

MANUAL DE OPERAÇÕES MID - MÓDULO DE INFORMAÇÃO DE DERIVATIVOS

CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÕES DA VERSÃO	3
2 INTRODUÇÃO.....	6
2.1 Conhecendo o Produto	6
2.2 Ações dos Botões das Telas	7
3 LANÇAMENTOS	8
3.1 Registro de Informações de Derivativos	8
3.2 Registro de Dados da Estratégia	10
3.3 Agente acelerador e aceleração de contratos	15
3.4 Manutenção de Responsável pela Aceleração	16
3.5 Aceleração de Contratos	19
3.6 Marcação a Mercado de IF	21
3.7 Manutenção de Agente de Cálculo	24
3.8 Cetip como Agente de Cálculo.....	27
3.9 Inclusão de Agenda de Redutor de Risco de Crédito	29
3.10 Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário	34
3.11 Manutenção de Agenda de Redutor de Risco de Crédito.....	37
3.12 Manutenção de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito.....	42
4 CONSULTA	45
4.1 Consulta de Informações de Derivativos	45
4.2 Histórico de Informações de Derivativos.....	47
4.3 Contratos sem Atualização no Dia.....	48
4.4 Consulta de Estratégia / Campos Habilitados.....	50
4.5 Consulta de Agente de Cálculo, Responsável pela Aceleração e Cláusulas	52
4.6 Consulta Dados da Estratégia	54
4.7 Consulta de Contratos com Estratégias.....	56
4.8 Consulta de Histórico de Marcação a Mercado	57
4.9 Consulta de Agenda/Saldo de Redutor de Risco de Crédito (Periódico/Extraordinário)	59
4.10 Consulta de Saldo Atualizada	63
5 INFORMAÇÕES ADICIONAIS	64
5.1 Regras de Negócios	64
5.2 Características dos Contratos - Cetip como Agente de Cálculo	65
5.3 Metodologia de Cálculo de Valores Financeiros para liquidação.....	69
6 GLOSSÁRIO	70

1 ATUALIZAÇÕES DA VERSÃO

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
25/11/2019	25/11/2019	<u>Consultas</u>	Inclusão da “Consulta de Saldo Atualizada”, conforme divulgado no comunicado 030/2019-VPC.
28/05/2018	28/05/2018	<u>Lançamentos</u> Marcação a Mercado de IF Manutenção de Agente de Cálculo Inclusão de Agenda de Redutor de Risco de Crédito Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário Manutenção de Agenda de Redutor de Risco de Crédito Manutenção de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito <u>Consultas</u> Consulta de Agente de Cálculo, responsável pela Aceleração e Cláusulas Consulta de Histórico de Marcação a Mercado Consulta de Agenda/Saldo de Redutor de Risco de Crédito (Periódico/Extraordinário)	Inclusão de diversas melhorias no produto DRRC – Derivativo com Redutor de Risco de Crédito, divulgadas no COMUNICADO EXTERNO 005/2018-VPC.
25/01/2017	16/04/2018	Aceleração de Contratos	Inclusão de Informações adicionais.
25/01/2017	04/10/2017	Agente acelerador e aceleração de contratos Manutenção de Responsável pela Aceleração Aceleração de Contratos Marcação a Mercado de IF Manutenção de Agente de Cálculo Cetip como Agente de Cálculo	Reorganização de formatação sem alteração de conteúdo.
25/01/2017	03/10/2017	Agente acelerador e aceleração de contratos Manutenção de Responsável pela Aceleração Aceleração de Contratos Marcação a Mercado de IF Manutenção de Agente de Cálculo Cetip como Agente de Cálculo	Reorganização e reformulação das funções para melhor entendimento.
25/01/2016	24/04/2017	Manutenção de Agente de Cálculo	Melhoria na descrição da permissão da indicação de agente de cálculo do instrumento financeiro. Melhoria da descrição das observações. Inclusão da descrição do Cetip como Agente de Cálculo e Inclusão da descrição dos Arquivos com dados de MtM.

25/01/2016	24/04/2017	Consulta de Agente de Cálculo, responsável pela Aceleração e Cláusulas	Melhoria da descrição do campo “Tipo de Indicação de Acelerador”. Melhoria da descrição da Tela de Filtro de Consulta de Agente de Cálculo e Acelerador.
25/01/2016	14/03/2017	Registro de Informações de Derivativos	Atualização de dados em complemento ao COMUNICADO CETIP 016/2017.
25/01/2016	07/12/2016	Registro de Informações de Derivativos	Alteração na descrição da inclusão do Notional.
25/01/2016	11/11/2016	Conhecendo o Produto	Exclusão do item “Box” da descrição.
25/01/2016	30/09/2016	Inclusão de Agenda de Redutor de Risco de Crédito	Alteração na descrição do campo “Condição de Valor Financeiro a Liquidar” dos Dados das Condições de Liquidação.
25/01/2016	02/05/2016	Manutenção de Responsável pela Aceleração	Alteração na descrição do campo: “ Tipo de indicação de acelerador”.
25/01/2016	29/04/2016	Manutenção de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito	Alteração nas descrições dos campos de Limites Referentes a P1 e P2: Limite Valor Disparo, Valor Mínimo de Transferência.
25/01/2016	29/04/2016	Inclusão de Agenda de Redutor de Risco de Crédito	Inclusão de Opções Flexíveis no texto da Visão Geral, alteração nas descrições dos campos: Quantidade de datas, Condição de Valor Financeiro a Liquidar, Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular, Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular e Data de Redutor de Risco de Crédito e inclusão dos campos: Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador e Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador.
25/01/2016	29/04/2016	Conhecendo o Produto	Inclusão de “Contratos de Opções Flexíveis” no texto e exclusão das observações 2) e 3).
25/01/2016	02/03/2016	Conhecendo o produto	Inclusão da observação 1).
25/01/2016	25/01/2016	Consulta Dados da Estratégia	Obrigatório o preenchimento de pelo menos um campo na tela filtro.
18/08/2014	18/11/2014	Diversas telas	Atualização de telas devido a layout (cores e formatos).
18/08/2014	31/10/2014	Atualizações da Versão	Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais nova para a mais antiga.
18/08/2014	10/09/2014	Todo o manual	Nas descrições dos campos, inclusão da informação se o preenchimento é obrigatório ou não. E atualização de algumas telas conforme estão no NoMe.
18/08/2014	18/08/2014	Marcação a Mercado de IF	Em observações, inclusão do item 3.
07/07/2014	24/07/2014	Todo o manual	Inclusão do caminho completo da função no NoMe.
07/07/2014	24/07/2014	Consultas	Atualização das telas, apenas formato, cores e fontes.
07/07/2014	07/07/2014	Manutenção de Agente de Cálculo	Inclusão da opção OPÇÕES.
07/07/2014	07/07/2014	Inclusão de Agenda de Derivativo com Redutor de Risco de Crédito	Inclusão da opção Opções Flexíveis.
02/06/2014	02/06/2014	Manutenção de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito	Inclusão da função
13/01/2014	13/01/2014	Consulta de Contratos com Estratégia	Inclusão da coluna “Valor Base” na tabela de Relação.
01/07/2013	28/10/2013	Conhecendo o Produto	Exclusão da frase “Se o pagamento não for efetivado, o contrato será acelerado.”
01/07/2013	01/07/2013	Inclusão de Agenda de Derivativo com Redutor de Risco de Crédito	Inclusão do campo Duplo Comando para Liquidação, conforme comunicado 033 e 039/13.

14/12/2011	21/02/2013	Campos com a descrição opcional.	Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
14/12/2011	15/10/2012	Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário, página 29.	Visão Geral – Melhoria no texto.
14/12/2011	06/08/2012	Manutenção de Responsável pela Aceleração	Inclusão do campo “Valor da Aceleração”.

2 INTRODUÇÃO

2.1 Conhecendo o Produto

O **MID - Módulo de Informações de Derivativos** foi desenvolvido a partir da necessidade de acompanhamento e atualização de informações relativas a contratos de **Swap com curva VCP e Tipo/Classe 73 (Estratégia)**, além de permitir a Marcação à Mercado e a inclusão do nível de alavancagem das Partes envolvidas neste tipo de Contrato.

O detalhamento das informações de **Marcação à Mercado**, **% de Notional** (Nível de alavancagem mínimo e máximo para Contratos de Swap) e **Dados da Estratégia das Partes** envolvidas no registro de contratos pretende prover ao Participante uma ferramenta que possibilite maior transparência e monitoramento das operações realizadas com Derivativos no mercado.

Atualmente, o MID disponibiliza funcionalidades para Contratos de Swap, Termo, Estratégia de Renda Fixa e Opções Flexíveis onde os Participantes podem indicar o **Agente de Cálculo**, responsável por prestar informações de Marcação a Mercado, o **Participante Responsável pela Aceleração de Contratos** e a este último registrar Operações de Aceleração de Contratos.

Derivativos com Redutor de Risco de Crédito- DRRC

O Derivativo com Redutor de Risco de Crédito (DRRC), desenvolvido pela Cetip, é uma importante ferramenta de gestão de risco de crédito. Permite o estabelecimento de um limite aceitável de exposição ao risco que uma parte concede para outra parte, em uma determinada operação.

O valor de mercado (MtM) da operação é apurado periodicamente. Quando ultrapassa o limite estabelecido pelas partes, o excedente entre o valor de mercado e o limite é pago pela parte devedora à parte credora. A partir de então, esse valor é incorporado ao MtM da operação e atualizado por índice acordado previamente entre as partes. Esse mecanismo permite que o risco de crédito da operação, representado pelo MtM, mantenha-se sempre dentro do limite estabelecido.

O registro dos eventos, e as condições de agenda de **Redutor de Risco de Crédito**, são permitidos para os seguintes tipos de contratos:

- Contratos de SWAP de Pagamento Final ou com Fluxo de Pagamentos (Constante e Não Constante). Os contratos com *Reset* não serão passíveis de indicação desta modalidade;
- Contratos de Termo de Paridade, Índices e Mercadoria.
- Contrato de Opções Flexíveis

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 o 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 atualizado por um indexador, arbitrado no ato da inclusão dos eventos de redutor de risco de crédito.

Observações:

- 1) SWAP, Termo ou Opções com redutor de risco de crédito não podem ser gravados no módulo de Registro de Contrato de Garantia.

As funcionalidades aqui representadas são detalhadas nos respectivos tópicos constantes deste Manual.

Para maiores informações sobre como acessar o módulo, consulte o manual do NoMe.

2.2 Ações dos Botões das Telas

Botão	Funcionalidade
Atualizar	Re-executa a consulta a partir dos filtros selecionados na tela anterior, atualizando eventuais dados que tenham sido alterados, entre a consulta e a nova atualização da Tela de Relação.
Confirmar	Confirma os dados informados em tela.
Corrigir	Retorna a tela anterior para correção de dados.
Desistir	Desiste da operação, retornando à tela da área de serviços.
Enviar	Envia os dados informados para validação.
Exibir página	Exibe a página indicada pelo usuário.
Limpar campos	Limpa todos os campos selecionados e digitados.
Obter no Formato	Gera arquivo *.XML (Excel) ou *.TXT, dependendo da opção escolhida na caixa de seleção, para visualização dos resultados da Tela de Relação.
Pesquisar	Submete os dados selecionados para pesquisa.
Voltar	Retorna à tela anterior.
Sair	Sai da função, retornando a tela inicial do Módulo.

3 LANÇAMENTOS

3.1 Registro de Informações de Derivativos

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Registro de Informações de Derivativos

Visão Geral

Função exclusiva para contratos de Swap em que pelo menos uma das curvas seja **VCP**.

Esta funcionalidade possibilita que o Participante registre e atualize as informações de **Marcação à Mercado** e indique os percentuais de **Notional Mínimo** e **Notional Máximo**, conforme determinado no Comunicado Cetip nº 016/2017 de 13 de março de 2017.

Nos registros e atualizações de Marcação a Mercado e Notional, cada Parte é responsável pelo seu lançamento e informações prestadas, independente do lançamento da Contraparte. Cada Parte lança o seu MTM podendo informar quantos Valores de Marcação a Mercado e Notional Mínimo e Máximo forem necessários, até o final da grade de registro sem modalidade, permanecendo válido o último informado.

Observações:

- 1) Para registro e atualização de Notional Mínimo e Notional Máximo, é necessário que pelo menos uma das partes do Contrato de Swap seja **VCP com Tipo/Classe igual a 73 – Estratégia**.
 - 2) As informações de Marcação a Mercado e Notional devem obedecer às seguintes regras:
 - a) Marcação a Mercado – os contratos não poderão permanecer sem atualização deste valor por prazo superior a 31 (trinta e um) dias corridos; e
 - b) Valor Notional (Mínimo e Máximo) – os percentuais deverão ser informados até 3 (três) dias úteis após a data de registro do Contrato.
 - 3) Para os Contratos que contêm a figura de Agente de Cálculo:
 - a) O Agente de Cálculo deverá informar a Marcação a Mercado por meio da função **Marcação a Mercado de IF**; e
 - b) As Partes deverão informar somente os Valores de Notional através desta função.
 - 4) Na hipótese de não ter sido indicado um **Agente de Cálculo**, ambas as Partes de um Contrato devem informar valores de Marcação à Mercado e Notional para contratos de Swap, em que pelo menos uma ponta tenha registrado Curva VCP com Tipo/Classe igual a 73 - Estratégia;
 - 5) Na ocorrência de registro de Cessão de Contrato:
 - a) Caso o contrato não tenha informações de Notional Mínimo cadastrado, o sistema passará a gerar pendência para ele;
 - b) Caso o contrato tenha informações de Notional Mínimo e máximo cadastrado, o novo contrato criado automaticamente pelo sistema, receberá as informações de Notional originalmente cadastradas para contrato original (cedido) e as informações de MtM deverão ser indicadas com os novos valores, pelo anuente e/ou adquirente;A quantidade de dias pendentes é contada a partir da data de cessão.
 - 6) As informações de Curvas Marcadas à Mercado de **Contratos de Swap com Reset**, que tenham **Curva VCP e Tipo/Classe 73 - Estratégia** devem ser informadas no **Módulo Swap**, para que o Reset seja ativado.
-

Tela de Filtro

Registro de Informação de Derivativos	
Código do Contrato	10K00006307
Pesquisar	Limpar Campos Desistir

Nesta tela o Participante deve informar o **Código do Contrato** de Swap passível de atualização de Valores de Marcação a Mercado e Notional Mínimo e Notional Máximo.

Tela Registro de Informações de Derivativos

Registro de Informação de Derivativos			
Características			
Código IF	Papel	Meu Número	
10K00006307	PONTA 1		
Data Início	Data Vencimento		
24/05/2010	24/05/2015		
Parte (Conta)	Nome Simplificado (Parte)		
05000.00-5	RIOBM		
Contraparte (Conta)	Nome Simplificado (Contraparte)		
10020.00-1	LEMEBM		
Curvas para Atualização			
Parte		Contraparte	
Percentual	Curva	Percentual	Curva
100,00000	VCP	100,00000	PREFIXADO 360D
+/-	Juros(% aa)	+/-	Juros(% aa)
		+	12,00000
Tipo/Classe		Tipo/Classe	
Estratégia			
Marcação a Mercado		Valores de Notional	
+/-	Valor	Valor Mínimo(%)	Valor Máximo(%)
100	100 , 00	100 , 00	100 , 00
Data Referência			
24 / 05 / 2010			
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir			

Nesta tela, o Participante pode informar o **Valor de Marcação a Mercado**, positivo ou negativo, e os **Valores de Notional**. Caso o contrato não possua alavancagem, o percentual informado deve ser igual a 100% (cem por cento).

Após preencher os campos e clicar no botão **Enviar**, o Módulo apresenta tela onde o Participante deve verificar os dados da operação, podendo confirmá-los, corrigi-los ou desistir do lançamento.

Se registro for confirmado é apresentada mensagem com o número da operação.

Descrição dos campos da Tela Registro

Campo	Descrição
Meu número	Campo de preenchimento obrigatório. Número indicativo do Participante na operação.

Marcação a Mercado – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.

Campo	Descrição
+/-	Caixa de Seleção com as opções: Vazio, + e -. Refere-se ao campo Valor.
Valor	Valor de mercado do contrato. Pode ser informado com até 10(dez) números inteiros e 2(dois) decimais.
Valores de Notional – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Valor Mínimo (%)	Percentual mínimo do valor base sobre o qual o ajuste da operação pode ser calculado (Nível de Alavancagem). Pode ser informado com até 4(quatro) inteiros e 2(dois) decimais.
Valor Máximo (%)	Percentual máximo do valor base sobre o qual o ajuste da operação pode ser calculado (Nível de Alavancagem). Pode ser informado com até 4(quatro) inteiros e 2(dois) decimais.

3.2 Registro de Dados da Estratégia

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Registro de Dados da Estratégia

Visão Geral

Esta função possibilita aos Participantes informarem os dados de determinada Estratégia de Derivativos vinculada a Contratos de Swap.

Observações:

- 1 - A Estratégia a ser vinculada ao Contrato deve ser primeiramente, autorizada/habilitada pela Cetip para o(s) Participante(s) que a requisitou (aram) para que este(s) a utilize(m) no Registro de Contrato de Swap, no Módulo Swap; e
- 2 - O Registrador, após registrar o Contrato, com a indicação do Código da Estratégia, no Módulo Swap, deve informar no MID, na função Registro de Dados de Estratégia, os respectivos dados, para os campos previamente habilitados pela Cetip. A informação dos dados da Estratégia deve ser realizada, obrigatoriamente, no mesmo dia do registro do contrato.

Tela Filtro de Registro de Dados da Estratégia

Filtro Registro Dados de Estratégia

Código do Contrato

Nesta Tela de Filtro o Participante deve informar o **Código do Contrato de Swap** em que a Estratégia de Derivativos está vinculada e, em seguida, clicar no botão **Pesquisar**.

Tela Registro de Dados de Estratégia

Registro de Dados de Estratégia		
Características		
Código IF 11J00013712	Papel PONTA 1	Meu Número 78787
Data Início 27/10/2011	Data Vencimento 19/05/2015	
Parte (Conta) 77450.00-9	Nome Simplificado (Parte) CITBM	
Contraparte (Conta) 77450.10-2	Nome Simplificado (Contraparte) CITBM	
Curva Parte PREFIXADO 360D	Curva Contra Parte VCP	
Código da Estratégia SWP00002229	Nome da Estratégia Range Digital Vencimento	

(continua)

Estratégia	
Exposição Cliente	100 ,
Fonte Indicador	na
Indicador	na
Lastro Base	na
Lastro Código do Ativo	na
Lastro Expressão	na
Lastro Indexador	na
Lastro Taxa	10 ,
Limite Inferior Indicador	10 ,
Limite Superior Indicador	110 ,
Taxa Pre-Fixada Base	25
Taxa Pre-Fixada Expressão	254
Valor Inicial Indicador	2 ,
Lastro	4242
Parte_Contraparte	5225

(continua)

Taxa Pre A Período 1	1	*	
Taxa Pre B Período 1	1	*	
Taxa Pre A Período 2	1	*	
Taxa Pre B Período 2	1	*	
Taxa Pre A Período 3	1	*	
Taxa Pre B Período 3	1	*	
Taxa Pre A Período 4	11	*	
Taxa Pre B Período 4	1	*	
Taxa Pre A Período 5	1	*	
Taxa Pre B Período 5	1	*	
Taxa Pre A Período 6	1	*	
Taxa Pre B Período 6	1	*	
Taxa Pre A Período 7	1	*	
Taxa Pre B Período 7	1	*	
Taxa Pre A Período 8	1	*	
Taxa Pre B Período 8	1	*	
Taxa Pre A Período 9	1	*	
Taxa Pre B Período 9	1	*	
Taxa Pre A Período 10	1	*	
Taxa Pre B Período 10	1	*	
Taxa Pre A Período 11	1	*	
Taxa Pre B Período 12	1	*	
Taxa Pre B Período 11	1		
Taxa Pre A Período 12	1		
Moeda Estrangeira (IOF)	DOLAR CINGAPURA		
Cotação Inicial (IOF)	11	*	
Fixing do(s) Pagamento(s) (IOF)	D-1		
Estratégia Cambial (IOF)	SIM		
CPF/CNPJ ativo na Estratégia (IOF)	5453453453		
CPF/CNPJ (posicionamento câmbio) (IOF)	COMPRADO		

(fim)

Caso o código do contrato informado na Tela de Filtro esteja vinculado a Estratégia, é apresentada tela para registro dos dados da Estratégia.

Nesta tela o Participante deve informar o campo **Meu número** e os dados referentes aos **campos da Estratégia** vinculada ao Contrato.

Os campos da Estratégia devem ser indicados por ambas as Partes do Contrato. Após o lançamento da Parte, o Contrato fica com a situação **Pendente de Lançamento da Contraparte**. No caso de Contratos realizados entre a Conta Própria de um Participante e sua Conta de Cliente o lançamento é realizado por meio de comando único do Participante Titular da Conta cliente.

A operação de Inclusão de Dados de Estratégia não admite cancelamento, sendo necessário um novo lançamento para substituir o anterior na mesma data de registro.

Descrição dos campos da Tela Registro de Dados de Estratégia

Campo	Descrição
Características – Campo de preenchimento obrigatório.	
Meu número	Número indicativo do Participante na operação.
Estratégia – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Exposição Cliente	Valor exposição cliente
Fonte Indicador	Fonte Indicador. Campo livre.
Indicador	Fonte Indicador. Campo livre.
Lastro Base	
Lastro Código do Ativo	
Lastro Expressão	
Lastro Indexador	
Lastro Taxa	
Limite Inferior Indicador	Valor Limite Inferior Indicador.
Limite Superior Indicador	Valor Limite Superior Indicador.
Taxa Pré Fixada base	Taxa Pré
Taxa Pré Fixada Expressão	Taxa Pré
Valor Inicial Indicador	Valor Inicial Indicador.
Lastro	Lastro. Campo livre.
Parte_Contraparte	
Taxa Pré A Período 1	
Taxa Pré B Período 1	
Taxa Pré A Período 2	
Taxa Pré A Período 12	
Moeda Estrangeira (IOF)	Caixa de seleção.
Cotação Inicial (IOF)	Cotação Inicial da moeda estrangeira.
Fixing do(s) Pagamento(s) (IOF)	Caixa de seleção.
Estratégia Cambial (IOF)	Caixa de seleção.

Campo	Descrição
CPF/CNPJ ativo na Estratégia (IOF)	CPF/CNPJ ativo na Estratégia.
CPF/CNPJ posicionamento câmbio na Estratégia (IOF)	Caixa de seleção.

Observações:

- 1) As operações pendentes podem ser visualizadas e lançadas através da função Manutenção de Operações Pendentes, no Módulo de Operações;
- 2) Quando o campo Upload de Arquivo estiver habilitado para uma Estratégia, é necessário apenas que uma Parte insira o documento. Caso ambas as Partes façam upload de documentos, apenas o documento inserido pelo primeiro Participante a informar os dados da Estratégia é acatado; e
- 3) A relação, descrição e formato dos campos que podem ser utilizados nas Estratégias de Derivativos é disponibilizado diariamente no arquivo DTPDADOSESTRATEGIA.txt, podendo ser obtido por meio da opção Arquivo/Arquivos Públicos no item Transf. de Arquivo da Barra de Produtos do Nome.

Após preencher os campos e clicar no botão **Enviar**, o Módulo apresenta tela onde o Participante deve verificar os dados da operação, podendo confirmar, corrigir ou desistir do lançamento. Se registro for confirmado é apresentada mensagem com o número da operação de inclusão dos dados da Estratégia.

Tela Confirmação de Registro de Dados de Estratégia

Registro de Dados de Estratégia		
Características		
Código IF 11J00013712	Papel PONTA 1	Meu Número 78767
Data Início 27/10/2011	Data Vencimento 19/05/2015	
Parte (Conta) 77450.00-9	Nome Simplificado (Parte) CITBM	
Contraparte (Conta) 77450.10-2	Nome Simplificado (Contraparte) CITBM	
Curva Parte PREFIXADO 360D	Curva Contra Parte VCP	
Código da Estratégia SWP00002229	Nome da Estratégia Range Digital Vencimento	

(continua)

Estratégia	
Exposição Cliente	100,00
Fonte Indicador	na
Indicador	na
Lastró Base	na
Lastró Código do Ativo	na
Lastró Expressão	na
Lastró Indexador	na
Lastró Taxa	10,0000
Limite Inferior Indicador	10,00000000
Limite Superior Indicador	110,00000000
Taxa Pre-Fixada Base	25
Taxa Pre-Fixada Expressão	254
Valor Inicial Indicador	2,0000
Lastró	4242
Parte_Contraparte	5225
Taxa Pre A Período 1	1,00000000
Taxa Pre B Período 1	1,00000000
Taxa Pre A Período 2	1,00000000
Taxa Pre B Período 2	1,00000000
Taxa Pre A Período 3	1,00000000
Taxa Pre B Período 3	1,00000000
Taxa Pre A Período 4	11,00000000
Taxa Pre B Período 4	1,00000000
Taxa Pre A Período 5	1,00000000
Taxa Pre B Período 5	1,00000000
Taxa Pre A Período 6	1,00000000
Taxa Pre B Período 6	1,00000000
Taxa Pre A Período 7	1,00000000
Taxa Pre B Período 7	1,00000000
Taxa Pre A Período 8	1,00000000
Taxa Pre B Período 8	1,00000000
Taxa Pre A Período 9	1,00000000
Taxa Pre B Período 9	1,00000000
Taxa Pre A Período 10	1,00000000
Taxa Pre B Período 10	1,00000000
Taxa Pre A Período 11	1,00000000
Taxa Pre B Período 12	1,00000000
Taxa Pre B Período 11	1
Taxa Pre A Período 12	1
Moeda Estrangeira (IOF)	DOLAR CINGAPURA
Cotação Inicial (IOF)	11,00000000
Fixing do(s) Pagamento(s) (IOF)	D-1
Estratégia Cambial (IOF)	SIM
CPF/CNPJ ativo na Estratégia (IOF)	5453453453
CPF/CNPJ (posicionamento câmbio) (IOF)	COMPRADO

(fim)

Lancamento de Dados de Estratégia para o contrato 11J00013712 registrado sob o No. CETIP 2014111717150237

3.3 Agente acelerador e aceleração de contratos

A aceleração de contratos é uma ferramenta desenvolvida para refletir a existência de condições contratuais de vencimento antecipado. Trata-se de uma solução operacional para permitir o encerramento de um contrato antes do seu vencimento por meio de comando unilateral (ou seja, sem duplo-comando, mesmo entre partes de mercado).

A utilização desta ferramenta se divide em duas etapas operacionais:

1. Indicação do Agente Acelerador por meio da função “**Manutenção de Responsável pela Aceleração**”.

O Agente Acelerador é a parte que detém o direito de executar a aceleração do contrato no sistema de forma unilateral.

Para maiores informações sobre este tópico, consultar o menu “Manutenção de Responsável pela Aceleração”.

2. Execução da aceleração do contrato por meio da função “**Aceleração de Contratos**”.

Para maiores informações sobre este tópico, consultar o menu “Aceleração de Contratos”.

A utilização desta ferramenta deve ser feita em conformidade com os parâmetros pactuados em contrato, independentemente de quais sejam as cláusulas de vencimento antecipado e qual o valor de liquidação que elas venham a gerar,

Todos os eventos/condições que levem à aceleração de um contrato devem ser passíveis de comprovação pelas partes da operação, que deverão ser disponibilizadas quando solicitadas, e não devem prever mudanças nos parâmetros originalmente contratados.

Em caso de condições que prevejam alterações de parâmetros ou de dúvidas acerca da utilização desta ferramenta, entrar em contato com a equipe de Produtos Derivativos de Balcão por meio do e-mail derivativos@b3.com.br.

A seguir serão detalhadas as instruções operacionais para utilização das funções “**Manutenção de Responsável pela Aceleração**” e “**Aceleração de Contratos**”.

3.4 Manutenção de Responsável pela Aceleração

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Manutenção de Responsável pela Aceleração

Visão Geral

Esta função permite a indicação do Participante (“Agente Acelerador”) que tem o direito de acelerar o contrato. Há quatro opções para a escolha do Participante Responsável pela Aceleração de Contratos:

1. Parte;
2. Contraparte;
3. Ambos – nesse caso, parte e contraparte têm a prerrogativa de acelerar o contrato. O sistema acatará o comando de quem executar a função “Aceleração de Contratos” primeiro;
4. Participante Terceiro – pode ser escolhido um Participante que não seja parte no contrato derivativo como sendo o Agente Acelerador,

Informações adicionais

- 1) A indicação de **Participante Responsável pela Aceleração** está disponível para Contratos de Swap, Termo, BOX e Opções Flexíveis;
- 2) Somente podem atuar como **Participante Responsável pela Aceleração** os Participantes detentores de Conta Própria com status **Ativa**;

- 3) A indicação do **Participante Responsável pela Aceleração** pode ser realizada da data de registro do Contrato até o dia útil anterior à data de vencimento do contrato, observado o horário limite da grade **CTP11 – Registro de Operações – Sem Liquidação no STR**;
- 4) A indicação do **Participante Responsável pela Aceleração** tem efeito imediato;
- 5) A alteração ou a exclusão do **Participante Responsável pela Aceleração** tem efeito somente no dia útil seguinte ao da solicitação sendo que o participante responsável pela aceleração que foi substituído, quando terceiro, receberá um aviso da sua destituição;
- 6) A comunicação de renúncia do **Participante Responsável pela Aceleração** deve ser realizada por meio de envio de correspondência à Cetip, com antecedência mínima de 5 (cinco) dias úteis da data da sua efetiva renúncia.

Tela de Filtro Manutenção de Responsável pela Aceleração

Manutenção de Responsável pela Aceleração - Filtro

Participante (Conta)	05000	.00	5
Contraparte (Conta)	05000	.10	8
Módulo	SWAP		
Código do Instrumento Financeiro	14D00039372		
Ação	INCLUIR		
Pesquisar Limpar Campos Desistir			

Descrição dos campos da Tela de Filtro Manutenção de Responsável pela Aceleração

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Participante (Conta)	Código Cetip da Parte do Contrato.
ContraParte (Conta)	Código Cetip da Contraparte do Contrato.
Módulo	Caixa de seleção com as opções: Swap, Opções e Termo.
Código do Instrumento Financeiro	Código do Contrato que se deseja efetuar a operação.
Ação	Caixa de seleção com as opções: Incluir, Alterar ou Excluir.

Tela de Manutenção de Responsável pela Aceleração

Responsável e Cláusulas de Aceleração de IF	
Dados do Instrumento Financeiro	
Parte (Conta) 05000.00-5 Contraparte (Conta) 05000.10-8 Módulo SWAP Código do Instrumento Financeiro 14D00039372 Ação INCLUIR	
Dados do Responsável pela Aceleração	
Tipo de Indicação de Acelerador UNICO Participante (Conta) 05000 00 5 Valor Aceleração 	
Cláusulas de Aceleração de IF	
As partes do Contrato autorizam ao Acelerador aqui indicado a registrar o vencimento antecipado do Instrumento Financeiro acima.	
Clausula 1 - O Contrato estipula cláusulas de vencimento antecipado	☒
INCLUSÃO - teste de alteração	☐
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir	

Descrição dos campos da Tela de Manutenção de Responsável pela Aceleração

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório, exceto o campo Valor da Aceleração.	
Tipo de Indicação de Acelerador	Caixa de seleção com as opções: Único e Partes. Único - O Participante indicado no campo "Parte (conta)" é o único agente acelerador que pode executar de forma unilateral a aceleração do contrato indicado. Partes – Ambos os participantes indicados nos campos "Parte (conta)" e "Contraparte (conta)" podem executar de forma unilateral a aceleração do contrato indicado. Nessa opção, o sistema acatará o comando de quem executar a função "Aceleração de Contratos" primeiro.
Participante	Código Cetip do Participante Responsável pela Aceleração do Contrato.
Valor da Aceleração	Caixa de seleção com as opções: Acelerador e Cetip. "Acelerador" – indica que o valor financeiro da aceleração será informado pelo Agente Acelerador, no momento da execução da função "Aceleração de Contratos". "Cetip" – indica que o valor financeiro da aceleração será calculado pela Cetip de forma automática (ou seja, não poderá ser informado pelo Agente Acelerador, no momento da execução da função "Aceleração de Contratos"). Esta opção poderá ser escolhida somente quando a Cetip for escolhida como "Agente de Cálculo" (mais detalhes na função "Manutenção de Agente de Cálculo") do contrato derivativo para o qual está sendo indicado o Agente Acelerador.

Tela de Confirmação

Responsável e Cláusulas de Aceleração de IF	
Dados do Instrumento Financeiro	
Parte (Conta)	05000.00-5
Contraparte (Conta)	05000.10-8
Módulo	SWAP
Código do Instrumento Financeiro	14D00039372
Ação	INCLUIR
Dados do Responsável pela Aceleração	
Tipo de Indicação de Acelerador	UNICO
Participante (Conta)	05000.00-5
Valor Aceleração	
Cláusulas de Aceleração de IF	
As partes do Contrato autorizam ao Acelerador aqui indicado a registrar o vencimento antecipado do Instrumento Financeiro acima.	
Clausula 1 - O Contrato estipula cláusulas de vencimento antecipado	☒
INCLUSÃO - teste de alteração	☐
Confirmar Corrigir Voltar Desistir	

Após confirmar, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Lançamento de Inclusão de Responsável por Aceleração para o Instrumento Financeiro 14D00039372 registrado sob o No. CETIP 2014090915827812

3.5 Aceleração de Contratos

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Aceleração de Contratos

Visão Geral

Função que permite ao **Participante Responsável pela Aceleração** (informado na função “Manutenção de Responsável pela Aceleração”) indicar o contrato que será acelerado, de forma unilateral (ou seja, sem exigência de duplo-comando).

Após a inclusão da Operação de Aceleração de Contratos, o contrato é apresentado com o status **Antecipado Total por Aceleração**.

Informações adicionais

- 1) A operação de **Aceleração de Contratos** pode cursar nas seguintes modalidades de liquidação: **Bilateral**, **Bruta** ou **Sem Modalidade**, observados os horários limites em que a mesma foi registrada;
- 2) Caso haja algum evento agendado do contrato derivativo com liquidação financeira na mesma data de lançamento da aceleração, o evento não será cancelado;;
- 3) Após a aceleração do contrato, os pagamentos de eventos ou de prêmios agendados posteriores à data da Aceleração do Contrato são automaticamente cancelados;
- 4) O cancelamento da operação de Aceleração de Contratos é possível somente no próprio dia do seu lançamento, através do Módulo **Operações** na função **Cancelamento de Operações**. Caso a modalidade da operação seja **Bilateral** ou **Bruta**, somente é admitido o cancelamento enquanto a operação estiver com status **Pendente de Liquidação Financeira**;

5) Na ocorrência de vencimento antecipado de Contrato de Derivativo cuja liquidação financeira tenha ocorrido fora do âmbito da Cetip, o **Participante Responsável pela Aceleração** deve fornecer por meio de correspondência, no mínimo, as seguintes informações: a data do vencimento antecipado; o que o motivou, o referido valor, bem como se o seu pagamento foi adimplido.

6) A operação de **Aceleração de Contratos** pode ser realizada em D+1 do registro até D-1 do vencimento. Isto também se aplica para os contratos a termo.

Tela de Filtro da Aceleração de Contrato

Após clicar no botão Pesquisar da Tela de Filtro, é apresentada a Tela para Inclusão da Operação de Aceleração de Contrato com as cláusulas selecionadas quando da inclusão do **Participante Responsável pela Aceleração**.

Operação de Aceleração de Contrato - Filtro	
Módulo	SWAP
Código do Instrumento Financeiro	14D00039372
Pesquisar Limpar Campos Desistir	

Tela de Inclusão da Operação de Aceleração

Operação de Aceleração de Contrato - Registro	
Dados do Instrumento Financeiro	
Código do Instrumento Financeiro	14D00039372
Data da Aceleração	/ /
Dados da Operação	
Valor Financeiro	,
Debitado (Conta)	. -
Meu Número	
Modalidade	
Cláusulas de Aceleração de IF	
Registro de vencimento antecipado resultante do descumprimento de uma ou mais cláusulas estabelecidas contratualmente como motivos para tal.	
Clausula 1 - O Contrato estipula cláusulas de vencimento antecipado ☐	
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir	

O Participante Responsável pela Aceleração por meio da tela abaixo, indica que a Aceleração do Contrato está sendo realizada tendo em vista o descumprimento de uma ou mais cláusulas estabelecidas contratualmente. Em seguida, após clicar no botão **Enviar**, é apresentada a Tela de Confirmação.

Descrição dos campos da Tela de Aceleração

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Data da Aceleração	Data da aceleração do contrato. Caso o contrato derivativo seja entre uma Conta Própria e uma Conta de Cliente, a data da aceleração pode ser até d-1 da data de inclusão da operação. Caso o contrato derivativo seja entre duas Contas Próprias, a data da aceleração somente poderá ser igual a data de inclusão da operação.
Valor Financeiro	Valor financeiro da aceleração em reais. O campo admite valor igual ou maior que zero. Observação: caso no momento da inclusão do Agente Acelerador tenha sido escolhida a opção “Cetip” no campo “Valor da Aceleração”, este campo será preenchido automaticamente pelo sistema. Mais detalhes nas funções “Manutenção de Responsável pela Aceleração” e “Manutenção de Agente de Cálculo”.
Debitado (Conta)	Código Cetip da parte devedora. Deve ser uma das partes do contrato derivativo.
Meu Número	Número do lançamento desta operação.
Modalidade	Modalidade de Liquidação da operação de Aceleração do Contrato. Caixa de seleção com as opções: Bruta, Bilateral e Sem Modalidade.

3.6 Marcação a Mercado de IF

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Marcação a Mercado de IF

Visão Geral

Esta função permite que ao Agente de Cálculo do Contrato de Derivativo (Swap, Opções Flexíveis, Estratégia de Renda Fixa ou Termo) informe a Marcação a Mercado do Contrato.

Observações:

- 1) A Marcação a Mercado realizada por meio desta função baseia-se na visão da Parte e/ou Contraparte do Contrato;
- 2) O sistema possui dois tipos distintos de Marcação a Mercado, são eles:
 - a) INFORMACIONAL – Marcação a Mercado (MtM) realizadas com a finalidade de indicação dos valores para fins informacionais (inclusive a obrigação relacionada ao item 6 descrito abaixo). Marcação desse tipo sensibilizam todas os processos da B3, exceto os ajustes do DRRC.
 - b) DRRC – Marcação a Mercado (MtM) realizadas com a finalidade de indicação dos valores dos derivativos que possuem agenda de Redutor de Risco de Crédito. Essas marcações sensibilizam exclusivamente os ajustes do produto DRRC;
- 3) O Módulo acata mais de um registro de Marcação a Mercado na mesma data. No entanto, para a inclusão de uma nova marcação do mesmo tipo do lançamento anterior (DRRC ou INFORMACIONAL) há a necessidade de cancelamento prévio da marcação existente. Esse cancelamento deve ser comandado pelo Participante através da função de cancelamento no módulo de Operações;

- a) O cancelamento e a inclusão da nova operação deve ser feito até o horário da grade CTP12, para corrigir eventuais falhas operacionais ou erros de informação. Se o cancelamento ou a inclusão do MtM ocorrer após o horário de fechamento da grade CTP12, o novo registro não será considerado para redutor de risco de crédito;
- b) Novos registros de Marcação a Mercado após o fechamento da modalidade Bilateral não afetam o valor de redutor de risco de crédito já gerados anteriormente;
- 4) O sistema permite registro Retroativo. Ao indicar um MTM retroativo o sistema exclui todas as informações de MTM indicadas no período entre a data retroativa e a data efetiva do registro do MTM;
- 5) A Marcação a Mercado pode ser realizada até o horário limite da grade CTP11 – Registro de Operações – Sem Liquidação no STR; e
- 6) Para Contratos de Swap com curva do tipo VCP, é obrigatório informar a marcação à mercado (MtM) aplicável ao último dia de cada mês. Para esses casos deve ser feita a indicação de “Tipo de Marcação a Mercado” igual a “INFORMACIONAL”. Tal informação deve ser indicada no último dia útil de cada mês até o quarto dia útil do mês subsequente. 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.

Tela Filtro Marcação a Mercado de IF

Marcação a Mercado de IF - Filtro

Agente de Cálculo (Conta)

Tipo de Marcação a Mercado

Código do Instrumento Financeiro

Participante (Conta)

Ação

Após informar os dados do Instrumento Financeiro e do Tipo de Marcação a Mercado na Tela de Filtro a Tela de Inclusão dos dados da Marcação a Mercado é apresentada, permitindo a indicação do valor e sua respectiva data de referência.

Descrição dos campos da Tela de Filtro Marcação a Mercado de IF

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório, exceto o campo Código da Cesta.	
Agente de Cálculo (Conta)	Participante responsável por informar a Marcação a Mercado de Contrato de Derivativos, das garantias a ele vinculadas ou de ambos.
Tipo de Marcação a Mercado	Caixa de seleção com as opções: INFORMACIONAL e DRRC. Informa o tipo de marcação a mercado a ser realizada. Marcações do tipo DRRC sensibilizam exclusivamente a agenda de Redutor de Risco de Crédito, enquanto as marcações do tipo INFORMACIONAL sensibilizam os demais processos do sistema.
Código do Instrumento Financeiro	Código do Instrumento Financeiro a ser Marcado a Mercado.
Parte (Conta)	Parte do Contrato para o qual está sendo realizada a Marcação a Mercado.
Ação	Caixa de seleção com as opções: Incluir e Consultar

Tela Marcação a Mercado de Instrumento Financeiro

Marcação a Mercado de IF - Incluir		
Dados do Instrumento Financeiro		
Código do Instrumento Financeiro	17E00001202	Valor MTM Atual
Data da Última Atualização	11/05/2018	Tipo de Marcação a Mercado
Atualizado por	DSOUSA	Agente de Cálculo (Conta)
Razão Social (Agente de Cálculo)	TESTE - BANCO HULK	Parte (Conta)
Papel	P1	
Dados de Marcação a Mercado		
Valor (R\$)	+/-	Data da Atualização
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir		

Descrição dos campos da Tela Marcação a Mercado de IF

Campo	Descrição
Valor (R\$)/Valor Unitário	Valor de mercado. Para Marcação a Mercado referente ao Contrato, pode ser informado com até 10 (dez) números inteiros e 8 (oito) decimais.
+/-	Caixa de seleção com as opções: + e -. Refere-se ao campo Valor.
Data da Atualização	Data de referência da Marcação a Mercado do IF. Admite que a data da Marcação a Mercado seja no intervalo compreendido entre a data de registro do IF até a data de registro da marcação a mercado.

Após clicar no botão Enviar é apresentada a tela para confirmação.

Marcação a Mercado de IF - Incluir		
Dados do Instrumento Financeiro		
Código do Instrumento Financeiro	17E00001202	Valor MTM Atual
Data da Última Atualização	11/05/2018	Tipo de Marcação a Mercado
Atualizado por	DSOUSA	Agente de Cálculo (Conta)
Razão Social (Agente de Cálculo)	TESTE - BANCO HULK	Parte (Conta)
Papel	P1	
Dados de Marcação a Mercado		
Valor (R\$)	+/-	Data da Atualização
100,00000000	+	11/05/2018
Confirmar Corrigir Voltar Desistir		

Após Confirmar os dados, o sistema apresenta mensagem conforme exemplo abaixo.



Lançamento de Marcação a Mercado para o Instrumento Financeiro 17E00001202 registrado sob o No. CETIP 2018051114102070

3.7 Manutenção de Agente de Cálculo

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Manutenção de Agente de Cálculo

Visão Geral

Função que permite as Partes de um Contrato de Derivativos indicarem ou efetuar a manutenção (alterar ou excluir) de um Agente de Cálculo para determinado Instrumento Financeiro.

A indicação do Agente de Cálculo para Contratos de Derivativos, que não possuam Agenda de Redutor de Risco de Crédito, não é obrigatória e pode ocorrer entre a data de registro do Contrato e o dia útil imediatamente anterior a data de seu vencimento.

É permitida a indicação de agente de cálculo do instrumento financeiro:

- Parte ou Contraparte do contrato;
 - Ambas as partes do contrato;
 - Um terceiro contratado; ou
 - A Cetip, sendo observados os critérios de seleção descritos no item "Cetip como Agente de Cálculo".
- **Observações:**
 - 1) A indicação de **Agente de Cálculo** está disponível para Contratos de Swap, Termo, Estratégia de Renda Fixa e Opções Flexíveis;
 - 2) Somente podem atuar como **Agente de Cálculo** os Participantes detentores de Conta Própria com status **Ativa**;
 - 3) A Cetip pode ser indicada para atuar como **Agente de Cálculo** (mais informações no tópico "Cetip como Agente de Cálculo").
 - 4) O **Agente de Cálculo** pode ser indicado para efetuar a Marcação a Mercado do tipo "INFORMACIONAL", "DRRC" ou de ambos;
 - 5) Na hipótese de indicação de um **Agente de Cálculo** que não seja Parte nem Contraparte do Contrato, este deve confirmar a sua indicação.
 - 6) A partir da indicação do **Agente de Cálculo** para Contratos de SWAP que uma das curvas do Contrato seja **VCP** com Tipo/Classe igual a **73 – Estratégia**, a informação da Marcação a Mercado somente pode ser realizada por meio da função **Marcação a Mercado de IF**, ficando desabilitada a possibilidade das Partes do Contrato prestar esta informação na função **Registro de Informação de Derivativos**. Continua sendo obrigação das Partes desses contratos prestarem informações relativas aos valores de Notional por meio do MID, mesmo se para este Contrato for indicado um **Agente de Cálculo**.
 - 7) A seguinte regra deve ser observada quando da indicação ou manutenção do **Agente de Cálculo**:

- A indicação ou manutenção do **Agente de Cálculo** pode ser realizada da data de registro do Contrato até o dia útil anterior a data de vencimento do Contrato, observado o horário limite da grade **CTP11 – Registro de Operações – Sem Liquidação no STR**;
- A indicação do **Agente de Cálculo** tem efeito imediato no Módulo;
- A alteração do **Agente de Cálculo** não é permitida caso haja alguma pendência de lançamento dessa figura nas operações envolvendo o DRRC.
- A exclusão do **Agente de Cálculo** não é permitida para contratos que possuam agenda de Redutor de Risco de Crédito ativa, em casos de renúncia do Agente em contratos nessa situação deve ser feita sua substituição por meio da opção “ALTERAR”.
- A alteração ou a exclusão do **Agente de Cálculo** e/ou das **Cláusulas de Aceleração** tem efeito somente no dia útil seguinte ao da solicitação; e
- A comunicação de renúncia do **Agente de Cálculo** deve ser realizada por meio de envio de correspondência à Cetip, com antecedência mínima de 5 (cinco) dias úteis da data da sua efetiva renúncia.

Tela de Filtro Manutenção de Agente de Cálculo

Manutenção de Agente de Cálculo - Filtro			
Participante (Conta)	05000	00	5
Contraparte (Conta)	05000	10	8
Módulo	SWAP		
Código do Instrumento Financeiro	18E00000756		
Ação	INCLUIR		
Pesquisar Limpar Campos Desistir			

Descrição dos campos da Tela de Filtro Manutenção de Agente de Cálculo

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório, exceto o campo Módulo.	
Parte (Conta)	Conta Cetip da Parte do Contrato.
Contraparte (Conta)	Conta Cetip da Contraparte do Contrato.
Módulo	Indicação do Módulo de Registro do Contrato de Derivativo para o qual está sendo realizada a indicação do Agente de Cálculo. Caixa de seleção com as opções: SWAP, OPÇÕES e TERMO.
Código do Instrumento Financeiro	Indicação do Código do Contrato para o qual está sendo realizada a indicação do Agente de Cálculo.
Ação	Caixa de seleção com as opções: INCLUIR, ALTERAR e EXCLUIR.

Observações:

O registro de inclusão, alteração e exclusão (destituição) de Agente de Cálculo é efetuado:

- Se indicadas ambas as partes do contrato como Agente de Cálculo, este deverá ser realizado por duplo comando das partes do contrato;
- Se indicada somente uma das partes ou um terceiro contratado como Agente de Cálculo, este deverá ser realizado por comando unilateral do participante responsável.

Tela de Inclusão de Agente de Cálculo

Cadastro de Agente de Cálculo	
Dados do Instrumento Financeiro	
Parte (Conta)	05000.00-5
Contraparte (Conta)	05000.10-8
Módulo	SWAP
Código do Instrumento Financeiro	18E00000756
Ação	INCLUIR
Dados do Agente de Cálculo	
Tipo de Indicação	AC UNICO
Tipo do Agente de Cálculo	INDICAR AGENTE DE CALCULO
Agente de Cálculo (Conta)	05000.00.5
Tipo de Marcação a Mercado	INFORMACIONAL E DRRR
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir	

Descrição dos campos da Tela de Inclusão de Agente de Cálculo

Campo	Descrição
Dados do Agente de Cálculo - Campos de preenchimento obrigatório.	
Tipo de Indicação	Caixa de seleção com as opções: VAZIO, AC ÚNICO e AMBOS. AC Único: Representa que o contrato tem apenas um Agente de Cálculo, ou seja, Parte e Contraparte indicam o mesmo Agente de Cálculo. AMBOS: Significa que ambas as partes são agentes de cálculo do contrato.
Tipo do Agente de Cálculo	Caixa de seleção com as opções Cetip, INDICAR AGENTE CÁLCULO e PARTE/CONTRAPARTE. CETIP: significa que a Cetip deve ser o AGENTE DE CÁLCULO do CONTRATO. A indicação desta opção torna desnecessário o preenchimento do campo Agente de Cálculo (Conta). INDICAR AGENTE DE CÁLCULO: significa que a Conta indicada no campo Agente de Cálculo (Conta) deve ser a responsável pela Marcação a Mercado do CONTRATO. Indicado para agente de cálculo único, exceto Cetip. Esta opção torna obrigatório o preenchimento do campo Agente de Cálculo (Conta). PARTE/CONTRAPARTE: Significa que ambas as partes são agentes de cálculo do contrato. A indicação desta opção torna desnecessário o preenchimento do campo Agente de Cálculo (Conta).
Agente de Cálculo (Conta)	Conta Cetip do Participante que está sendo indicado para atuar como Agente de Cálculo, podendo ser a Parte, Contraparte ou um Terceiro. Caso tenha sido indicada a Cetip no campo Tipo de Agente de Cálculo, este campo não deve ser preenchido.

Campo	Descrição
Tipo de Marcação a Mercado	Caixa de seleção com as opções: INFORMACIONAL, DRRC e INFORMACIONAL E DRRC. INFORMACIONAL: significa que o Agente de Cálculo indicado deve ser o responsável apenas por efetuar a Marcação a Mercado do contrato para fins informacionais. DRRC: significa que o Agente de Cálculo indicado deve ser o responsável apenas por efetuar a Marcação a Mercado do Contrato com o objetivo de sensibilização da Agenda de Redutor de Risco de Crédito. INFORMACIONAL E DRRC: significa que o Agente de Cálculo indicado deve ser o responsável por indicar a Marcação a Mercado dos Contratos tanto para sensibilização da Agenda de Redutor de Risco de Crédito quanto para fins informacionais.

Após **Enviar**, o sistema apresenta tela para **Confirmar** os dados. Confirmando, o sistema apresenta uma mensagem conforme exemplo abaixo.



Lançamento de Inclusão de Agente de Cálculo para o Instrumento Financeiro 18E00000756 registrado sob o No. CETIP 2018051414113359

3.8 Cetip como Agente de Cálculo

Quando a Cetip é escolhida como Agente de Cálculo, a indicação fica pendente de análise pela área responsável na Cetip, para que possa ser verificado se o contrato em questão é passível de marcação a mercado e se o Participante já tem assinado o Termo de Adesão.

Os contratos e ativos-subjacentes passíveis de marcação pela Cetip podem ser consultados no Manual de Metodologia de Marcação a Mercado, disponível no site da Cetip, na seção Comunicados e Documentos > Informações para Cálculo de IOF.

Os contratos de derivativos com Agenda de Redutor de Risco de Crédito (DRRC) não poderão ter a Cetip indicada como agente de cálculo.

A Cetip como Agente de Cálculo permite às Partes que o valor de mercado calculado pela Cetip seja utilizado como valor para a liquidação do contrato no momento de sua Aceleração (pelo Agente Responsável pela Aceleração, ver função “Manutenção de Responsável pela Aceleração”).

Os custos relativos à prestação deste serviço pela Cetip estão disponíveis no site da Cetip, na seção “Comunicados e Documentos > Tabela de Preços”.

Arquivos com dados de MtM

Independentemente de quem seja escolhido como Agente de Cálculo, no dia seguinte ao registro de um contrato derivativo que seja passível de cálculo de MtM pela Cetip (ver Manual de Metodologia de Marcação a Mercado, disponível no site da Cetip, na seção “Comunicados e Documentos > Informações para Cálculo de IOF”), passam a ser gerados no malote do Participante dois arquivos com o valor do contrato calculado pela Cetip:

DMIDMTM-CETIP.txt

RMIDMTM-CETIP.pdf

O conteúdo específico e *layout* do arquivo “txt” podem ser acessados no documento “Receber Arquivo” (disponível no site da Cetip, na seção “Comunicados e Documentos > Transferência de Arquivos”).

Os arquivos são gerados diariamente.

Tela de Alteração de Agente de Cálculo

Cadastro de Agente de Cálculo	
Dados do Instrumento Financeiro	
Parte (Conta) 05000.00-5 Contraparte (Conta) 05000.10-8 Módulo SWAP Código do Instrumento Financeiro 18E00000756 Ação ALTERAR	
Dados do Agente de Cálculo - Atual	
Tipo de Indicação AC UNICO Tipo do Agente de Cálculo INDICAR AGENTE DE CALCULO Agente de Cálculo (Conta) 05000.00-5 Tipo de Marcação a Mercado INFORMACIONAL E DRRC	
Dados do Agente de Cálculo	
Tipo de Indicação AC UNICO Tipo do Agente de Cálculo INDICAR AGENTE DE CALCULO Agente de Cálculo (Conta) 05000 00 5 Tipo de Marcação a Mercado DRRC	
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir	

Após Enviar, o sistema apresenta a tela para a confirmação dos dados. Confirmando, o sistema apresenta uma mensagem conforme exemplo abaixo.



Lançamento de Alteração de Agente de Cálculo para o Instrumento Financeiro 18E00000756 registrado sob o No. CETIP 2018051414113362

Tela de Exclusão de Agente de Cálculo

Cadastro de Agente de Cálculo	
Dados do Instrumento Financeiro	
Parte (Conta)	05000.10-8
Contraparte (Conta)	05000.00-5
Módulo	SWAP
Código do Instrumento Financeiro	18E00000756
Ação	EXCLUIR
Dados do Agente de Cálculo	
Tipo de Indicação	AC UNICO
Tipo do Agente de Cálculo	INDICAR AGENTE DE CALCULO
Agente de Cálculo (Conta)	05000.00-5
Tipo de Marcação a Mercado	INFORMACIONAL E DRRC
Confirmar Voltar Sair	

Após Confirmar os dados, o sistema apresenta uma mensagem conforme exemplo abaixo.



Lançamento de Exclusão de Agente de Cálculo para o Instrumento Financeiro 18E00000756 registrado sob o No. CETIP 2018051414113367

3.9 Inclusão de Agenda de Redutor de Risco de Crédito

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Inclusão de Agenda de Redutor de Risco de Crédito

Visão Geral

Função que permite as partes efetuarem o registro da **Agenda de Redutor de Risco de Crédito**, identificando o contrato de derivativo, que corresponde à agenda.

É possível registrar os eventos e as condições de agenda de Redutor de Risco de Crédito para contratos de Termo de Mercadoria, Moedas e de Índice como também contratos de Swap de Pagamento Final ou Fluxo de Pagamentos (Constante e Não Constante) e Opções Flexíveis. Os contratos com Reset não serão passíveis de indicação desta modalidade.

A agenda de redutor de risco de crédito poderá ser incluída a partir da finalização do registro do derivativo original e será obrigatória a indicação prévia de agente de cálculo para o referido contrato. O registro de evento periódico deve obedecer ao horário da grade CTP11- Reg. de Operações Sem Liquidação no STR.

Fluxo de Registro

Registro do contrato de derivativo → Inclusão do agente de cálculo → Inclusão da agenda do DRRC

O processo para inclusão da Agenda de Redutor de Risco de Crédito deve seguir uma ordem pré-estabelecida de **lançamentos**.

1. Registro do contrato de derivativo;
2. Inclusão do Agente de Cálculo;
3. Registro do DRRC indicado os parâmetros e a agenda de eventos.

As três etapas listadas acima são independentes e podem ser realizadas em dias diferentes.

Para a **efetivação** de cada uma das etapas listadas acima há a necessidade de confirmação das contrapartes (duplo-comando) quando envolver outras pontas do mercado.

Como forma de flexibilização da forma de lançamento do DRRC é possível para os derivativos SWAP e Termo de Moedas que uma mesma ponta efetue os **lançamentos** das etapas 1, 2 e 3 em um mesmo dia sem a necessidade de aguardar a confirmação das contrapartes em cada um dos processos. A **efetivação** de cada etapa permanece sendo concluída apenas com a confirmação das contrapartes envolvidas.

Já para os Termos de Índice, Mercadorias ou Opções Flexíveis, após a confirmação do registro de contrato de derivativo (etapa 1) é possível o **lançamento** das etapas 2 e 3 sem a necessidade de aguardar a confirmação das contrapartes em cada um dos processos. Novamente, a **efetivação** de cada etapa permanece sendo concluída apenas com a confirmação das partes envolvidas.

Tela de Filtro de Inclusão de Agenda de Redutor de Risco de Crédito

Inclusão de Agenda de Derivativo com Redutor de Risco de Crédito

Parte (Conta)	
Contraparte (Conta)	
Código do Contrato	
Tipo de Contrato	
Agenda de Redutor de Risco de Crédito	
Quantidade de Datas	
Pesquisar Limpar Campos Desistir	

Após preencher os campos da Tela Filtro e feita a escolha do tipo da **Agenda de Redutor de Risco de Crédito** o módulo apresenta a tela referente à agenda selecionada: "Agenda Constante", "Agenda Não Constante", "Agenda Semanal" e "Agenda Mensal". Abaixo, temos o exemplo para a tela de inclusão para **Agenda Constante**.

Observações:

No caso de **Agenda Não Constante**, o módulo apresenta a quantidade de linhas quantas forem às datas de Redutor de Risco de Crédito indicadas na tela filtro. Limitado a 999 linhas.

No caso de **Agenda Semanal**, o módulo apresenta o dia da semana (segunda-feira; ; sexta-feira) que deverá ser escolhido para que seja criada automaticamente uma agenda com eventos semanais no dia indicado.

No caso de **Agenda Mensal**, o módulo apresenta o dia do mês (01; 02; ... ; 30; 31) que deverá ser escolhido para que seja criada automaticamente uma agenda com eventos mensais no dia indicado.

Para as agendas **Semanais** e **Mensais**, caso alguma data programada para evento seja dia não útil, haverá a criação automática de evento para o dia útil subsequente.

Descrição dos campos da Tela de Filtro de Inclusão de Agenda de Redutor de Risco de Crédito

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório, exceto o campo Quantidade de datas.	
Participante (Conta)	Conta Cetip da Parte do Contrato.
Contraparte (Conta)	Conta Cetip da Contraparte do Contrato.
Código do Contrato	Código do contrato do derivativo original.
Tipo de Contrato	Caixa de seleção com as opções: Opções Flexíveis, Swap e Termo.
Agenda de Redutor de Risco de Crédito	Caixa de seleção com as opções: "Constante", "Não Constante", "Semanal" e "Mensal".
Quantidade de datas	Campo exclusivo para opção de Agenda de Redutor de Risco de Crédito "Não Constante". Informar a quantidade de datas necessárias na Agenda. O sistema apresentará a quantidade de datas informadas na tela seguinte.

Tela de Inclusão da Agenda

Inclusão de Agenda de Derivativo com Redutor de Risco de Crédito	
Dados do Contrato	
Código do Contrato 11100000080	Tipo de Contrato SWAP com Pagamento Final
Parte (Conta) 10020.00-1	Parte (Nome Simplificado) LEMEBM
Parte (Comitente)	Papel Parte P1
Contraparte (Conta) 10020.10-4	Contraparte (Nome Simplificado) LEMEBM
Contraparte (Comitente)	Papel Contraparte P2
Data Início 02/09/2011	Data Vencimento 15/08/2014
Dados do Agente de Cálculo	
Agente de Cálculo (Conta) 10020.00-1	Agente de Cálculo BANCO LEME S/A
Dados da Correção de Saldo	
Percentual ,	Curva
% a.a. ,	
Dados das Condições de Liquidação	
Duplo Comando para Liquidação 	Condição de Valor Financeiro à Liquidar
Valores Referentes ao P1 Valores Referentes ao P2	
Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular ,	Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador ,
Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular ,	Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador ,
Dados da Agenda	
Agenda de Redutor de Risco de Crédito Não Constante	
Data de Redutor de Risco de Crédito / /	Data de Redutor de Risco de Crédito / /
Data de Redutor de Risco de Crédito 15/08/2014	Meu Número
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir	

Descrição dos campos da Tela de Inclusão de Agenda

Campo	Descrição
Dados da Correção de Saldo – Campos de preenchimento obrigatório, exceto o campo % a.a	
Percentual	Percentual destacado da curva para atualização do saldo da agenda. Preencher com 3 inteiros e 2 decimais.
Curva	Caixa de seleção com as opções: "DI", "SELIC", "DOLAR", "PREFIXADO 252".
% a.a	Campo de preenchimento obrigatório, somente quando selecionada curva PREFIXADO 252. Taxa de juros Spread agregada à curva. Preencher com 3 inteiros e 4 decimais.
Dados das Condições de Liquidação	
Duplo Comando para Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa com as opções: Sim e Não. Indica a necessidade de aprovação da liquidação do Redutor de Risco de Crédito pela(s) ponta(s) do contrato.
Condição de Valor Financeiro a Liquidar	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: variáveis de acordo com o "Tipo de Contrato": Para contrato de Swap: "P1", "P2" e "P1 ou P2"; Para contrato de Termo: "Comprador", "Vendedor" e "Comprador ou Vendedor"; Para contrato de Opções Flexíveis: "Lançador", "Titular" e "Lançador ou Titular". Determina quem receberá o ajuste do DRRC nos casos em que as condições de "Limite Valor Disparo" e "Valor Mínimo de Transferência" são satisfeitas.
Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular (Threshold)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor em reais. Preencher com 10 inteiros e 2 decimais. Informar limite máximo de risco que P1 assume em relação à P2. Ou seja, a quantia que exceder esse valor (e também o "Valor Mínimo de Transferência P1") P2 pagará para P1, caso P1 esteja indicado no campo "Valor Financeiro a Liquidar".
Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular (Minimum Transfer Amount)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor em reais. Preencher com 10 inteiros e 2 decimais. Informar o valor que determina se o excedente em relação ao "Limite Valor Disparo P1" será transferido para P1. Ou seja, se o excedente estiver acima desse valor, ele será transferido de P2 para P1, caso contrário, não haverá transferência.

Campo	Descrição
Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador (Threshold)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor em reais. Preencher com 10 inteiros e 2 decimais. Informar limite máximo de risco que P2 assume em relação à P1. Ou seja, a quantia que exceder esse valor (e também o "Valor Mínimo de Transferência P2") P1 pagará para P2, caso P2 esteja indicado no campo "Valor Financeiro a Liquidar".
Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador (Minimum Transfer Amount)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor em reais. Preencher com 10 inteiros e 2 decimais. Informar o valor que determina se o excedente em relação ao "Limite Valor Disparo P1" será transferido para P2. Ou seja, se o excedente estiver acima desse valor, ele será transferido de P1 para P2, caso contrário, não haverá transferência.
Dados da Agenda	
Redutor de Risco de Crédito a cada (dias úteis)	Campo de preenchimento obrigatório, se Agenda for: "Constante". Número de dias úteis entre as datas da agenda de redutor de risco de crédito.
Data início Agenda de Redutor de Risco de Crédito	Campo de preenchimento obrigatório, se agenda for: "Constante", "Semanal" ou "Mensal". A data deve ser dia útil. Formato: DD/MM/AAAA. Para agenda "Constante" o campo indica a data do primeiro evento. A partir dessa data haverá a criação automática de eventos conforme a periodicidade indicada. Para agenda "Semanal" e "Mensal" o campo indica a data a partir da qual haverá a criação automática de eventos nos dias solicitados (dias da semana ou dias do mês, respectivamente).
Dia da Semana	Campo de preenchimento obrigatório, se Agenda for: "Semanal". Campo com as opções "SEGUNDA-FEIRA", "TERÇA-FEIRA", "QUARTA-FEIRA", "QUINTA-FEIRA" e "SEXTA-FEIRA". Será gerado um evento para cada dia de semana indicado nesse campo entre a data de início da agenda e a data de vencimento do contrato. Caso o dia da semana seja um dia não útil, haverá a criação automática de evento para o dia útil subsequente

Campo	Descrição
Data do Mês	Campo de preenchimento obrigatório, se Agenda for: "Mensal". Campo com as opções "1", "2", ... , "30" e "31". Será gerado um evento para cada dia do mês indicado nesse campo entre a data de início da agenda e a data de vencimento do contrato. Caso a data do mês seja um dia não útil, haverá a criação automática de evento para o dia útil subsequente.
Data de Redutor de Risco de Crédito	Campo de preenchimento obrigatório, se Agenda for: "Não-Constante". Data útil da agenda não constante. Formato: DD/MM/AAAA. Indica a data do evento a ser criado.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número do lançamento desta operação.

3.10 Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário

Visão Geral

Esta função permite que seja efetuado o registro de Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário, identificando o código do Derivativo relacionado.

É possível registrar evento extraordinário apenas para contratos que possuam Agenda de Redutor de Risco de Crédito previamente indicada.

O registro de evento extraordinário deve obedecer ao horário da grade de liquidação da operação entre os participantes.

A data de redutor de risco de crédito extraordinário será sempre a data de registro no Módulo.

Não é possível incluir Evento Extraordinário no mesmo dia de inclusão da agenda de Redutor de Risco de Crédito.

Pode-se incluir evento extraordinário na mesma data de evento já previamente agendado, entretanto, a inclusão é permitida apenas caso o evento agendado esteja finalizado .

É possível incluir mais de um evento extraordinário para a mesma data, entretanto, a inclusão de um novo evento é possível apenas após a finalização do anterior.

Tela de Filtro de Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário

Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário

Parte (Conta)
 Contraparte (Conta)
 Código do Contrato
 Tipo de Contrato 

Após preencher os campos da Tela Filtro é apresentada a tela de inclusão de redutor de risco de crédito extraordinário, para o preenchimento dos Dados do Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

Descrição dos campos da Tela Filtro de Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Participante (Conta)	Conta Cetip da Parte do Contrato.
Contraparte (Conta)	Conta Cetip da Contraparte do Contrato.
Código do Contrato	Código do contrato do derivativo original.
Tipo de Contrato	Caixa de seleção com as opções: "Swap" e "Termo".

Tela de Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário

Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário		
Dados do Contrato		
Código do Contrato 14C00035714	Tipo de Contrato SWAP com Pagamento Final	
Parte (Conta) 05000.00-5	Parte (Nome Simplificado) RIOBM	
Parte (Comitente)	Papel Parte P1	
Contraparte (Conta) 10020.00-1	Contraparte (Nome Simplificado) LEMEBM	
Contraparte (Comitente)	Papel Contraparte P2	
Data Início 24/03/2014	Data Vencimento 24/03/2015	
Dados do Agente de Cálculo		
Agente de Cálculo (Conta) 05000.00-5	Agente de Cálculo TESTE - BCO RIO S/A	
Agente de Cálculo (Conta) 10020.00-1	Agente de Cálculo BANCO LEME S/A	
Dados da Correção de Saldo		
Percentual 100,00	Curva DI	% a.a. 1,0000
Dados das Condições de Liquidação		
Condição de Valor Financeiro à Liquidar P1 ou P2		
Valores Referentes ao P1		Valores Referentes ao P2
Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular 1.000,00	Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador	
Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular	Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador	
Dados do Redutor de Risco de Crédito Extraordinário		
Data de Redutor de Risco de Crédito 18/11/2014	Meu Número 26	
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir		

Após **Enviar** os dados, o sistema apresenta a tela para confirmação dos dados.

Descrição dos campos da Tela de Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário

Campo	Descrição
Dados do Redutor de Risco de Crédito Extraordinário	
Data do Redutor de Risco de Crédito Extraordinário	Campo de preenchimento automático. Data de evento do Redutor de Risco de Crédito Extraordinário. Exclusivamente para data de registro no Módulo.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número do lançamento desta operação.

Tela da Confirmação de Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário

Inclusão de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário		
Dados do Contrato		
Código do Contrato	Tipo de Contrato	
14C00035714	SWAP com Pagamento Final	
Parte (Conta)	Parte (Nome Simplificado)	
05000.00-5	RIOBM	
Parte (Comitente)	Papel Parte	
	P1	
Contraparte (Conta)	Contraparte (Nome Simplificado)	
10020.00-1	LEMEBM	
Contraparte (Comitente)	Papel Contraparte	
	P2	
Data Início	Data Vencimento	
24/03/2014	24/03/2015	
Dados do Agente de Cálculo		
Agente de Cálculo (Conta)	Agente de Cálculo	
05000.00-5	TESTE - BCO RIO S/A	
Agente de Cálculo (Conta)	Agente de Cálculo	
10020.00-1	BANCO LEME S/A	
Dados da Correção de Saldo		
Percentual	Curva	% a.a.
100,00	DI	1,0000
Dados das Condições de Liquidação		
Condição de Valor Financeiro à Liquidar P1 ou P2		
Valores Referentes ao P1		Valores Referentes ao P2
Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular 1.000,00		Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador
Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular		Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador
Dados do Redutor de Risco de Crédito Extraordinário		
Data de Redutor de Risco de Crédito	Meu Número	
18/11/2014	26	
Confirmar Corrigir Voltar Desistir		

Após **Conformar** os dados, o sistema apresenta uma mensagem conforme exemplo abaixo.

Lançamento de Inclusão de Data de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário para o Instrumento Financeiro 14C00035714 registrado sob o No. CETIP 2014111817162863

3.11 Manutenção de Agenda de Redutor de Risco de Crédito

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Manutenção de Agenda de Redutor de Risco de Crédito

Visão Geral

Função que permite fazer a Manutenção de Agenda de Redutor de Risco de Crédito a qualquer momento da data de registro da agenda (inclusive) e até D-1 da data de vencimento do contrato.

A função é apresentada de forma a permitir a manutenção de cada de redutor de risco de crédito da agenda.

Tela de Filtro de Manutenção de Agenda de Redutor de Risco de Crédito

Manutenção de Agenda de Redutor de Risco de Crédito			
Parte (Conta)	05000	00	5
Contraparte (Conta)	03092	00	8
Código do Contrato	17E00001202		
Tipo de Contrato	Swap		
Ação	CONSULTAR		
Quantidade de Datas			
Pesquisar Limpar Campos Desistir			

Descrição dos campos da Tela Filtro de Manutenção de Agenda de Redutor de Risco de Crédito

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Parte (Conta)	Conta Cetip da Parte do Contrato.
Contraparte (Conta)	Conta Cetip da Contraparte do Contrato.
Código do Contrato	Código do contrato do derivativo original.
Tipo de Contrato	Caixa de seleção com as opções: "Swap", "Termo" e "Opção".
Ação	Caixa de seleção com as opções: "CONSULTAR" e "INCLUIR".
Quantidade de Datas	Campo de preenchimento obrigatório para ação "INCLUIR". Indica a quantidade de datas a ser incluídas na Agenda de Redutor de Risco de Crédito. O campo não deve ser preenchido para ação "CONSULTAR".

Tela de Relação para ação "CONSULTAR"

Ação	Código do Contrato	Tipo de Contrato	Parte (Conta)	Nome Simplificado Parte	Comitente Parte	Contraparte (Conta)	Nome Simplificado Contraparte	Comitente Contraparte	Data Início	Data Vencimento
Alterar Data de Redutor de Risco de Crédito	17E00001202	Swap	05000.00-5	RIOBM		03092.00-8	HULKBK		10/05/2017	10/12/2018
Excluir Data de Redutor de Risco de Crédito	17E00001202	Swap	05000.00-5	RIOBM		03092.00-8	HULKBK		10/05/2017	10/12/2018
	17E00001202	Swap	05000.00-5	RIOBM		03092.00-8	HULKBK		10/05/2017	10/12/2018

(continua)

Agente de Cálculo (Conta)	Nome Simplificado Agente de Cálculo	Agente de Cálculo (Conta)	Nome Simplificado Agente de Cálculo	Duplo Comando para Liquidação	Condição de Valor Financeiro a Liquidar	Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular	Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular	Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador
03092.00-8	HULKBK			NÃO	P1 ou P2			
03092.00-8	HULKBK			NÃO	P1 ou P2			
03092.00-8	HULKBK			NÃO	P1 ou P2			

(continua)

Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador	Data de Redutor de Risco de Crédito	Tipo de Redutor de Risco de Crédito	Situação de Redutor de Risco de Crédito	Usuário	Data - Hora
	15/05/2018	Periódico	NÃO LIQUIDADO	BRUNOP	11/05/2017 00:00:00
	16/05/2018	Periódico	NÃO LIQUIDADO	BRUNOP	11/05/2017 00:00:00
	17/05/2018	Periódico	NÃO LIQUIDADO	BRUNOP	11/05/2017 00:00:00

(fim)

Após a seleção da ação desejada é apresentada a tela da função para alteração ou exclusão conforme selecionado.

Tela Alterar Opção: Alterar

Alteração de Data de Redutor de Risco de Crédito		
Dados do Contrato		
Código do Contrato 17E00001202	Tipo de Contrato SWAP com Fluxo Não Constante	
Parte (Conta) 05000.00-5	Parte (Nome Simplificado) RIOBM	
Parte (Comitente)	Papel Parte P2	
Contraparte (Conta) 03092.00-8	Contraparte (Nome Simplificado) HULKBM	
Contraparte (Comitente)	Papel Contraparte P1	
Data Início 10/05/2017	Data Vencimento 10/12/2018	
Dados do Agente de Cálculo		
Agente de Cálculo (Conta) 03092.00-8	Agente de Cálculo TESTE - BANCO HULK	
Dados da Correção de Saldo		
Percentual 100,00	Curva DI	% a.a. 10,0000
Dados das Condições de Liquidação		
Duplo Comando para Liquidação NÃO	Condição de Valor Financeiro à Liquidar P1 ou P2	
Valores Referentes ao P1 Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular Valores Referentes ao P2 Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador		
Dados da Agenda		
Tipo de Redutor de Risco de Crédito Periódico	Data de Redutor de Risco de Crédito 15 / 5 / 2018	Meu Número
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir		
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir		

Após **Enviar** os dados, o sistema apresenta uma tela para confirmação. Após Confirmar, o sistema apresenta uma mensagem conforme exemplo abaixo.

Lançamento de Alteração de Data de Redutor de Risco de Crédito para o Instrumento Financeiro 14C00035714 registrado sob o No. CETIP 2014111817162889

Tela Excluir Opção: Excluir

Exclusão de Data de Redutor de Risco de Crédito		
Dados do Contrato		
Código do Contrato	Tipo de Contrato	
14C00035714	SWAP com Pagamento Final	
Parte (Conta)	Parte (Nome Simplificado)	
05000.00-5	RIOBM	
Parte (Comitente)	Papel Parte	
	P1	
Contraparte (Conta)	Contraparte (Nome Simplificado)	
10020.00-1	LEMEBM	
Contraparte (Comitente)	Papel Contraparte	
	P2	
Data Início	Data Vencimento	
24/03/2014	24/03/2015	
Dados do Agente de Cálculo		
Agente de Cálculo (Conta)	Agente de Cálculo	
05000.00-5	TESTE - BCO RIO S/A	
Agente de Cálculo (Conta)	Agente de Cálculo	
10020.00-1	BANCO LEME S/A	
Dados da Correção de Saldo		
Percentual	Curva	% a.a.
100,00	DI	1,0000
Dados das Condições de Liquidação		
Duplo Comando para Liquidação	Condição de Valor Financeiro à Liquidar	
NÃO	P1 ou P2	
Valores Referentes ao P1 Valores Referentes ao P2 Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular 1.000,00 Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador		
Dados da Agenda		
Tipo de Redutor de Risco de Crédito	Data de Redutor de Risco de Crédito	Meu Número
Periódico	24/02/2015	27

Após confirmar a ação de Exclusão, o sistema apresenta a **Tela de Confirmação** com as informações da Agenda de Redutor de Risco de Crédito com a manutenção para confirmação dos dados incluídos.

Tela de Relação para ação “INCLUIR”

Inclusão de Data de Redutor de Risco de Crédito		
Dados do Contrato		
Código do Contrato 17E00001202	Tipo de Contrato SWAP com Fluxo Não Constante	
Parte (Conta) 05000.00-5	Parte (Nome Simplificado) RIOBM	
Parte (Comitente)	Papel Parte P2	
Contraparte (Conta) 03092.00-8	Contraparte (Nome Simplificado) HULKBM	
Contraparte (Comitente)	Papel Contraparte P1	
Data Início 10/05/2017	Data Vencimento 10/12/2018	
Dados do Agente de Cálculo		
Agente de Cálculo (Conta) 03092.00-8	Agente de Cálculo TESTE - BANCO HULK	
Dados da Correção de Saldo		
Percentual 100,00	Curva DI	% a.a. 10,0000
Dados das Condições de Liquidação		
Duplo Comando para Liquidação NÃO	Condição de Valor Financeiro à Liquidar P1 ou P2	
Valores Referentes ao P1 Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular Valores Referentes ao P2 Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador		
Dados da Agenda		
Data de Redutor de Risco de Crédito 16 / 05 / 2018	Meu Número 12345	
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir		

Após confirmar a ação de inclusão, o sistema apresenta a **Tela de Confirmação** com as informações da Agenda de Redutor de Risco de Crédito com a manutenção para confirmação dos dados incluídos.



Lançamento de Inclusão de Data de Agenda de Derivativo com Redutor de Risco de Crédito para o Instrumento Financeiro 17E00001202 registrado sob o No. CETIP 2018051414113389

Descrição dos campos da tela Inclusão, Alteração e Exclusão

Campo	Descrição
Data de Redutor de Risco de Crédito	Campo de preenchimento obrigatório, apresentado somente para as funções de inclusão e alteração. Formato DD/MM/AAAA que indica a data do evento a ser incluída na agenda.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório. Número do lançamento desta operação.

3.12 Manutenção de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Manutenção de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito

Visão Geral

Esta função permite a qualquer momento a partir de D+1 do registro até D-2 do vencimento alterar os parâmetros: Limite Valor Disparo e Valor Mínimo de Transferência.

Essas alterações devem incidir sobre as regras de cálculo do sistema a partir do momento da alteração. Nesta função é permitido alterar apenas um parâmetro ou ambos.

Tela Filtro Manutenção de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito

Manutenção de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito			
Parte (Conta)	05000	.00	-5
Contraparte (Conta)	03092	.00	-8
Código do Contrato	17E00001202		
Tipo de Contrato	Swap ▼		
Pesquisar Limpar Campos Desistir			

Descrição dos campos da Tela Filtro Manutenção de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Parte (Conta)	Código Cetip da Parte no Contrato.
Contraparte (Conta)	Código Cetip da Contraparte no Contrato.
Código do Contrato	Código de identificação do Contrato a ser pesquisado.
Tipo do Contrato	Caixa com as opções: Opções Flexíveis, Swap e Termo

Após clicar no botão **Pesquisar**, o sistema apresenta a tela Alteração de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito, para manutenção dos parâmetros da agenda de DRRC vinculada ao contrato pesquisado.

Tela Alteração de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito

Alteração Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito	
Dados do Contrato	
Código do Contrato 17E00001202	
Parte (Conta) 05000.00-5	Parte (Nome Simplificado) RIOBM
Parte (Comitente)	
Contraparte (Conta) 03092.00-8	Contraparte (Nome Simplificado) HULKBM
Contraparte (Comitente)	
Data Início 10/05/2017	Data Vencimento 10/12/2018
Duplo comando para liquidação NÃO	
Valores Referentes ao P1	
Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular	Valores Referentes ao P2
Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular	Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador
	Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador
Valores das Condições de Liquidação	
Duplo comando para liquidação	
Valores Referentes ao P1	
Limite Valor Disparo	Valores Referentes ao P2
Valor Mínimo de Transferência	Limite Valor Disparo
	Valor Mínimo de Transferência
Meu Número	
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir	

Descrição dos campos da Tela Valores das Condições de Liquidação

Campo	Descrição
Duplo comando para liquidação	Caixa com as opções: Sim e Não. Indica a necessidade de aprovação da liquidação do Redutor de Risco de Crédito pela(s) ponta(s) do contrato. Quando preenchido "Sim", o sistema só irá gerar a operação de pagamento do ajuste do DRRC (se houver) quando houver a confirmação das partes.
Valores Referentes ao P1 – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Limite Valor Disparo	Informar limite máximo de risco que P1 assume em relação à P2.
Valor Mínimo de Transferência	Informar o valor que determina se o excedente em relação ao "Limite Valor Disparo P1" será transferido para P1. Ou seja, se o excedente estiver acima desse valor, ele será transferido de P2 para P1, caso contrário, não haverá transferência.
Valores Referentes ao P2 – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Limite Valor Disparo	Informar limite máximo de risco que P2 assume em relação à P1.
Valor Mínimo de Transferência	Informar o valor que determina se o excedente em relação ao "Limite Valor Disparo P2" será transferido para P2. Ou seja, se o excedente estiver acima desse valor, ele será transferido de P1 para P2, caso contrário, não haverá transferência.

Campo	Descrição
Meu Número	Número do lançamento na operação.

Observação:

- ✓ A manutenção deve exigir duplo-comando entre as partes para operações entre mercado;
- ✓ A manutenção é lançamento único para operações com clientes 1.

Após **Enviar** os dados, o sistema apresenta a tela para confirmação dos dados.

Tela Alteração de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito - Confirmação

Alteração Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito	
Dados do Contrato	
Código do Contrato 17E00001202	
Parte (Conta) 05000.00-5	Parte (Nome Simplificado) RIOBM
Parte (Comitente)	
Contraparte (Conta) 03092.00-8	Contraparte (Nome Simplificado) HULKBM
Contraparte (Comitente)	
Data Início 10/05/2017	Data Vencimento 10/12/2018
Duplo comando para liquidação NÃO	
Valores Referentes ao P1	
Limite Valor Disparo P1/Comprador/Titular	Valores Referentes ao P2
Valor Mínimo de Transferência P1/Comprador/Titular	Limite Valor Disparo P2/Vendedor/Lançador
	Valor Mínimo de Transferência P2/Vendedor/Lançador
Valores das Condições de Liquidação	
Duplo comando para liquidação NÃO	
Valores Referentes ao P1	
Limite Valor Disparo 1.000,00	Valores Referentes ao P2
Valor Mínimo de Transferência 150,00	Limite Valor Disparo 1.000,00
	Valor Mínimo de Transferência 150,00
Meu Número 123	
Confirmar Corrigir Voltar Desistir	

Após **Conformar** os dados, o sistema apresenta a mensagem abaixo.



Lançamento de Alteração de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito para o Instrumento Financeiro 17E00001202 registrado sob o No. CETIP 2018051414113408

4 CONSULTA

4.1 Consulta de Informações de Derivativos

Menu Informações de Derivativos > Consultas > Consulta de Informações de Derivativos

Visão Geral

Esta consulta possibilita ao Participante visualizar a última atualização de **Valor de Marcação à Mercado** e **Notional Mínimo** e **Máximo**.

Tela Filtro de Consulta de Informações de Derivativos

Consulta de Informações de Derivativos

Nome Simplificado (Parte)

Parte (Conta)

Nome Simplificado (Contraparte)

Contraparte (Conta)

Nome Simplificado (Agente de Cálculo)

Agente de Cálculo (Conta)

Código do Contrato

Tipo de IF

Nesta Tela de Filtro o Participante deve informar os dados relativos ao contrato que se deseja visualizar as atualizações. Ao preencher apenas os campos relativos à **Parte** e **Contraparte**, o Módulo busca todos os contratos realizados entre os Participantes informados.

Após preencher os campos desejados, o usuário deve clicar no botão **Pesquisar**.

Descrição dos campos da Tela Filtro de Consulta de Informações de Derivativos

Campo	Descrição
Nome Simplificado (Parte)	Nome simplificado da Parte no Contrato.
Parte (Conta)	Código Cetip da Parte no Contrato.
Nome Simplificado (Contraparte)	Nome simplificado da Contraparte no Contrato.
Contraparte (Conta)	Código Cetip da Contraparte no Contrato.
Nome Simplificado (Agente de Cálculo)	Nome simplificado do Agente de Cálculo.
Agente de Cálculo (Conta)	Código Cetip do Agente de Cálculo.
Código do Contrato	Código de identificação do Contrato a ser pesquisado.
Tipo do IF	Campo <i>default</i> , com a opção Swap.

Tela de Relação

Consulta de Informações de Derivativos										
Página 1 de 2801 (Linhas 1 a 25 de 70004)										
Data e Hora da Consulta: 24/07/2014 - 12:30:49										
 Critério de pesquisa										
						Parte				
Código do Contrato	Tipo de IF	Nome Simplificado (Parte)	Parte (Conta)	Nome Simplificado (Contraparte)	Contraparte (Conta)	Valor MTM	MTM Última Atual.	Notional Mínimo (%)	Notional Máximo (%)	Notional Última Atual.
10K00006307	SWAP	RIOBM	05000.00-5	LEMEBM	10020.00-1	-515.000,45	13/05/2011			
14B00000466	SWAP	RIOBM	05000.00-5	COPABM	77785.00-4	-551,92	30/05/2014			
14D00031163	SWAP	RIOBM	05000.00-5	RIOBM	05000.10-8	-10,00	28/04/2014			
14D00031163	SWAP	RIOBM	05000.10-8	RIOBM	05000.00-5	10,00	28/04/2014			
14D00031165	SWAP	RIOBM	05000.00-5	RIOBM	05000.10-8	-10,00	28/04/2014			
14D00031165	SWAP	RIOBM	05000.10-8	RIOBM	05000.00-5	10,00	28/04/2014			
14D00031186	SWAP	RIOBM	05000.00-5	RIOBM	05000.10-8	1,00	29/04/2014			
14D00031198	SWAP	RIOBM	05000.00-5	RIOBM	05000.10-8	1,00	29/04/2014	1,00	4,00	29/04/2014
◀◀ 1 ▶▶ Exibir página						Atualizar Voltar				

(continua)

Contraparte								
Valor MTM	MTM Última Atual.	Notional Mínimo (%)	Notional Máximo (%)	Notional Última Atual.	Nome Simplificado (Agente de Cálculo)	Agente de Cálculo (Conta)	Nome Simplificado (Agente de Cálculo Contraparte)	Agente de Cálculo Contraparte (Conta)
515.000,45	13/05/2011				RIOBM	05000.00-5	LEMEBM	10020.00-1
551,92	30/05/2014				COPABM	77785.00-4		
10,00	28/04/2014				RIOBM	05000.00-5		
-10,00	28/04/2014				RIOBM	05000.00-5		
10,00	28/04/2014				RIOBM	05000.00-5		
-10,00	28/04/2014				RIOBM	05000.00-5		

(fim)

Através da **Tela de Relação** o Participante pode visualizar a última atualização realizada, por data, em um contrato. A consulta pode ser obtida nos formato excel ou texto, após a seleção do formato desejado clicar no botão **Obter no formato**.

Observação: As informações da Contraparte podem ser vista apenas se os Participantes estiverem alocados sob a mesma Família de Digitação.

4.2 Histórico de Informações de Derivativos

Menu Informações de Derivativos > Consultas > Histórico de Informações de Derivativos

Visão Geral

Esta função permite que o Participante e o Agente de Cálculo, quando for o caso, visualizem o histórico de todas as atualizações efetuadas nos **Valores de Marcação a Mercado** e **Notional Mínimo e Máximo**.

Tela Filtro de Histórico de Informações de Derivativos

Histórico de Informações de Derivativos	
Nome Simplificado (Parte)	riobm
Parte (Conta)	05000 00 5
Nome Simplificado (Contraparte)	
Contraparte (Conta)	
Nome Simplificado (Agente de Cálculo)	
Agente de Cálculo (Conta)	
Código do Contrato	
Tipo de IF	SWAP v
Data de Registro	24 06 2014 - 24 07 2014
Pesquisar Limpar Campos Desistir	

Para realizar a consulta o Participante deve preencher, pelo menos, o campo **Data de Registro** e clicar no botão **Pesquisar**. Para maior detalhamento da pesquisa, basta preencher os outros campos da Tela Filtro.

Descrição dos campos da Tela Filtro de Histórico de Informações de Derivativos

Campo	Descrição
Nome Simplificado (Parte)	Nome simplificado da Parte no Contrato.
Parte (Conta)	Código Cetip da Parte no Contrato.
Nome Simplificado (Contraparte)	Nome simplificado da Contraparte no Contrato.
Contraparte (Conta)	Código Cetip da Contraparte no Contrato.
Nome Simplificado (Agente de Cálculo)	Nome simplificado do Agente de Cálculo.
Agente de Cálculo (Conta)	Código Cetip do Agente de Cálculo.
Código do Contrato	Campo de identificação do contrato a ser pesquisado.
Tipo do IF	Caixa de seleção com as opções: SWAP, BOX2, OFCC, OFVC, TCO, TMO e TIN.

Campo	Descrição
Data de Registro	Preenchimento obrigatório. Informar o intervalo ou a data (preencher apenas o primeiro campo) em que as informações do contrato foram atualizadas. A data inicial deve ser menor ou igual a data final, caso contrário o Módulo exibe mensagem de erro.

Tela de Relação

Histórico de Informações de Derivativos											
Página 1 de 3 (Linhas 1 a 25 de 62) Data e Hora da Consulta: 24/07/2014 - 15:15:53											
 Critério de pesquisa											
							Parte				
Data de Registro	Código do Contrato	Tipo de IF	Nome Simplificado (Parte)	Parte (Conta)	Nome Simplificado (Contraparte)	Contraparte (Conta)	Data MTM	Valor MTM	Data Notional	Notional Mínimo (%)	Notional Máximo (%)
23/07/2014 15:48:57	14G00001913	SWAP	RIOBM	05000.00-5	TELB	66661.00-5	23/07/2014	788,00			
23/07/2014 15:39:45	14G00001913	SWAP	RIOBM	05000.00-5	TELB	66661.00-5	23/07/2014	788,00			
23/07/2014 00:03:53	14E00065969	SWAP	RIOBM	05000.00-5	RIOBM	05000.10-8					

<< 1 >> Exibir página

Atualizar Voltar

(continua)

Contraparte								
Data MTM	Valor MTM	Data Notional	Notional Mínimo (%)	Notional Máximo (%)	Nome Simplificado (Agente de Cálculo)	Agente de Cálculo (Conta)	Nome Simplificado (Agente de Cálculo Contraparte)	Agente de Cálculo Contraparte (Conta)
					LEMEBM	10020.00-1		
					LEMEBM	10020.00-1		
23/07/2014	-2.070,21				CETIP	99999.00-5		

(fim)

Na **Tela de Relação** são disponibilizadas, para o Participante, as informações sobre todas as atualizações realizadas pelo Agente de Cálculo e pelo Participante, nos contratos registrados no intervalo de tempo informado.

A consulta pode ser obtida nos formatos excel ou texto, após a seleção do formato desejado clicar no botão **Obter no formato**.

4.3 Contratos sem Atualização no Dia

Menu Informações de Derivativos > Consultas > Contratos sem Atualização no Dia

Visão Geral

Esta consulta possibilita ao Participante e ao Agente de Cálculo, quando for o caso, visualizar os contratos registrados em que, pelo menos, umas das Partes tenham registrado **Curva VCP** e **Tipo/Classe Estratégia**, que não foram atualizados no dia, ou seja, que estão pendentes de inclusão de Valores de Marcação à Mercado e Notional Máximo e Mínimo.

Tela Filtro de Contratos sem Atualização no Dia

Contratos sem Atualização no Dia

Nome Simplificado (Parte)	
Parte (Conta)	- -
Nome Simplificado (Contraparte)	
Contraparte (Conta)	- -
Nome Simplificado (Agente de Cálculo)	
Agente de Cálculo (Conta)	- -
Código do Contrato	14E00059399
Tipo de IF	SWAP
Status	v

Para efetuar a consulta o Participante deve preencher, pelo menos, um campo da Tela de Filtro e clicar no botão **Pesquisar**.

Ao informar o código da **Parte**, por exemplo, o módulo busca todos os contratos pendentes de atualização de Marcação à Mercado e *Notional* deste Participante.

Descrição dos campos da Tela Filtro de Contratos sem Atualização no Dia

Campo	Descrição
Nome Simplificado (Parte)	Nome simplificado da Parte no Contrato.
Parte (Conta)	Código Cetip da Parte no Contrato.
Nome Simplificado (Contraparte)	Nome simplificado da Contraparte no Contrato.
Contraparte (Conta)	Código Cetip da Contraparte no Contrato.
Nome Simplificado (Agente de Cálculo)	Nome simplificado do Agente de Cálculo.
Agente de Cálculo (Conta)	Código Cetip do Agente de Cálculo.
Código do Contrato	Código de identificação do Contrato a ser pesquisado.
Tipo do IF	Campo <i>default</i> , com a opção Swap.
Status	Caixa de seleção para que o Participante informe o tipo de pendente do contrato. Opções: Pendente de MTM, Pendente de <i>Notional</i> e Pendente de MTM e <i>Notional</i> .

Tela de Relação

Contratos sem Atualização no Dia

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)
Data e Hora da Consulta: 24/07/2014 - 15:58:03

 **Critério de pesquisa**

Código do Contrato	Tipo de IF	Data Início	Parte (Conta)	Nome Simplificado (Parte)	Contraparte (Conta)	Nome Simplificado (Contraparte)	Resp. p/ Informação	Nome Simplificado Resp. p/ Informação	Parte	MTM Última Atual.	Data de Aniversário Contrato (Data Vencimento)
14E00059399	SWAP	07/05/2014	05000.00-5	RIOBM	05000.10-8	RIOBM	05000.00-5	RIOBM		07/05/2014	31/12/2014

<< < 1 > >>

Obter no formato:

(continua)

Qtd. Dias sem Atualiz. MTM	Notional Última Atual.	Qtd. Dias sem Atualiz. Notional	Status	Nome Simplificado (Agente de Cálculo)	Agente de Cálculo (Conta)	Nome Simplificado (Agente de Cálculo Contraparte)	Agente de Cálculo Contraparte (Conta)
78	07/05/2014		PENDENTE DE MTM				

(fim)

Nesta **Tela de Relação** podem ser visualizados todos os contratos de um determinado Participante, não atualizados no dia.

O Participante pode clicar no *link* do campo **Código IF**, para detalhar apenas o instrumento financeiro desejado.

A consulta pode ser obtida nos formatos Excel ou texto, após a seleção do formato desejado clicar no botão **Obter no formato**.

4.4 Consulta de Estratégia / Campos Habilitados

Menu Informações de Derivativos > Consultas > Consulta de Estratégia

Visão Geral

Através desta consulta o Participante pode visualizar os **campos habilitados** para determinada estratégia.

Tela Filtro de Consulta de Estratégia

Filtro Consulta de Estratégia

Tipo IF

Nome da Estratégia

Código da Estratégia

Conta

O campo **Conta** é de preenchimento obrigatório, ao preencher apenas este campo, o módulo busca todas as estratégias, mesmo as que não foram vinculadas em algum contrato, do Participante informado. Após informar os campos desejados para filtro de busca, o usuário deve clicar no botão **Pesquisar**.

Observações:

- 1) A Estratégia do contrato é apresentada somente para o Participante que é parte no contrato ou para o Participante que esteja habilitado a utilizá-la; e
- 2) Caso haja mais de um Participante habilitado para uma Estratégia, apenas as informações dos Membros da mesma família de digitação são visualizadas.

Descrição dos campos da Tela Filtro de Consulta de Estratégia

Campo	Descrição
Tipo IF	Caixa de seleção de instrumentos financeiros. Opção: Swap.
Nome da Estratégia	Informar o nome da estratégia que se deseja visualizar os campos habilitados.
Código da Estratégia	Informar o código da estratégia que se deseja visualizar os campos habilitados.
Conta	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a conta Cetip do Participante, ou Membro da Família de Digitação, que está habilitado a utilizar a estratégia a ser consultada ou conta Cetip da Contraparte no contrato no qual a estratégia está vinculada. Este último não precisa estar habilitado para usar a estratégia.

Tela de Relação Consulta de Habilitados por Estratégia

Consulta de Habilitados por Estratégia - Relação

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 12 de 12)
 Data e Hora da Consulta: 24/07/2014 - 16:07:40

 **Critério de pesquisa**

Código da Estratégia	Nome da Estratégia	Conta	Nome Simplificado Participante	Tipo IF
SWP00000460	transf arquivos	05000.00-5	RIOBM	SWAP
SWP00000478	SWAP_CETIP03	05000.00-5	RIOBM	SWAP

<< < 1 > >>

Obter no formato:

Nesta tela, é disponibilizada uma relação das estratégias encontradas através do filtro.

Após clicar em uma estratégia do campo **Código da Estratégia**, o módulo exibe tela para consulta dos campos habilitados.

A consulta pode ser obtida nos formatos Excel ou texto, após a seleção do formato desejado clicar no botão **Obter no formato**.

Tela Manutenção de Estratégia

Manutenção de Estratégia - Registro
Consulta
Código da Estratégia SWP00000460
Nome da Estratégia transf arquivos
Tipo IF SWAP
Delta fator
Campos Habilitados
% Capital Protegido Data Exercício Opção de Compra Data Indicador_4 Ganho sem Knock In Knock In_Indicador_2 Valor Knock Out Valor Máximo Acumulado Empresa Knock Out_Indicador Lastro Pesos dos Indicadores taxa Cupom_2
Voltar Sair

Através desta tela, é possível visualizar todos os campos que estão habilitados. E consequentemente devem ser preenchidos pelo Participante habilitado a utilizar a estratégia e a Contraparte do respectivo contrato de Swap.

4.5 Consulta de Agente de Cálculo, Responsável pela Aceleração e Cláusulas

Menu Informações de Derivativos > Consultas > Consulta de Agente de Cálculo, Responsável pela Aceleração e Cláusulas

Visão Geral

Permite consultar a relação de Instrumentos Financeiros que contam com a indicação da figura de **Agente de Cálculo** e/ou que contam com indicação de **Participante Responsável pela Aceleração de Contrato**.

Esta consulta pode ser efetuada pelas partes envolvidas no instrumento financeiro, pelo **Agente de Cálculo** e pelo **Participante Responsável pela Aceleração**, nomeados pelas partes.

Tela de Filtro de Consulta de Agente de Cálculo e Acelerador

Consulta de Agente de Cálculo e Acelerador - Filtro

Participante (Conta)	05000	.00	5
Contraparte (Conta)	10020	.00	1
Módulo	SWAP		
Código do Instrumento Financeiro			
Tipo do Agente de Cálculo			
Agente de Cálculo (Conta)			
Tipo de Marcação a Mercado			
Tipo de Indicação de Acelerador			
Responsável pela Aceleração (Conta)			
Pesquisar Limpar Campos Desistir			

Descrição dos campos da Tela de Filtro de Consulta de Agente de Cálculo e Acelerador

Campo	Descrição
Para fazer a pesquisa é obrigatório preencher o campo Módulo e mais outro apenas.	
Participante (Conta)	Código Cetip da Parte no Contrato.
Contraparte (Conta)	Código Cetip da Contraparte no Contrato.
Módulo	Módulo de registro do Contrato de Derivativo. Caixa de seleção com as opções: SWAP, OPÇÃO e TERMO.
Código do Instrumento Financeiro	Código de identificação do Contrato a ser pesquisado
Tipo de Agente de Cálculo	Caixa de seleção com as opções: Cetip e Indicar Agente de Cálculo. Na hipótese de ser selecionado a Cetip, o campo Agente de Cálculo (Conta) não deve ser preenchido.
Agente de Cálculo (Conta)	Código Cetip do Agente de Cálculo do Contrato.
Tipo de Marcação a Mercado	Caixa de seleção com as opções: INFORMACIONAL, DRRC e INFORMACIONAL E DRRC.
Tipo de Indicação de Acelerador	Caixa de seleção com as opções: Único e Partes.
Responsável pela Aceleração (Conta)	Código Cetip do Participante Responsável pela Aceleração.

Tela de Relação

Consulta de Agente de Cálculo e de Cláusulas de Aceleração - Relação								
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)								
Data e Hora da Consulta: 14/05/2018 - 15:28:33								
 Critério de pesquisa								
Ação	Participante (Conta)	Razão Social (Parte)	Contraparte (Conta)	Razão Social (Contraparte)	Módulo	Código do Instrumento Financeiro	Tipo de Indicação de Agente de Cálculo	Agente de Cálculo (Conta)
	03092.00-8	TESTE - BANCO HULK	05000.00-5	TESTE - BCO RIO S/A	SWAP	17E00001202	AC UNICO	03092.00-8
	05000.00-5	TESTE - BCO RIO S/A	03092.00-8	TESTE - BANCO HULK	SWAP	17E00001202	AC UNICO	03092.00-8

(continua)

Razão Social (Agente de Cálculo)	Tipo de Marcação a Mercado	Tipo de Indicação de Acelerador	Responsável pela Aceleração (Conta)	Razão Social (Responsável pela Aceleração)
TESTE - BANCO HULK	INFORMACIONAL E DRR			
TESTE - BANCO HULK	INFORMACIONAL E DRR			

(fim)

Nesta **Tela de Relação** é apresentado os dados do agente de cálculo.

O Participante pode clicar no *link* do campo **Código do Instrumento Financeiro**, para detalhar apenas o instrumento financeiro desejado.

Selecionando a opção Consultar Cláusulas de Aceleração no campo **Ação** e clicando no botão , o participante visualiza os dados do responsável pela aceleração, os dados do instrumento financeiro e a cláusula de aceleração do IF.

Para contrato de derivativo com tipo de indicação de acelerador "Partes", os campos, responsável pela aceleração (conta) e responsável pela aceleração (razão social), não são preenchidos.

A consulta pode ser obtida no formato Excel ou texto, após a seleção do formato desejado clicar no botão **Obter no formato**.

4.6 Consulta Dados da Estratégia

Menu Informações de Derivativos > Consultas > Consulta Dados da Estratégia

Visão Geral

Esta consulta possibilita aos Agentes de Cálculo e aos Responsáveis pela Aceleração visualizar os **dados da estratégia** informados para seu(s) respectivo(s) contrato(s).

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

Tela Filtro Dados da Estratégia

Filtro Dados de Estratégia			
Parte (Conta)			
Código da Estratégia			
Código do Contrato	10K00006307		
Pesquisar	Limpar Campos	Desistir	

Descrição dos campos da Tela Filtro Dados da Estratégia

Campo	Descrição
Obrigatório o preenchimento de pelo menos um campo para que a Pesquisa seja efetuada.	
Conta	Informar a conta Cetip do Participante ou Membro da Família de Digitação, que está habilitado a utilizar a estratégia a ser consultada.
Código da Estratégia	Informar o código da estratégia que se deseja consultar os dados informados.
Código do Contrato	Código do contrato que contém a estratégia a ser consultada.

Quando o **Código da Estratégia** não for informado na Tela de Filtro, o módulo exibe tela com a relação de todas as estratégias com dados registrados para os contratos do Participante informado.

Esta tela possui dois *links*:

Código da Estratégia, que direciona a consulta para tela onde estão relacionados todos os contratos vinculados à estratégia selecionada (ver próxima tela); e

Código do Contrato, que direciona a consulta à Tela Características de Contrato de Swap, tela com todos os detalhes do Contrato de Swap selecionado.

A consulta pode ser obtida no formato Excel ou texto, após a seleção do formato desejado clicar no botão **Obter no formato**.

Tela de Relação – Dados da Estratégia de Derivativos

Dados da Estratégia de Derivativos

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)
 Data e Hora da Consulta: 24/07/2014 - 17:57:25

 **Critério de pesquisa**

Código do Contrato	Parte (Conta)	Curva - Parte	Contraparte (Conta)	Curva - Contraparte	Valor Base Remanescente	Data de Registro
10K00006307	10020.00-1	PREFIXADO 360D	05000.00-5	VCP	227.500.000,0000000000	24/05/2010
10K00006307	05000.00-5	VCP	10020.00-1	PREFIXADO 360D	227.500.000,0000000000	24/05/2010

(continua)

Data de Início	Data de Vencimento	Código da Estratégia	Indicador	Principal Fator Risco Ativo do Cliente	Principal Fator Risco Passivo do Cliente
24/05/2010	24/05/2015	SWP00001368	TESTE	INDICE - IBOVESPA	COMMODITY/REAL
24/05/2010	24/05/2015	SWP00001368	TESTE	INDICE - IBOVESPA	COMMODITY/REAL

(fim)

Após clicar no *link* do campo **Código do Contrato**, o sistema apresenta a tela com os detalhes do contrato desejado.

4.7 Consulta de Contratos com Estratégias

Menu Informações de Derivativos > Consultas > Consulta Dados da Estratégia

Visão Geral

Permite que as Partes do Contrato possam visualizar os Contratos de Swap que tenham sido registrados utilizando Estratégia.

Tela de Filtro

Consulta de Contratos com Estratégia - Filtro	
Parte	
Nome Simplificado (Parte)	RIOBM X
Parte (Conta)	- -
Contraparte	
Nome Simplificado (Contraparte)	
Contraparte (Conta)	- -
Características	
Código do Contrato	
Estratégia Pendente de Informações	v
Curva VCP(Parte)	v
Curva VCP(Contraparte)	v
Data de Registro	- -
Contrato(Data de Vencimento)	- -
Confirmar Limpar Campos Desistir	

Após preencher pelo menos um campo para a consulta, clique no botão **Confirmar** para apresentar a Tela de Relação.

Tela de Relação

Consulta de Contratos com Estratégia - Relação

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)

Data e Hora da Consulta: 07/01/2014 - 17:16:29

 Critério de pesquisa

Nome Simplificado (Parte)	Parte (Conta)	Indexador (Parte)	Nome Simplificado (Contraparte)	Contraparte (Conta)	Indexador (Contraparte)	Valor Base
RIOBM	05000.00-5	VCP	LEMEBM	10020.00-1	PREFIXADO 360D	250.000.000,00

Atualizar

Voltar

(continua)

Código do Contrato	Tipo do Contrato	Data Registro	Data de Vencimento	Estratégia Pendente de Informações	Código da Estratégia	Nome da Estratégia
10K00006307	Não Constante	24/05/2010	24/05/2015	Não	SWP00001368	TESTE NEW CED

(fim)

Esta tela possui dois *links*:

Código do Contrato: direciona a consulta para todos os detalhes do Contrato selecionado; e

Código da Estratégia: direciona a consulta para a tela que relaciona os campos habilitados para a Estratégia consultada.

A consulta pode ser obtida nos formatos Excel ou texto, após a seleção do formato desejado clicar no botão **Obter no formato**.

4.8 Consulta de Histórico de Marcação a Mercado

Menu Informações de Derivativos > Consultas > Consulta de Histórico de Marcação a Mercado

Visão Geral

Função que permite ao Agente de Cálculo Parte e Contraparte de um contrato (com ou sem Agenda de Redutor de Risco de Crédito) consultar o histórico dos valores Marcados a Mercado (MtM) dos contratos para os quais tenha sido indicado e/ou que façam parte.

Essa função relaciona as marcações de ambos os tipos: “INFORMACIONAL” e “DRRC”.

Tela de Filtro de Consulta de Histórico de Marcação a Mercado

Consulta de Histórico de Marcação a Mercado	
Código do Contrato	
Tipo de Contrato	
Nome Simplificado Parte	
Parte (Conta)	
Nome Simplificado Contraparte	
Contraparte (Conta)	
Nome Simplificado Agente de Cálculo	
Agente de Cálculo (Conta)	
Tipo de Marcação a Mercado	
Data de registro - Período da MtM	
Pesquisar Limpar Campos Desistir	

Descrição dos campos da Tela de Filtro de Consulta de Histórico de Marcação a Mercado

Campo	Descrição
Código do Contrato	Código do contrato do derivativo original.
Tipo de Contrato	Caixa de seleção com as opções: "Opções Flexíveis", "Swap" e "Termo".
Nome Simplificado Parte	Nome simplificado da Parte no Contrato.
Parte (Conta)	Conta Cetip da Parte do Contrato.
Nome Simplificado Contraparte	Nome simplificado da Contraparte no Contrato.
Contraparte (Conta)	Conta Cetip da Contraparte do Contrato.
Nome Simplificado Agente de Cálculo	Nome simplificado do Agente de Cálculo no Contrato.
Agente de Cálculo (Conta)	Código de conta (Tipo Própria) Cetip do agente de cálculo responsável pela marcação de preço a mercado (MtM).
Tipo de Marcação a Mercado	Campo com as opções "INFORMACIONAL" e "DRRC". Indica o tipo de marcação a mercado realizada para o contrato.
Data de Registro-Período da MtM	Data de registro, período da marcação a mercado do contrato. Formato: DD/MM/AAAA.

Tela de Relação**Consulta de Histórico de Marcação a Mercado**

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 12 de 12)

Data e Hora da Consulta: 14/05/2018 - 15:32:08



Data de Registro	Código do Contrato	Tipo de Contrato	Nome Simplificado Parte	Parte (Conta)	Comitente Parte	Nome Simplificado Contraparte	Contraparte (Conta)	Comitente Contraparte	Nome Simplificado Agente de Cálculo
11/05/2018	17E00001202	Swap	HULKB	03092.00-8		RIOBM	05000.00-5		HULKB
11/05/2018	17E00001202	Swap	RIOBM	05000.00-5		HULKB	03092.00-8		HULKB
11/05/2018	17E00001202	Swap	HULKB	03092.00-8		RIOBM	05000.00-5		HULKB
11/05/2018	17E00001202	Swap	RIOBM	05000.00-5		HULKB	03092.00-8		HULKB

(continua)

Agente de Cálculo (Conta)	Nome Simplificado Agente de Cálculo	Agente de Cálculo (Conta)	Valor MtM	Participante Credor do MtM (Conta)	Participante Credor do MtM (CPF/CNPJ)	Tipo de Marcação a Mercado	Usuário	Data - Hora	Observação
03092.00-8			100,00000000	03092.00-8		DRRC	DSOUSA	11/05/2018 18:53:22	
03092.00-8			-100,00000000	03092.00-8		DRRC	DSOUSA	11/05/2018 18:53:22	
03092.00-8			10,00000000	03092.00-8		DRRC	DSOUSA	11/05/2018 18:51:48	
03092.00-8			-10,00000000	03092.00-8		DRRC	DSOUSA	11/05/2018 18:51:48	

(fim)

Para acessar os detalhes do contrato, basta clicar no *link* exibido no campo **Código do Contrato**.

A consulta pode ser obtida nos formatos Excel ou texto, após a seleção do formato desejado clicar no botão **Obter no formato**.

4.9 Consulta de Agenda/Saldo de Redutor de Risco de Crédito (Periódico/Extraordinário)

Menu Informações de Derivativos > Consultas > Consulta de Histórico de Marcação a Mercado

Visão Geral

Função que permite a **Parte, Contraparte e Agente de Cálculo**, consultar a Agenda/Saldo de Redutor de Risco de Crédito de um contrato, assim como acompanhar o saldo, a agenda, a marcação a mercado (MtM) e o valor financeiro do redutor de risco de crédito durante a vigência do contrato para os quais tenha sido indicado ou que façam parte.

Observações:

- 1) As Operações de redutor de risco de crédito periódicas ou extraordinárias terão seu agendamento apresentado na consulta, porém somente após a sua liquidação financeira serão incorporados financeiramente aos valores de redutor de risco de crédito recebidos pelas partes.
- 2) Os campos "Redutor de Risco de Crédito Recebido pela Parte ou Contraparte", "Saldo de Redutor de Risco de Crédito" e "Credor de Saldo de Redutor de Risco de Crédito" serão inseridos na consulta somente após a liquidação financeira do Redutor de Risco de Crédito.
- 3) O registro de **antecipação (total ou parcial)**, ou qualquer operação que configure a extinção do contrato de Derivativo, vai gerar um ajuste do saldo do DRRC ,com liquidação financeira, pela mesma modalidade de liquidação da operação do contrato original. Para mais informações do cálculo do ajuste do saldo para antecipação parcial, consultar o caderno de fórmulas – DRRC.

Tela de Filtro

Consulta de Agenda / Saldo de Redutor de Risco de Crédito (Periódico / Extraordinário)

Código do Contrato	
Tipo de Contrato	Swap v
Nome Simplificado Parte	RIOBM
Parte (Conta)	05000 00 5
Nome Simplificado Contraparte	LEMEBM
Contraparte (Conta)	10020 00 1
Nome Simplificado Agente de Cálculo	
Agente de Cálculo (Conta)	77785 00 4
Data de registro - Período de Redutor de Risco de Crédito	/ / - / /
Pesquisar Limpar Campos Desistir	

Descrição dos campos da Tela Filtro

Campo	Descrição
Código do Contrato	Código do contrato do derivativo original.
Tipo de Contrato	Caixa de seleção com as opções: "Swap", "Termo" e "Opção".
Nome Simplificado da Parte	Nome simplificado da Parte do contrato.
Parte (Conta)	Conta Cetip da Parte do contrato.

Campo	Descrição
Nome Simplificado da Contraparte	Nome simplificado da Contraparte do contrato.
Contraparte (Conta)	Conta Cetip da Contraparte do contrato.
Nome Simplificado do Agente de Cálculo	Nome simplificado do Agente de Cálculo do contrato.
Agente de Cálculo (Conta)	Conta Cetip do Agente de Cálculo do contrato.
Data de Registro- Período de Redutor de Risco de Crédito	Data do registro. Formato: DD/MM/AAAA

Tela de Relação

Consulta de Agenda / Saldo de Redutor de Risco de Crédito (Periódico / Extraordinário)										
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)										
Data e Hora da Consulta: 24/07/2014 - 17:36:11										
 Critério de pesquisa										
Redutor de Risco de Crédito									Parte	
Código do Contrato	Tipo de Contrato	Data de Redutor de Risco de Crédito	Tipo de Redutor de Risco de Crédito	Valor Financeiro de Redutor de Risco de Crédito	Valor MtM	Valor MtM Ajustado	Duplo Comando para Liquidação	Condição de Valor Financeiro à Liquidar	Parte (Nome Simplificado)	Parte (Conta)
13J00020782	Swap	31/10/2013	Periódico				NÃO	P1 ou P2	RIOBM	05000.00-5
13J00020785	Swap	31/10/2013	Periódico				NÃO	P1 ou P2	RIOBM	05000.00-5

<< 1 >>

Obter no formato:

(continua)

					Contraparte				
Parte (Comitente)	Limite Valor Disparo	Valor Mínimo de Transferência	Redutor de Risco de Crédito Recebido da Parte	Valor de Redutor de Risco de Crédito Corrigido da Parte	Contraparte (Nome Simplificado)	Contraparte (Conta)	Contraparte (Comitente)	Limite Valor Disparo	Valor Mínimo de Transferência
	50.000,00	1.000,00			LEMEBM	10020.00-1		50.000,00	1.000,00
	50.000,00	1.000,00			LEMEBM	10020.00-1		50.000,00	1.000,00

(continua)

Redutor de Risco de Crédito Recebido da Contraparte	Valor de Redutor de Risco de Crédito Corrigido da Contraparte	Agente de Cálculo				Redutor de Risco de Crédito						
		Agente de Cálculo (Conta)	Agente de Cálculo (Nome Simplificado)	Agente de Cálculo (Conta)	Agente de Cálculo (Nome Simplificado)	Saldo de Redutor de Risco de Crédito	Credor de Saldo de Redutor de Risco de Crédito	Percentual de Atualização	Curva	% a.a.	Fator de Atualização do Redutor de Risco de Crédito	Situação de Redutor de Risco de Crédito
		77785.00-4	COPABM					100,00	DI	0,5000	0,0000000000	Não Liquidado
		77785.00-4	COPABM					100,00	DI	0,5000	0,0000000000	Não Liquidado

(fim)

Para acessar os detalhes do contrato, basta clicar no *link* exibido no campo **Código do Contrato**.

A consulta pode ser obtida no formato Excel ou texto, após a seleção do formato desejado clicar no botão **Obter no formato**.

Descrição dos campos da Tela Relação

Campo	Descrição
Código do Contrato	Código do contrato do derivativo original;
Tipo de Contrato	Tipo de contrato de derivativo;
Data do Redutor de Risco de Crédito	Data da ocorrência de Redutor de Risco de Crédito;
Tipo de Redutor de Risco de Crédito	Periódico, extraordinário ou antecipação;
Valor Financeiro de Redutor de Risco de Crédito	Valor do financeiro de liquidação de Redutor de Risco de Crédito. Será preenchido somente após a liquidação financeira do redutor;
Valor MtM	Valor da marcação a mercado registrada na função Marcação a Mercado de IF com o tipo "DRRC";
Valor MtM Ajustado	Valor da marcação a mercado para originar o redutor de risco de crédito abatido do Saldo Corrigido Movimentação dos Ajustes (Parte ou Contraparte);
Limite Valor Disparo (Papel Parte)	Preenchido conforme indicado na função Inclusão de Agenda de Redutor de Risco de Crédito. Indica o valor limite máximo de risco (<i>threshold</i>) aceitável que a Contraparte concede para a Parte.
Limite Valor Disparo (Papel Contraparte)	Preenchido conforme indicado na função Inclusão de Agenda de Redutor de Risco de Crédito. Indica o valor limite máximo de risco (<i>threshold</i>) aceitável que a Parte concede para a Contraparte.
Valor Mínimo de Transferência (Papel Parte)	Indica o valor mínimo (<i>Minimum Transfer Amount - MTA</i>) que deve exceder o <i>threshold da Parte</i> (limite de disparo) para que seja gerado a liquidação financeira.
Valor Mínimo de Transferência (Papel Contraparte)	Indica o valor mínimo (<i>Minimum Transfer Amount - MTA</i>) que deve exceder o <i>threshold da Contraparte</i> (limite de disparo) para que seja gerado a liquidação financeira.
Condição de Valor Financeiro a Liquidar	Indica qual ponta do contrato será favorecida pelo DRRC.

Campo	Descrição
Parte (Conta)	Conta da parte do contrato.
Nome Simplificado Parte	Nome simplificado da parte;
Comitente Parte	CPF/CNPJ do cliente parte;
Redutor de Risco de Crédito Recebido pela Parte	Valor financeiro de ajuste recebido pela Parte na referida data (se tiver ocorrido uma liquidação financeira de fato);
Valor de Redutor de Risco de Crédito Corrigido da Parte	Valor do campo “Redutor de Risco de Crédito Recebido pela Parte” atualizado pelo indexador escolhido no campo “Curva” .
Contraparte (Conta)	Conta da contraparte do contrato;
Nome Simplificado Contraparte	Nome simplificado da contraparte;
Comitente Contraparte	CPF/CNPJ do cliente contraparte;
Redutor de Risco de Crédito Recebido pela Contraparte	Valor financeiro de ajuste recebido pela Contraparte na referida data (se tiver ocorrido uma liquidação financeira de fato);
Valor de Redutor de Risco de Crédito Corrigido da Contraparte	Valor do campo “Redutor de Risco de Crédito Recebido pela Contraparte” atualizado pelo indexador escolhido no campo “Curva” .
Agente de Cálculo	Conta do Agente de cálculo;
Nome Simplificado Agente de Cálculo	Nome simplificado do agente de cálculo;
Saldo Atualizado de Redutor de Risco de Crédito	Valor financeiro do saldo atualizado até o momento da consulta. .
Credor de Saldo Atualizado de Redutor de Risco de Crédito	Conta do Participante credor do saldo financeiro DRRC do redutor na data indicada. Ou seja, indica o Participante que mais recebeu ajustes até a data indicada
Percentual de Atualização	Percentual destacado da curva de atualização de Redutor de Risco de Crédito;
Curva	Curva de atualização do Redutor de Risco de Crédito periódico;
% a.a	Spread sobre a curva de atualização de Redutor de Risco de Crédito;
Fator de Atualização de Redutor de Risco de Crédito	Fator de atualização da curva de Redutor de Risco de Crédito e

Campo	Descrição
Situação de Redutor de Risco de Crédito	Situação do evento de Redutor de Risco de Crédito: ATIVO – Situação dos eventos ativos que estão agendados para datas futuras. AGUARDANDO MARCAÇÃO A MERCADO – Situação aplicada no dia de execução do evento. Indica que o sistema está aguardando o lançamento da Marcação a Mercado (MtM). MARCAÇÃO A MERCADO NÃO REALIZADA – Situação indica que o evento foi finalizado sem Marcação a Mercado (MtM). PROCESSADO SEM FINANCEIRO – Situação indica que o evento foi finalizado após a Marcação a Mercado (MtM). Por conta dos parâmetros da DRRC, valor do MtM e saldo existente na agenda não houve a geração de operação de troca de financeiro entre as partes. AGUARDANDO LIQUIDAÇÃO – Situação aplicada no dia de execução do evento. Indica que o sistema está aguardando a liquidação financeira da operação de redutor de risco de crédito gerada após a Marcação a Mercado (MtM). LIQUIDADO – Indica que o evento foi finalizado após a Marcação a Mercado (MtM), geração da operação de redutor de risco de crédito e posterior liquidação financeira entre as partes. NÃO LIQUIDADO – Indica que o evento foi finalizado com a não liquidação da operação de redutor de risco de crédito que foi gerada após a Marcação a Mercado (MtM).

4.10 Consulta de Saldo Atualizada

Menu Informações de Derivativos > Consultas > Consulta de Saldo Atualizada

Visão Geral

Função que permite ao **Participante** consultar o Saldo Atualizado dos contratos que possuem DRRC.

Tela de Filtro

A interface da tela de filtro para a consulta de saldo atualizado apresenta o seguinte layout:

- Menu de Navegação:** Localizado no topo, com o caminho > Informações de Derivativos > Consultas > Consulta de Saldo Atualizada.
- Barra de Título:** Um cabeçalho verde escuro com o texto "Consulta de Saldo Atualizado" em branco.
- Campos de Filtro:**
 - Parte (Conta):** Campo de entrada com máscara de ponto e vírgula.
 - Contraparte (Conta):** Campo de entrada com máscara de ponto e vírgula.
 - Tipo de Contrato:** Menu suspenso com uma seta para baixo.
 - Código do Contrato:** Campo de entrada livre.
- Botões de Ação:** Localizados na base dos campos, incluindo "Pesquisar", "Limpar Campos" e "Desistir".

Descrição dos campos da Tela FiltroCampo	Descrição
Parte (Conta)	Conta Cetip da Parte do contrato.
Contraparte (Conta)	Conta Cetip da Contraparte do contrato.
Tipo de Contrato	Caixa de seleção com as opções: "Swap", "Termo" e "Opção".
Código do Contrato	Código do contrato do derivativo original.

Tela de Relação

Consulta de Saldo Atualizado

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)

Data e Hora da Consulta: 13/11/2019 - 15:50:21


Critério de pesquisa

Data	Tipo IF	Código do Contrato	Saldo Atualizado do DRRC
13/11/2019	SWAP	19G00002692	4.223,2300000000
13/11/2019	SWAP	19G00003231	3.052,5100000000

Atualizar

Voltar

Descrição dos campos da Tela Relação

Campo	Descrição
Data	Data da Consulta
Tipo IF	Tipo de contrato de derivativo (Swap, Termo ou Opção)
Código do Contrato	Código do contrato do derivativo.
Saldo Atualizado do DRRC	Saldo atualizado do DRRC na data da consulta.

5 INFORMAÇÕES ADICIONAIS

5.1 Regras de Negócios

Abaixo algumas informações sobre o **MID - Módulo de Informações de Derivativos**:

1. A informação de **Marcação à Mercado** deve ser realizada para Contratos de Swap em que pelo menos uma das curvas seja **VCP**.
2. No registro e atualização de Notional Mínimo e Notional Máximo, é necessário que pelo menos uma das partes do Contrato de Swap seja **VCP com Tipo/Classe igual a 73 – Estratégia**.
3. Os registros de Valores de Marcação à Mercado e Notional são **independentes** e de **comando unilateral**;

4. Não há limites quantitativos para informação de Valores de Marcação à Mercado e Notional, desde que seja respeitado o horário de fechamento da grade de registro sem modalidade;
5. As informações de Curvas Marcadas à Mercado de **Contratos de Swap com Reset**, que tenham **Curva VCP** e **Tipo/Classe 73 - Estratégia** devem ser informadas no **Módulo Swap**, para que o Reset seja ativado. Posteriormente esses valores podem ser atualizados pelos Participantes através do MID;
6. Cabe a Cetip aprovar, cadastrar e habilitar determinada **Estratégia** solicitada pelo Participante, para que este a utilize no Registro do Contrato de Swap, no Módulo Swap; e
7. O Registrador, após o registrar o Contrato, com a indicação do Código da Estratégia, no Módulo Swap, deve informar no MID, na função **Registro de Dados de Estratégia**, os respectivos dados, para os campos previamente habilitados pela Cetip. A informação dos dados da Estratégia deve ser realizada, obrigatoriamente, no mesmo dia do registro do contrato. Este procedimento substitui o atual processo de informação realizado por meio do campo **Denominação**, do Módulo Swap, o qual não deve ser preenchido.
8. É permitida a cessão de contratos envolvendo contas de cliente 1 e 2, entretanto não poderão ser objeto de cessão de contrato as operações de Swap para os quais tenha ocorrido indicação de evento de Redutor de Risco de Crédito e que ainda existam eventos programados ou saldo a liquidar.

5.2 Características dos Contratos - Cetip como Agente de Cálculo

Abaixo são apresentadas as características dos Contratos de Derivativos para os quais a Cetip pode ser indicada como **Agente de Cálculo**, por meio da função **Manutenção de Agente de Cálculo**.

Contratos de Derivativos

Tipo de Derivativo	Característica do Contrato
SWAP PAGAMENTO FINAL	Curvas: DI, SELIC, Prefixado (252 ou 360), IGPM, INPC, IGP-DI, TR, TJLP, Dólar, Dólar Comercial Exp, Euro, Franco Suíço, e Iene (com ou sem Cupom Limpo), Ibovespa Liquidação e Libor. Contratos que possuam: Limitadores; Agenda de Prêmio; Opção de Arrependimento; Terceira Curva; Swap com prêmio; Sem funcionalidades. Não estão contemplados os Contratos: Com TR Escolhida; Com funcionalidades não apresentadas acima; e Com % da Curva diferente de 100%, exceto para DI e SELIC.

Contratos de Derivativos

SWAP Fluxo de Caixa Constante	Curvas: DI, Prefixado (252 ou 360), Dólar (com ou sem Cupom Limpo), EURO (Com e sem Cupom Limpo) e EURO-BCE (Com e sem Cupom Limpo). Contratos que possuam: Amortização sobre o Valor Base Original; Juros em dias corridos e meses; Amortização em dias corridos, em meses, na data de vencimento e sem troca de amortização; Agenda de Prêmio Não estão contemplados os Contratos com % da Curva diferente de 100%, exceto para DI.
SWAP Fluxo de Caixa Não Constante	Curvas: DI, Prefixado (252 ou 360), Dólar (com ou sem Cupom Limpo), EURO (Com e sem Cupom Limpo) e EURO-BCE (Com e sem Cupom Limpo). Contratos que possuam: Amortização sobre o Valor Base Original; e Agenda de Prêmio. Não estão contemplados os Contratos com % da Curva diferente de 100%, exceto para DI.
Termo de Índice	Todos os contratos serão passíveis de cálculo.
Termo de Mercadorias	Mercadorias: Alumínio e Cobre; Moedas: Dólar dos EUA, Dólar Australiano, Dólar Canadense, Franco Suíço, Iuan Renmimbi, Coroa Dinamarquesa, Euro, Libra Esterlina, Rupia, Iene, Dólar/Nova Zelândia, Coroa Sueca, Nova Lira/Turquia e Real; Contratos que possuam: Ano de Vencimento preenchido com 2199 ou 2200; e Tipo de Ajuste for Final.
Termo de Moedas	Moedas de Referência/Cotada: Dólar dos EUA, Dólar Australiano, Dólar Canadense, Franco Suíço, Iuan Renmimbi, Coroa Dinamarquesa, Euro, Libra Esterlina, Rupia Indonésia, Rúpia Indiana, Iene, Dólar/Nova Zelândia, Coroa Sueca, Coroa Norueguesa, Nova Lira/Turquia e Real; Não serão calculados contratos com média asiática.

Contratos de Derivativos

Opções Flexíveis - Índice	Índices: Índice DI e Ibovespa; Contratos que possuam: Limite; Barreira (knock in ou knock out) com exercício do tipo Européia; Média asiática simples ou ponderada; Com ou sem cross-rate; Cotação para o vencimento igual a d-1.
Opções Flexíveis - Ações	Contratos que possuam: Limite; Barreira (knock in ou knock out) com exercício do tipo Européia; Média asiática simples ou ponderada; e Cotação para o vencimento igual a d-1.
Opções Flexíveis - Moeda	Moedas de Referência/Cotada: Dólar dos EUA, Dólar Australiano, Dólar Canadense, Franco Suíço, Iuan Renmimbi, Coroa Dinamarquesa, Euro, Libra Esterlina, Rupia Indiana, Iene, Dólar/Nova Zelândia, Coroa Sueca, Coroa Norueguesa, Nova Lira/Turquia e Real; Contratos que possuam: Limite; Barreira (knock in ou knock out) com exercício do tipo Européia; Média asiática simples ou ponderada; Com ou sem cross-rate; Cotação para o vencimento igual a d-1.
Estratégia de Renda Fixa (BOX)	Moedas: Dólar dos EUA, Dólar Australiano, Dólar Canadense, Franco Suíço, Iuan Renmimbi, Coroa Dinamarquesa, Euro, Libra Esterlina, Rupia Indiana, Iene, Dólar/Nova Zelândia, Coroa Sueca, e Real

Abaixo são apresentadas as características dos Instrumentos Financeiros Garantidores, passíveis de estarem em Cesta de Garantias vinculados a Contratos de Derivativos para os quais a Cetip pode ser indicada como **Agente de Cálculo**, por meio da função **Manutenção de Agente de Cálculo**.

Instrumentos Financeiros Garantidores

Tipo de Instrumento Financeiro	Característica do Instrumento Financeiro
---------------------------------------	---

Instrumentos Financeiros Garantidores

CDB – Certificado de Depósito Bancário e
DI – Depósito Interfinanceiro

Indexadores: IGP-M, IGP-DI, INPC, IPCA, DI, SELIC e PREFIXADO;

Ativos que possuam Juros expressos em meses e sem Amortização.

Não estão contemplados CDB's/DI's que possuam as seguintes condições:

Múltiplas Curvas e Escalonamento;

Pagamento de Juros e Amortizações Periódicos;

Pagamento de Amortização Periódica e Juros no Vencimento;

Pagamento de Amortização sem Taxa de Juros;

Registro Simplificado Prefixado Final;

No Fluxo de Pagamento de Juros, no campo Periodicidade de Juros não pode estar variável e no campo Juros a Cada não pode estar dia;

Incorpora Juros preenchidos com Sim;

Tipo de Correção preenchido com Número índice segundo mês anterior; e

Campo Critério de Cálculo de Juros não pode estar preenchido: 252 – número meses entre a data de início ou último pagamento e o próximo x 21, 360 – número meses entre a data de início ou último pagamento e o próximo x 30 ou 365 – número meses entre a data de início ou último pagamento e o próximo x 30.

LF - Letra Financeira

Indexadores: IGP-M, IGP-DI, INPC, IPCA, DI, SELIC e PREFIXADO;

Ativos que possuam Juros expressos em meses e sem Amortização.

Não estão contemplados LF's que possuam as seguintes condições:

Múltiplas Curvas e Escalonamento;

Pagamento de Juros e Amortizações Periódicos;

Pagamento de Amortização Periódica e Juros no Vencimento;

Pagamento de Amortização sem Taxa de Juros;

Registro Simplificado Prefixado Final;

No Fluxo de Pagamento de Juros, no campo Periodicidade de Juros não pode estar variável e no campo Juros a Cada não pode estar dia;

Incorpora Juros preenchidos com Sim;

Tipo de Correção preenchido com Número índice segundo mês anterior; e

Campo Critério de Cálculo de Juros não pode estar preenchido: 252 – número meses entre a data de início ou último pagamento e o próximo x 21, 360 – número meses entre a data de início ou último pagamento e o próximo x 30 ou 365 – número meses entre a data de início ou último pagamento e o próximo x 30.

Instrumentos Financeiros Garantidores

Título SELIC	LFT, LFT-A, LFT-B, LTN, NTN-A, NTN-B, NTN-C, NTN-D, NTN-E, NTN-F, NTN-H, NTN-I, NTN-L, NTN-M, NTN-P, NTN-R, NTN-S e NTN-U.
Debênture	Indexadores: IGP-M, IGP-M, IPCA e DI; Ativos que possuam Juros e Amortização.

5.3 Metodologia de Cálculo de Valores Financeiros para liquidação

Consulte o Caderno de Fórmulas, no item Documentação Técnica, no site da B3 (http://www.b3.com.br/pt_br/)

6 GLOSSÁRIO

A

Acelerador de Contratos: Participante Cetip responsável por monitorar a ocorrência de eventos, ou seja, as Cláusulas de Aceleração.

Agente de cálculo: Participante Cetip, responsável por calcular o valor de mercado do contrato de derivativos e/ou das garantias a ele vinculadas.

E

Estratégia: Conjunto de variáveis que não podem ser determinadas num único indexador.

M

MtM: Marcação a Mercado - procedimento de se ajustar o preço de um ativo existente na carteira à cotação de mercado, ajustando o seu valor a nova realidade.

N

Notional Máximo: Percentual máximo do valor base sobre o qual o ajuste da operação pode ser calculado.

Notional Mínimo: Percentual mínimo do valor base sobre o qual o ajuste da operação pode ser calculado.

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).