X		X	
Cliente 1	Cliente 1		X		X
Cliente 2	Cliente 2	X	X	X	X
Cliente 2	Cliente 2	X		X	

---

Parte	Contraparte	Curva da Parte VCP	Curva da Contraparte VCP	Preenchimento Denominação Parte	Preenchimento Denominação Contraparte
Cliente 2	Cliente 2		X		X

---

**Observações:**

- 1) O campo denominação da Parte deve ser preenchido com a descrição da curva VCP de ambas as Partes.
  - 2) Agente Mercado = Participantes detentores de conta própria.
-

---

## Regras de Negócios

Estão disponibilizados para download no site da Cetip ([www.cetip.com.br](http://www.cetip.com.br)), na seção Informação Técnica/Manuais de Normas.

### Identificação dos membros envolvidos nas operações

Participante - Pessoa física, jurídica ou qualquer participante detentor de conta própria Cetip que deseja encontrar uma contraparte, que tenha uma expectativa contrária à sua, em relação à futura variação dos parâmetros para realizar o registro de um contrato de Swap.

Contraparte - Pessoa física, jurídica ou qualquer participante detentor de conta própria Cetip que tem expectativa contrária à do Participante, em relação à futura variação dos parâmetros, que deseja realizar o contrato de Swap.

Banco Liquidante - Instituições financeiras com conta reserva bancária compulsória, em espécie, no Banco Central do Brasil, detentoras de conta individualizadas junto à Cetip, habilitadas no sistema, indicadas pelas Partes para prestar serviços de liquidação financeira das operações registradas.

### Identificação de entidades

Clientes 1 - São clientes próprios dos Participantes Titulares. Considerando-se como tal as pessoas físicas ou jurídicas, que operam somente através do próprio Membro de Mercado.

Clientes 2 - São clientes de terceiros. Considerando-se como tal as pessoas físicas ou jurídicas, que operam através de Titular da conta de cliente, porém com a interveniência de um Banco Liquidante.

O Participante pode registrar um contrato de Swap entre Contas Próprias, entre um Participante Titular e seu Cliente 1 ou 2, entre um Participante detentor de conta própria e o Cliente 2 de outros, entre Clientes 2 de distintos Participantes Titulares ou entre dois Clientes 1 de um mesmo Participante Titular, à vista ou a termo.

Somente os contratos entre um Participante Titular e seu Cliente 1 e entre dois Clientes 1 de um mesmo Participante Titular podem ser registrados com prazo decorrido.

---

**Observação:** O módulo não faz crítica quanto à natureza econômica da Contraparte das operações entre Contas Próprias e Contas de Clientes 2, cabendo ao Participante observar as restrições legais existentes.

---

## **Metodologia de Cálculo**

Os cálculos aplicáveis aos Swaps estão disponibilizados para download no site da Cetip ([www.cetip.com.br](http://www.cetip.com.br)), na seção Informação Técnica/Caderno de Fórmulas.

## Formação dos Códigos do Instrumento Financeiro Swap

### Para Contratos de Swap - Swap

**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.

---

## Glossário

### A

**Antecipação:** Operação através da qual parte ou a totalidade do Swap é encerrada pelos Participantes envolvidos, antes da Data de Vencimento.

### C

**CGD:** Contrato Global de Derivativos. Elaborado a partir de um grupo de trabalho coordenado pela CAAR – Câmara para Administração de Assuntos de Risco com representantes da Cetip e de diversas associações do mercado financeiro, em conjunto com o Escritório Pinheiro Neto Advogados, tendo por objetivo o desenvolvimento de um modelo de contrato para operações de derivativos de balcão reconhecido pelo ISDA – International Swaps and Derivatives Association.

**Compound Swaption:** Operação através da qual uma das partes, mediante o pagamento de um prêmio à outra parte, adquire o direito de, em uma determinada data futura, rescindir um Swap.

**CSA:** Instrumento de Prestação de Garantias Elaborado a partir de um grupo de trabalho coordenado pela ANBIMA – Associação Brasileira das Entidades do Mercado Financeiro e de Capitais, composto por participantes do mercado financeiro, em conjunto com o Escritório Pinheiro Neto Advogados, tendo por objetivo o desenvolvimento de um modelo de contrato para operações de derivativos de balcão que tenham alocação de garantias. O modelo do contrato pode ser obtido no site da ANBIMA ([www.anbima.com.br](http://www.anbima.com.br)) ou no site da Anbid ([www.anbid.com.br](http://www.anbid.com.br)).

**Custódia Eletrônica:** Registro eletrônico de Swap no Sistema de Custódia Eletrônica.

### D

**Data de Pagamento:** Data previamente estabelecida no Swap para liquidação financeira de Diferencial.

**Data de Vencimento:** Data estabelecida para vencimento do Swap.

**Diferencial:** Diferença apurada em Data de Pagamento ou, quando for o caso, na data de Antecipação, calculada com base nos dois Indicadores Econômicos e nas demais condições pactuadas no Swap.

**Duplo Comando:** Lançamentos efetuados no Sistema de Registro pelos dois Participantes envolvidos na operação, representando a inequívoca aceitação das condições nela constante.

### I

**Indicador Econômico:** Taxa de juros, o índice de preços, a variação cambial ou outro parâmetro de remuneração ou atualização contratado em Swap.

### K

**Knock In:** Operação através do qual uma das partes, mediante o pagamento de prêmio à outra parte, estabelece a(s) condição (ões) requerida(s) para que um Swap tenha validade.

**Knock In–Out:** Operação que contém as características das operações de Knock In e Knock Out.

**Knock Out:** Operação através do qual uma das partes, mediante o pagamento de prêmio à outra parte, estabelece em que condição (ões) um Swap será rescindido.

## L

**Lançamento:** Registro efetuado por Participante em um Sistema, para efeito de inclusão de dados, ou manifestação sobre confirmação ou rejeição de liquidação financeira, entre outros.

**LBTR:** Liquidação Bruta em Tempo Real.

**Limitador de Alta:** Patamar máximo da curva do Swap, previamente estabelecido pelas partes, a ser utilizado no cálculo de Diferencial.

**Limitador de Baixa:** Patamar mínimo da curva do Swap, previamente estabelecido pelas partes, a ser utilizado no cálculo de Diferencial.

**Liquidação Bilateral:** Compensação bilateral entre Participantes.

## R

**Redutor de Risco de Crédito:** O momento em que determinado contrato será avaliado e para qual deverá ser informado seu preço de mercado (MtM).

## S

**Swaption a Termo:** Operação através da qual uma das partes, mediante o pagamento de um prêmio à outra parte, adquire o direito de, em uma determinada data futura, decidir se irá realizar um Swap.