MANUAL DE OPERAÇÕES DERIVATIVOS DE BALCÃO

SISTEMA DE REGISTRO ADMINISTRADO PELA BM&FBOVESPA

VERSÃO: **3.0**

ÚLTIMA MODIFICAÇÃO: **06/04/2015**

Índice

1. INTRODUÇÃO 7

1.1. SISTEMA DE REGISTRO DE DERIVATIVOS DE BALCÃO - IBALCÃO 7
1.2. ACESSO AO SISTEMA 7

2. REGISTRO DE OPERAÇÕES 11

2.1. INTRODUÇÃO 11
2.2. CONTRATO A TERMO DE TAXA DE CÂMBIO 12
2.3. TELA DE REGISTRO DE OPERAÇÕES DE TERMO DE MOEDAS: 13
2.4. CONTRATO DE SWAP 19
2.5. TELA DE REGISTRO DE OPERAÇÕES DE SWAP: 19

3. EVENTOS 24

3.1. LIQUIDAÇÃO ANTECIPADA 24
3.2. CORREÇÃO 35
3.3. ANULAÇÃO 37
3.4. CANCELAMENTO 39
3.5. REGISTRO E EVENTOS POR ARQUIVO 39
3.6. ARQUIVO DE RETORNO 40
3.7. TRANSFERÊNCIA DE CONTA E POSIÇÃO 43
3.8. CESSÃO DIREITO 43
3.9. BROKERAGEM 43

4. OPERAÇÕES 46

4.1. CONSULTA DE MOVIMENTAÇÕES 46
4.2. CONSULTA DE OPERAÇÕES 50
4.3. CONSULTA DE LANÇAMENTOS PENDENTES 53
4.4. DOWNLOAD DE RELATÓRIOS E ARQUIVOS 54

5. ANEXOS 56

Anexo I - Moedas Base e Fontes de Informação 56
Anexo II - Moedas e Tipos de Cotação para NDF sem CCP 59
Anexo III – Combinações de Contratos disponíveis 61
Anexo IV - Indexadores e Fontes de Informação/Boletim 61

Histórico de Versões

Data	Versão	Descrição
15/07/2013	1.0	• Versão inicial
29/09/2014	2.0	• Inclusão de novas funcionalidades no Sistema de Derivativos de Balcão: ○ Correção por tela. ○ Inclusão da tela de "Download de Relatórios"; ○ Inclusão de Liquidação Antecipada por arquivos e possibilidade de liquidar através do "Valor Financeiro em BRL" por tela. ○ Alteração na estrutura de contas (obrigatório informar o número da conta para Parte e Contraparte envolvida na operação) ○ Alteração na tela de pesquisa de eventos; ○ Melhoria na tela de retorno de arquivos.
10/02/2015	3.0	• Inclusão de novos eventos/funcionalidades disponíveis no Sistema de Derivativos de Balcão: ○ Registro Swap ○ Anulação ○ Transferência ○ Cessão Direito ○ Brokeragem

Nota

A BM&FBOVESPA divulgará as atualizações no site com eventuais revisões nos capítulos, sempre que necessário.

O suporte às instituições envolvidas nesse processo, como questões relativas a suporte técnico, será dado pela APN - Atendimento Pós Negociação da BM&FBOVESPA - Telefone: **(+55 11) 2565-5000 opção 3 (pós negociação)** ou e-mail: apn@bvmf.com.br

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Registro no telefone: (+55 11) 2565-4646 ou e-mail: **derivativos-balcao@bvmf.com.br-**

Site: www.bmfbovespa.com.br/balcao

Abreviações

BVMF	Bolsa de Valores, Mercadorias & Futuros.
CCP	Contraparte Central.
CP	Contraparte.
IF	Instituição Financeira.
MtM	Marcação a Mercado "Mark to Market"
ME	Moeda Estrangeira
NDF	Non-Deliverable Forward (Termo de Moeda).
MEBRL	Taxa de câmbio de reais por uma moeda estrangeira
SWAP	Derivativo financeiro que tem por finalidade promover simultaneamente a troca de ativos financeiros entre agentes econômicos.

Glossário

BM&FBOVESPA	BM&FBOVESPA S.A. – Bolsa de Valores, Mercadorias e Futuros.
Contraparte	Participante ou cliente contraparte da operação.
Comando Simples	Inclusão única por parte do Participante dos dados da operação com seus clientes não Participantes do Sistema de Registro - iBalcão.
Duplo Comando	Inclusão dos dados da operação por ambas as partes, sendo esta realizada entre dois Participantes do Sistema de Registro - iBalcão.
Garantia	A liquidação financeira da operação registrada no sistema de registro é garantida pela BM&FBOVESPA.
Matching	É o processo pelo qual o sistema confronta automaticamente as informações fornecidas pelas partes em operação de duplo comando. O *matching* é realizado para assegurar que as partes envolvidas na operação não registrem informações divergentes no sistema de registro.
MtM	Marcação a Mercado da operação calculada pela Bolsa com base em preços de mercado.

Parte	É a parte na operação, responsável ou não pelo registro, ou seja, podendo ser efetuado por ele mesmo ou um Participante de Registro Autorizado.
Participante de Registro	Participante detentor de autorização de acesso para Registro de Ativos e Operações, conforme o Regulamento.
iBalcão	Sistema informatizado para o Registro de Operações de derivativos de balcão administrado pela BM&FBOVESPA.
Operação	Transação ou negócio previamente realizado por um Participante de Registro e seu respectivo cliente ou por dois Participantes de Registro, conforme o Regulamento.
Registro	Inserção de dados relativos aos Ativos e às Operações com finalidade meramente informativa, conforme o Regulamento.
Regulamento	Regulamento da Câmara de Registro, Compensação e Liquidação de Operações de Derivativos BM&F, assim como o Manual de Procedimentos Operacionais e as demais normas estabelecidas pela Câmara;
Posição	Conjunto de Registros de responsabilidade de um determinado Participante de Registro.
Paridade Internacional	Taxa de cotação envolvendo apenas moedas estrangeiras
Entrega física	Liquidação física que exige a efetiva entrega do ativo objeto da negociação
Ativo subjacente	Combinação de Moeda base e moeda cotada indicada na operação.
Moedas Tipo "A"	Quantidade de moeda estrangeira por uma unidade de dólar dos Estados Unidos da América (Ex.: USDCAD - Dólares canadenses por dólar dos Estados Unidos da América);
Moedas Tipo "B"	Quantidade de dólares dos Estados Unidos da América por uma unidade de moeda estrangeira (Ex.: EURUSD - Dólares dos Estados Unidos da América por Euro).

1. Introdução

1.1. Sistema de Registro de Derivativos de Balcão - iBalcão

O iBalcão é a nova plataforma de registro e gerenciamento de operações de balcão via web que visa modernizar, aperfeiçoar e expandir o serviço de registro de operações de balcão, oferecendo qualidade e agilidade aos clientes, bem como ferramentas completas de análise para atividades de *Back Office*. Suas ferramentas e funcionalidades permitem aos usuários:

- Registrar operações de Derivativos de Balcão;
- Realizar consultas unificadas das operações realizadas no dia e consulta de posições em aberto, auxiliando no gerenciamento e no controle da posição de seus clientes;

  Comandar eventos de Registro, Correção; Liquidação Antecipada parcial e/ou total; Anulação de Registro; diretamente pelo sistema ou

Os eventos de Transferência de Conta, Cessão de Direito, Correção após D+1 e Transferência de Posição são realizados somente pela BVMF.

1.2. Acesso ao Sistema

Pré-Requisitos

Requisitos de Hardware:

- Processador: 1 gigahertz (GHz) ou superior;
- 1GB de memória RAM;
- 10GB de espaço livre em HD;
- Placa de rede Fast Ethernet de 100Mbps ou superior.
- Placa gráfica e monitor com resolução mínima de 1366x768

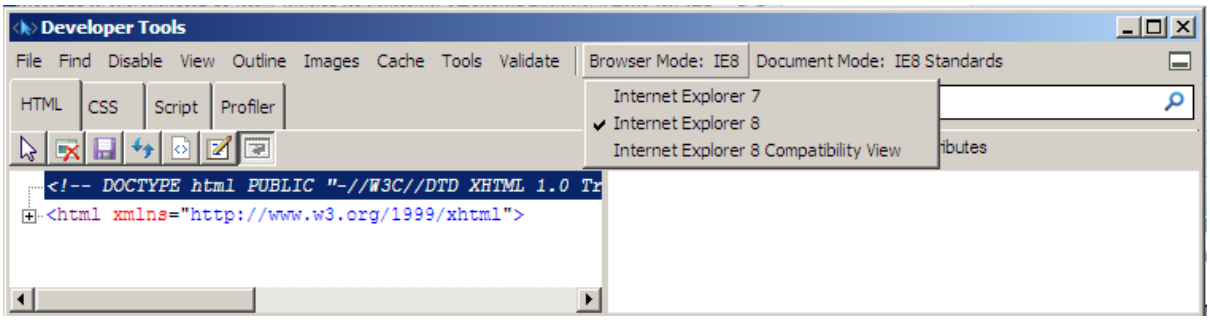
Requisitos de Software:

- Sistema operacional MS Windows 7 ou superior;
- Microsoft Internet Explorer 9, com modo de compatibilidade desligado;
- Microsoft Internet Explorer 10;
- Microsoft Internet Explorer 11;
- Firefox;
- Chrome.

Para acessar ao iBalcão, digite o endereço abaixo no seu browser:

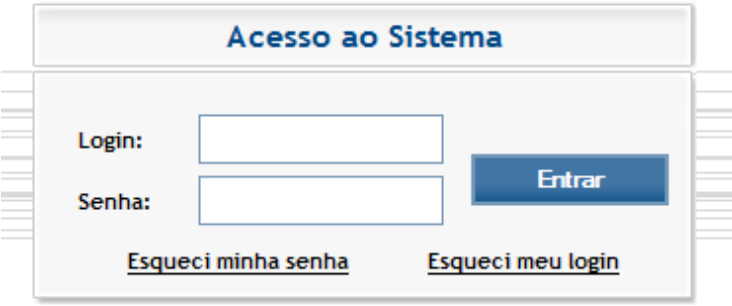
https://ibalcao.bvmfnet.com.br

Nota: No Internet Explorer 9 ou outros, confirmar em "Developer Tools" se a versão do "Browser Mode" está configurada para o modo IE8. Para acessar essa informação, basta pressionar a tecla F12 no Internet Explorer e a tela abaixo será apresentada:



Caso essa configuração não seja realizada, as telas do iBalcão poderão apresentar inconformidades de alinhamento e posicionamento dos campos durante a navegação.

Para efetuar o login de acesso os campos de usuário e senha deverão ser preenchidos:



Usuário: Campo para identificação do Usuário**.**

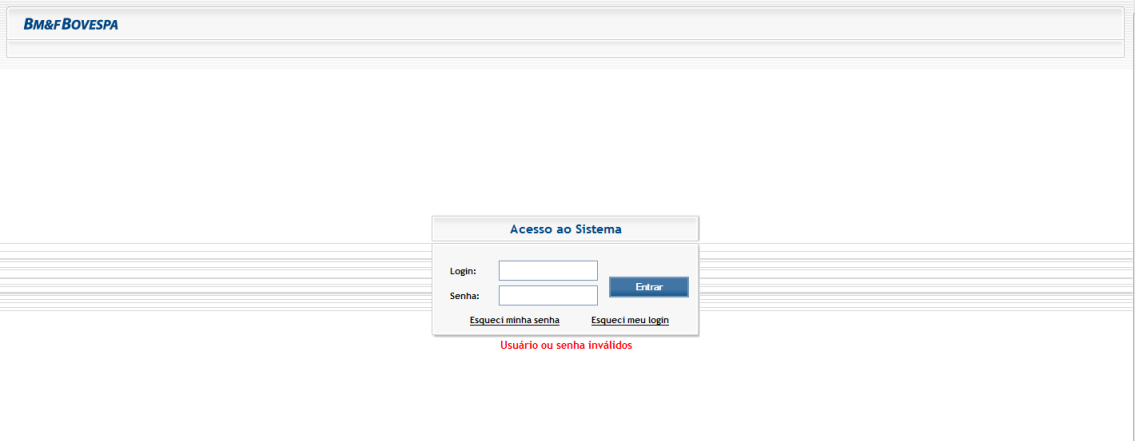
Senha: Código de acesso do Usuário. A senha é do tipo "Sensitive Case", aceita letras maiúsculas, minúsculas, números e caracteres especiais conferindo a sequência exata digitada.

O usuário e senha serão criados pelo próprio Participante (Usuário Privilegiado) no sistema de Controle de Acesso (CAU) da BMF&BOVESPA**.**

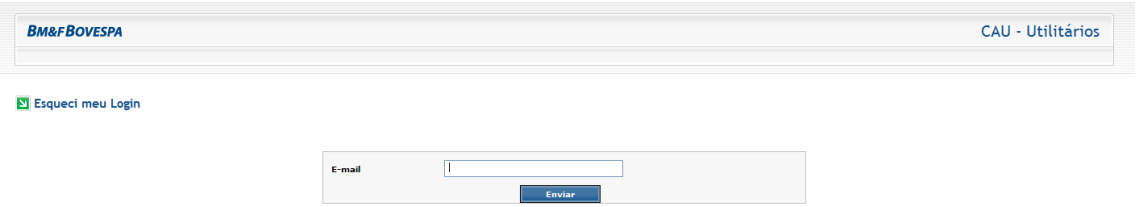
Para maiores informações acessar o Manual do Usuário – Controle de Acesso Unificado (CAU) disponível no site www.bmfbovespa.com.br/balcao.

Após o fornecimento das credenciais e validação das mesmas, o sistema apresentará a tela inicial, onde os menus representam as funcionalidades descritas nas próximas sessões.

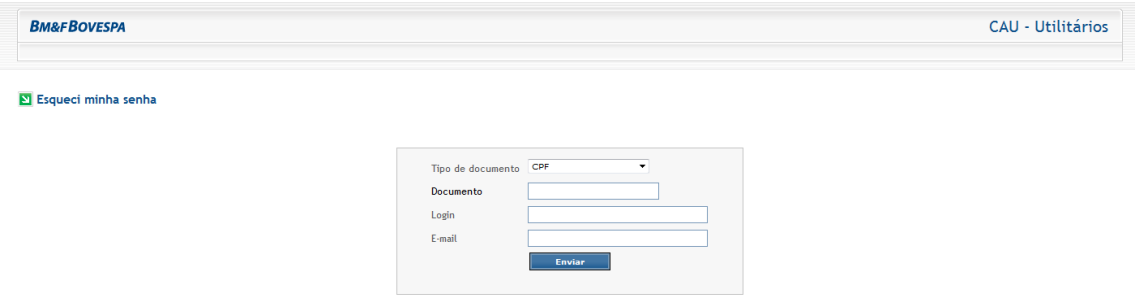
Se for apresentada mensagem "Usuário ou senha inválidos" o usuário pode acessar os links "Esqueci minha senha" ou "Esqueci meu login".



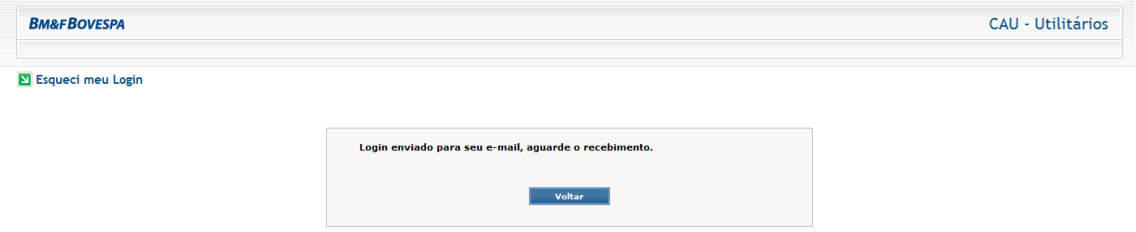
Se o usuário selecionar "Esqueci meu login" será apresentada uma tela para que insira o email cadastrado.



Caso o usuário selecione "Esqueci minha senha" será apresentada uma tela para que insira um documento, podendo ser o CPF ou CNPJ; o número do documento informado; o login de acesso e e-mail cadastrado.



Após preenchimento das informações solicitadas, será apresentada uma tela informando que o login foi enviado para o e-mail cadastrado.



Em caso de não recebimento do e-mail informado, o usuário deverá entrar em contato com a CAU - Central de Atendimento ao Usuário, no telefone (11) 2565-5000 (opção 3).

2. Registro de Operações

2.1. Introdução

O registro de uma operação no Sistema iBalcão somente poderá ser efetuado por um Participante de Registro conforme regras discriminadas no Manual de Acesso da BM&FBOVESPA, que dispõem das condições de acesso de Participante de Registro de Derivativos de Balcão sem garantia e/ou Participante de Registro de Derivativos de Balcão com garantia.

Para que o registro possa ser realizado, será necessário, inicialmente, que o Participante de Registro cadastre suas contas no sistema de cadastro da BM&FBOVESPA – SINCAD, individualmente por tela ou em lote por arquivo.

Dúvidas no procedimento do cadastro de contas poderão ser esclarecidas com a área de Cadastro no telefone: (011) 2565-5621 ou pelo e-mail cadastro@bvmf.com.br.

As contas cadastradas pelo Participante de Registro (inclusive as de fundos) serão automaticamente identificadas e disponibilizadas no sistema iBalcão no momento do cadastramento da conta no sistema SINCAD

São dois os conceitos para o Registro das operações no iBalcão:

- **Registro Comando Simples** - Operação realizada entre Participante e seu cliente. O registro é feito pelo Participante ou por um Participante de Registro Autorizado por este a registrar em seu nome.
- **Registro Duplo Comando** – Operação realizada entre dois Participantes. O registro deverá ser feito no Sistema iBalcão por ambas as partes e, após o confronto automático das informações (*matching*) a solicitação de registro é efetivada com sucesso.

O Código de identificação da operação gerado pelo sistema é composto por 9 dígitos, conforme detalhamento abaixo:

DD = Dia corrido do ano, na data de registro da operação (não apresenta o primeiro dígito). NNNNNNN = Número Sequencial.

2.2. Contrato a Termo de Taxa de Câmbio

Refere-se a um contrato de compra e venda de uma determinada quantidade de moeda sem entrega física em uma data futura acordada entre as partes, cuja liquidação financeira é determinada pela diferença entre a taxa de câmbio ou paridade acordada, e a taxa de câmbio ou paridade verificada na data de *fixing*, de acordo com a fonte de informação do objeto de registro da operação, multiplicado pelo Valor Base e convertido sempre para Reais.

O tamanho, a data de vencimento, data de *fixing*, data de liquidação e a fonte de informação para a taxa de liquidação do contrato são livremente pactuados entre as partes desde que estejam disponíveis no Sistema iBalcão, conforme relação constante do Anexo I e Anexo II deste manual.

O contrato a termo de taxa de câmbio sem entrega física pode ser registrado nas seguintes modalidades:

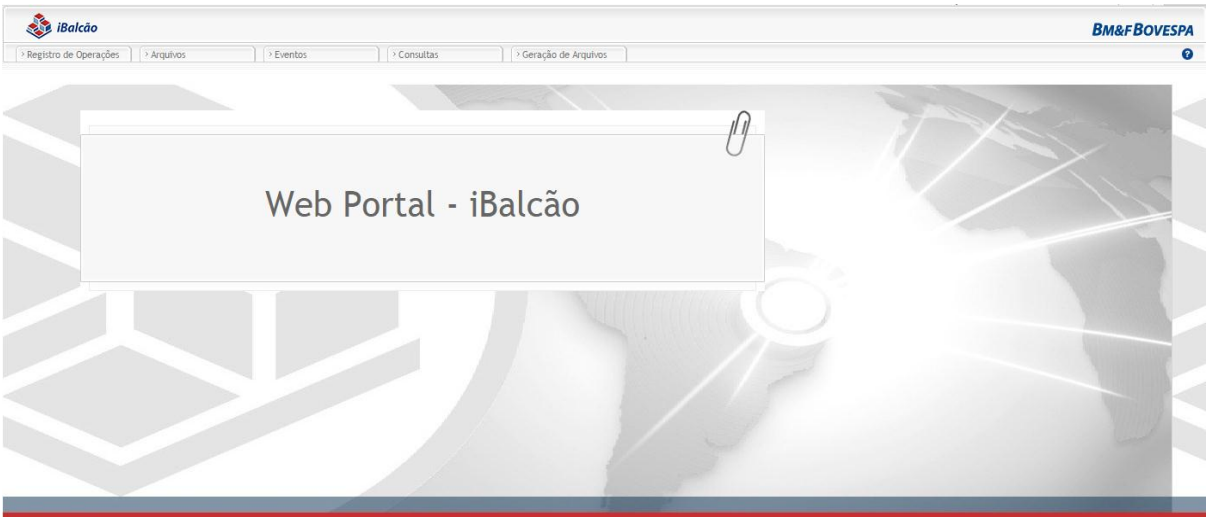
- **Taxa de Câmbio Simples:** Contrato com vigência imediata, cujo ativo subjacente é a taxa de câmbio de reais por uma moeda estrangeira (MEBRL) ou vice-versa de acordo com a Paridade internacional da cotação;
- **Paridade Simples:** Contrato com vigência imediata, cujo ativo subjacente pode ser através de paridade de moedas do Tipo “A” ou paridade de moedas Tipo “B”;

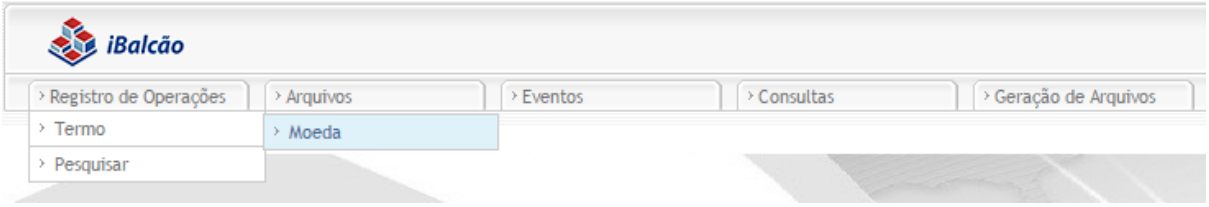
Cada modalidade oferece diferentes combinações de moedas e provedores de informação pública, cujas possibilidades são descritas nas próximas sessões (Vide Anexo I e Anexo II). Em caso de não haver a moeda de referência, combinação de moedas, fonte de informação ou boletim, objeto de negociação do participante, o mesmo deverá entrar em contato com a BM&FBOVESPA para análise, através do e-mail derivativos-balcao@bvmf.com.br.

As regras e condições referentes ao produto encontram-se disponíveis na rede mundial de computadores, através do site http://www.bmfbovespa.com.br/pt-br/servicos/servicos-de-pos-negociacao/ibalcao/derivativos.asp.

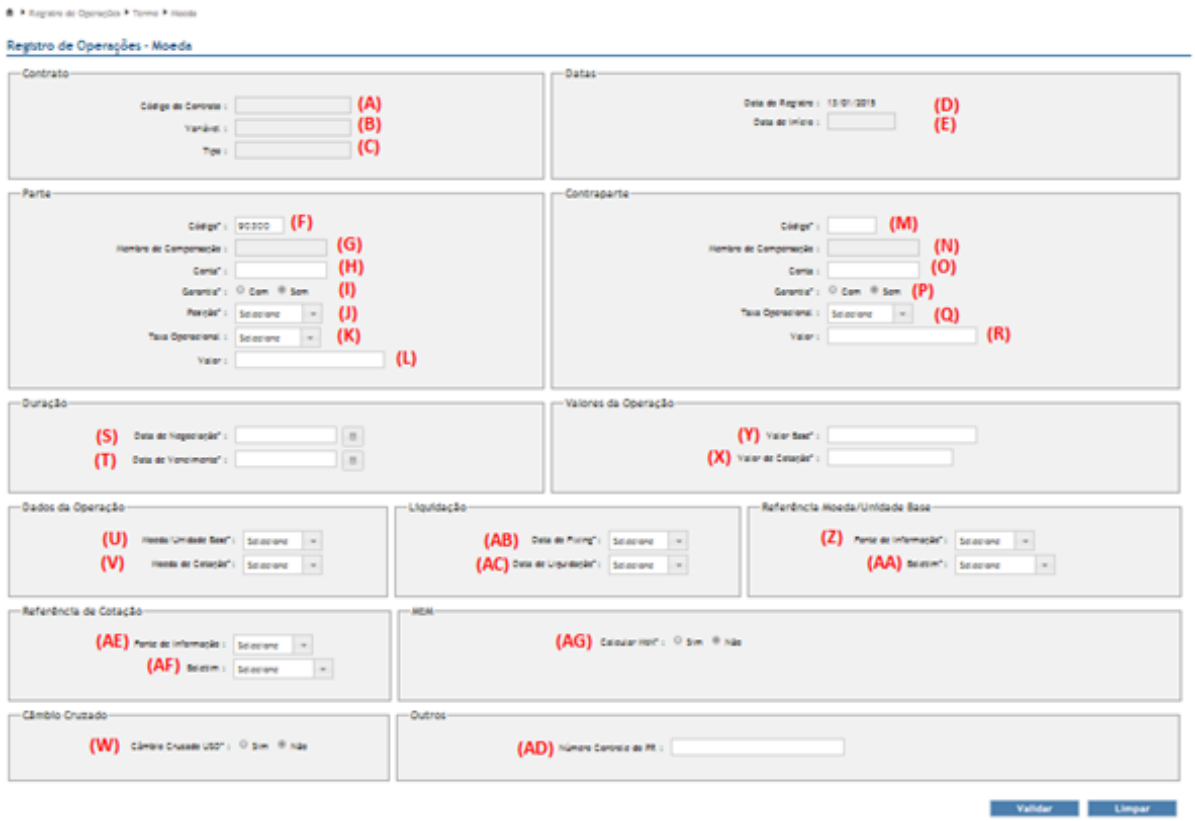
2.3. Tela de Registro de Operações de Termo de Moedas:

O registro manual da operação deverá ser realizado através do menu “Registro de Operações” – Termo – Moeda, conforme a ilustração abaixo:





Após selecionado “Moeda”, o sistema exibe a tela de registro com os campos disponíveis para preenchimento, conforme ilustração a seguir:



Todos os campos com asterisco (*) são obrigatórios.

Ref. Moeda / Unidade Base	
(A) Código do Contrato	**Não disponível nesta fase** **Indicar o código do contrato para registro, seguindo contratos disponíveis para registro.**
(B) Variável	**Não disponível nesta fase** Indicar a moeda de registro, valido somente para operações com garantia em pelo menos uma das partes.
(C) Tipo	**Não disponível nesta fase** Indicar o tipo de fonte de informação e boletim que serão utilizados para cálculo de vencimento da operação.
(D) Data do Registro	Data em que a operação foi registrada no sistema. Este campo não é editável, informado automaticamente pelo sistema.
(E) Data de Início	Dia útil em que se inicia o contrato a Termo. Para Termo simples, esta data sempre é igual à data de registro, informado automaticamente pelo sistema.
(F) Código	Indica o código no sistema de cadastro BM&FBOVESPA do Participante de Registro "Parte" da Operação.

(G) Membro de Compensação	Indica o código do Membro de Compensação do Participante de Registro "Parte" da operação, informado no sistema SINCAD. Preenchido default.
(H) Conta	Indica o número da conta própria ou do cliente que é Parte na operação.
(I) Garantia	Indica se a Parte solicita garantia da Contraparte.
(J) Posição	Indica se a Parte é Compradora ou Vendedora na operação.
(K) Taxa Operacional	Indica a forma de cobrança da taxa operacional da parte da operação. Valor meramente informativo. **Opções:** P - percentual V- valor
(L) Valor	Indica o valor/percentual cobrado pela parte operação.
(M) Código	Indica o código no sistema de cadastro BM&FBOVESPA do Participante de Registro "Contraparte" da Operação
(N) Membro de Compensação	Indica o código do Membro de Compensação do Participante de Registro "Contraparte" da operação, informado no sistema SINCAD. Preenchido default.
(O) Conta	Indicar o número da conta do cliente que é Contraparte na operação. Este campo não deverá ser informado para operações de duplo comando.
(P) Garantia	Indica se Contraparte solicita garantia da Parte
(Q) Taxa Operacional	Indicar a forma de cobrança da taxa operacional da contraparte da operação. Valor meramente informativo. **Opções:** P - percentual V- valor
(R) Valor	Indicar o valor/percentual cobrado pela contraparte operação.
(S) Data de Negociação	Data do inicio do contrato pactuada entre as partes. Esta data deverá ser dia útil. **Termo sem CCP:** poderá ser retroativa em até três dias da data de registro sendo este anterior à data do fixing. **Termo com CCP:** não permite registro com data retroativa.
(T) Data de Vencimento	Data de maturidade do contrato (T) respeitando o prazo mínimo de dois dias úteis e prazo máximo de 5.580 dias corridos após a data do registro.
(U) Moeda/Unidade Base	Moeda objeto do Contrato a Termo. Exemplo: para taxa de câmbio de reais por uma unidade de Dólar dos Estados Unidos da América (USDBRL), a moeda base é o Dólar dos Estados Unidos

	da América.
(V) Moeda de Cotação	Moeda pela qual será cotada a moeda base objeto do Contrato a Termo. Exemplo: para taxa de câmbio de reais por uma unidade de Dólar dos Estados Unidos da América (USDBRL), a moeda cotada é o Real.
(Y) Valor Base	Valor Nocional da operação expresso em quantidade de moeda base, respeitando o valor mínimo equivalente à $ 1.000,00 e valor máximo de $ 10.000.000.000,00 com até 2 (duas) casas decimais.
(X) Valor de Cotação	Para registros de Termo de Moedas, o objeto de registro será uma taxa de câmbio ou paridade, com até 8 casas decimais.
(W) Câmbio Cruzado USD	**Opções: SIM ou NÃO** **Termo sem CCP:** opção de fixing disponível para qualquer taxa de câmbio para reais, exceto USDBRL. Ao selecionar esta opção, o Participante terá o contrato a termo de moeda liquidado pelo câmbio cruzado entre a paridade da moeda base e a taxa de câmbio de Reais por MOEDA COTADA Exemplo: taxa de câmbio de reais por euro (EURBRL) pode ter o preço de liquidação apurado pela multiplicação entre a paridade de dólares dos Estados Unidos por Euro (EURUSD) e a taxa de câmbio de reais por dólar dos Estados Unidos (USDBRL), de forma a se obter a taxa de câmbio de reais por euro (EURBRL), objeto de registro do termo. As opções possíveis para a fonte de informação e boletim do Câmbio Cruzado estão contidas na lista de Moedas e Taxas de Câmbio no Anexo I deste manual. **Termo com CCP:** não permite Câmbio Cruzado.

Ref. Moeda / Unidade Base	
(Z) Fonte de Informação	**Nome do veículo oficial responsável pela divulgação do valor da moeda ou unidade base que está sendo registrada.**
(AA) Boletim	Boletim/horário do veículo oficial na qual serão publicados os valores negociados da moeda Base

Ref. Cotação	
(AE) **Fonte de Informação**	**Nome do veículo oficial responsável pela divulgação do valor da moeda cotada. (Habilitado para preenchimento somente se o campo Câmbio Cruzado for igual a "Sim")**
(AF) **Boletim**	Boletim/horário do veículo oficial na qual serão publicados os valores negociados da moeda cotada. (Habilitado para preenchimento somente se o campo Câmbio Cruzado for igual a "Sim")

Liquidação	
(AB) **Data do Fixing**	**Data da observação do preço de liquidação da taxa de câmbio ou paridade, objeto do Contrato a Termo. Essa data deverá ser dia útil e após a data de negociação.** **Termo sem CCP: deve estar compreendida entre o primeiro (T-1),e o quinto dia útil (T-5) anterior ao vencimento.** **Termo com CCP: SOMENTE em T-1.**
(AC) **Data da Liquidação**	Data do fluxo financeiro da liquidação. **Termo sem CCP:** deve estar compreendida entre a data de vencimento (T) e o dia útil seguinte (T+1), conforme contrato pactuado entre as partes. **Termo com CCP:** SOMENTE em T+0.
(AD) **Número de Controle Interno**	Campo de uso livre do Participante para informar um número de controle interno da operação na instituição.
(AG) **Calcula MtM**	**Opções: SIM ou NÃO** Se escolhido a opção "sim", a operação registrada será marcada a mercado diariamente pela metodologia e preços divulgados pela BM&FBOVESPA e disponibilizado no relatório de MtM para o Participante. **Permitido somente para operação de Termo sem CCP.**

Comandos disponíveis na tela:

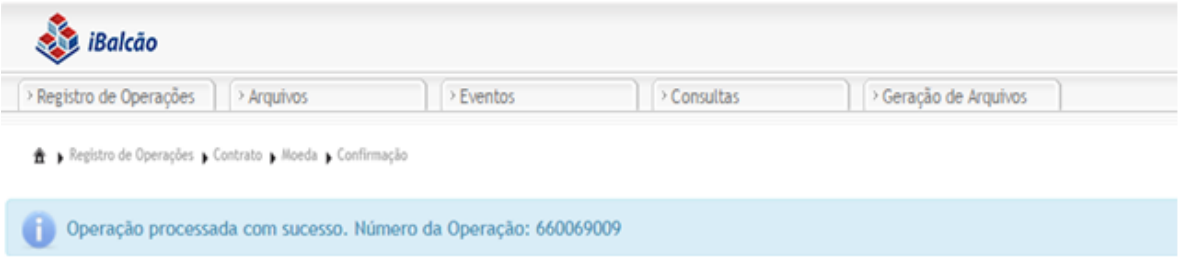
VALIDAR: Submete as informações para checagem primária da operação.

LIMPAR: Recarrega e inicializa a tela com todos os campos em branco a serem preenchidos.

ENVIAR: Submete ao efetivo registro no sistema, após a confirmação das informações da operação.

VOLTAR: Se houver algo incorreto nas informações, clicar em voltar para retornar à tela anterior.

Em operação entre Participante e seus clientes (comando simples), caso nenhuma informação seja invalidada, o sistema gera o número de identificação da Operação.



Em operação entre dois Participantes (duplo comando) após o registro do primeiro comando o sistema gera um número de protocolo até que a contraparte lance o segundo comando.

Somente após o confronto automático das informações o sistema gera o número de identificação da Operação, confirmando o registro da operação.

Caso haja divergência entre as informações fornecidas por cada Participante, o registro ficará com status pendente na tela de ”Consulta – Lançamentos Pendentes” (maiores detalhes no item de ‘Lançamentos pendentes’) até que seja realizado o lançamento com as informações corretas pela parte responsável. Caso o *matching* do lançamento não ocorra no dia do registro, o mesmo será rejeitado ao encerramento do sistema.

2.4. Contrato de SWAP

Trata-se de um contrato de derivativo financeiro que tem por finalidade promover simultaneamente a troca de rentabilidade entre ativos financeiros acordados entre as partes. Na data de vencimento as diferenças entre os ativos financeiros são confrontadas e o valor de liquidação é dado pela diferença entre as duas curvas.. O tamanho, a data de vencimento, data de *fixing*, data de liquidação e a fonte de informação para a liquidação do contrato são livremente pactuados entre as partes desde que estejam disponíveis no Sistema iBalcão, conforme relação constante do Anexo III e Anexo IV deste manual.

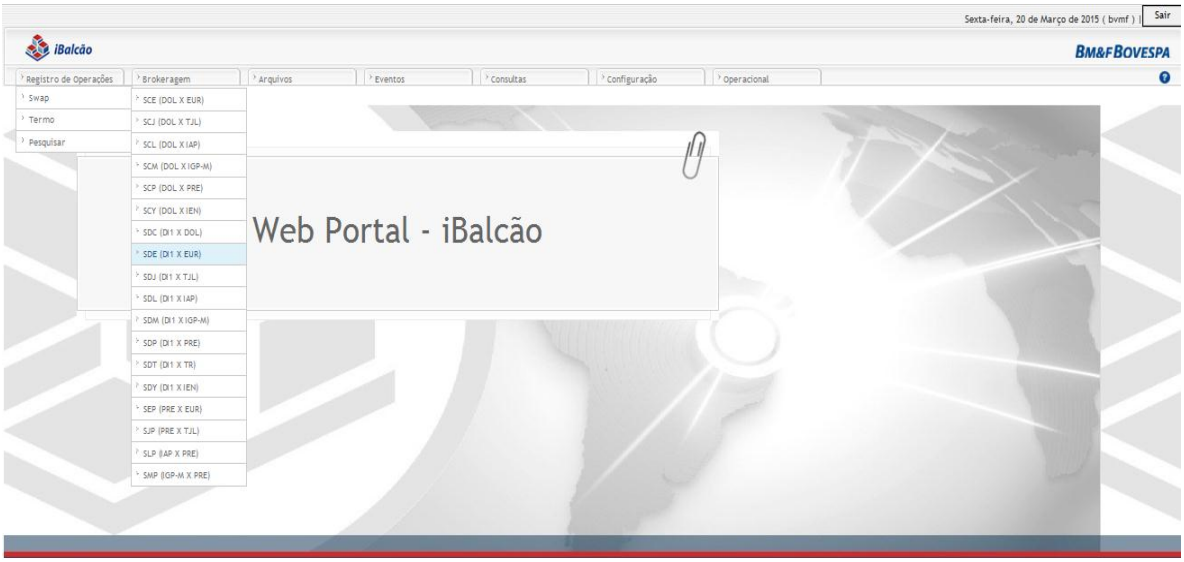
Nos anexos III e IV deste manual, são encontrados os ativos financeiros, suas combinações de contratos de SWAP e suas respectivas fontes de informação pública para apuração de preço e taxas divulgadas ao mercado. Em caso de não haver o ativo objeto/indexador, fonte de informação ou boletim, o participante poderá entrar em contato com a BM&FBOVESPA para análise, através do e-mail: derivativos-balcão@bvmf.com.br

As regras e condições referente ao produto encontram-se disponíveis na rede mundial de computadores, através do site http://www.bmfbovespa.com.br/pt-br/servicos/servicos-de-pos-negociacao/ibalcao/derivativos.asp.

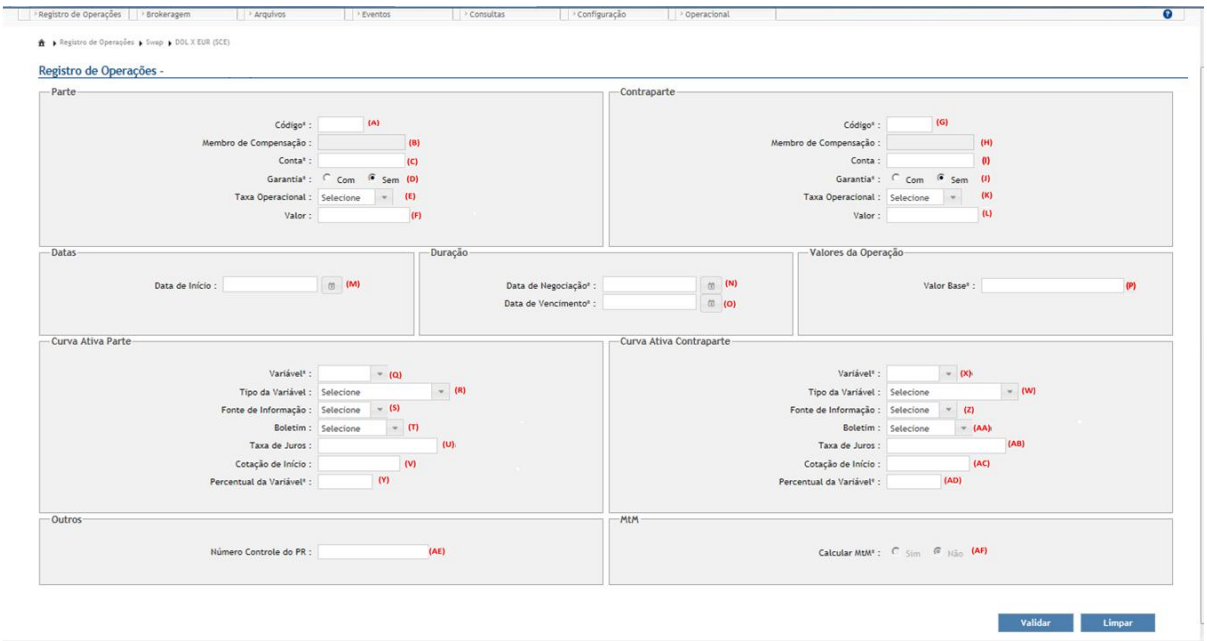
2.5. Tela de Registro de Operações de SWAP:

Atualmente existem duas formas para realizar o registro no iBalcão, a primeira delas é via tela de registro (manual), a segunda é através de upload do arquivo que está disponível tanto no formato xml quanto no formato txt posicional.

O registro manual da operação deverá ser realizado através do menu “Registro de Operações” – SWAP –, conforme a ilustração abaixo:



Depois de selecionado “SWAP”, o sistema exibe um combo box com todas as combinações de contratos disponíveis para negociação e após a escolha do contrato desejado o irá direcioná-lo à tela de registro com os campos disponíveis para preenchimento, conforme ilustração a seguir:



Tela de Registro - Swap	
(A) Código PR	Indica o código no sistema de cadastro BM&FBOVESPA do Participante de Registro "Parte" da Operação.
(B) Membro de Compensação	Indica o código do Membro de Compensação do Participante de Registro "Parte" da operação, informado no sistema SINCAD. Preenchido default.
(C) Conta	Indica o número da conta própria ou do cliente que é Parte na operação.

(D) Garantia	Indica se a Parte solicita garantia da Contraparte.
(E) Taxa Operacional	Indica a forma de cobrança da taxa operacional da parte da operação. Valor meramente informativo. **Opções:** P - percentual V- valor
(F) Valor	Indica o valor/percentual cobrado pela parte operação.
(G) Código PR	Indica o código no sistema de cadastro BM&FBOVESPA do Participante de Registro "ContraParte da Operação.
(H) Membro de Compensação	Indica o código do Membro de Compensação do Participante de Registro "ContraParte da operação, informado no sistema SINCAD. Preenchido default.
(I) Conta	Indica o número da conta própria ou do cliente que é Parte na operação.
(J) Garantia	Indica se a ContraParte solicita garantia da Parte
(K) Taxa Operacional	Indica a forma de cobrança da taxa operacional da Contraparte da operação. Valor meramente informativo. **Opções:** P - percentual V- valor
(L) Valor	Indica o valor/percentual cobrado pela parte operação.

Características Básicas do Contrato

(M) Data de Início	Dia útil em que se inicia o contrato de swap. Esta data poderá ser até 252 dias após a data de negociação.
(N) Data de Negociação	Data útil em que as partes negociaram a operação
(O) Data de Vencimento	Data de maturidade do contrato (T) respeitando o prazo mínimo de dois dias úteis e prazo máximo de 5.580 dias corridos após a data do registro.
(P) Valor Base	Valor Nocional da operação expresso em quantidade de moeda base, respeitando o valor mínimo equivalente à $ 1.000,00 e valor máximo de $ 10.000.000.000,00 com até 2 (duas) casas decimais.

Curva Ativa Parte

(Q) Variável	Caixa de seleção com as opções: TAXAS DE CÂMBIO; JUROS; INDÍCES DE PREÇOS E INDICES.
(R) Tipo da Variável	Boletim/horário do veículo oficial na qual serão publicados os valores negociados variável selecionada.
(S) Fonte de Informação	Nome do veículo oficial responsável pela divulgação do valor da moeda cotada. (Habilitado para preenchimento somente se o campo Câmbio Cruzado for igual a “Sim”)
(T) Boletim	Boletim/horário do veículo oficial na qual serão publicados os valores negociados variável selecionada.
(U) Taxa de Juros	Taxa de remuneração que, agregada a variável atualiza o valor base.
(V) Cotação de Início	Utilizado para informar o valor da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor inicial para valorização da curva do contrato de moedas.
(y) Percentual da variável	Valor percentual do parâmetro com que a Parte e a sua contraparte desejam remunerar cada curva. Informado com até 3 (três) inteiros e 2 (dois) decimais. Poderá ser menor, igual ou maior que 100% de acordo com cada variável.

Curva Ativa ContraParte	
(X) Variável	Caixa de seleção com as opções: TAXAS DE CÂMBIO; JUROS; INDÍCES DE PRECÇOS E INDICES
(W) Tipo da Variável	Boletim/horário do veículo oficial na qual serão publicados os valores negociados variável selecionada.
(Z) Fonte de Informação	Nome do veículo oficial responsável pela divulgação do valor da moeda cotada. (Habilitado para preenchimento somente se o campo Câmbio Cruzado for igual a "Sim")
(AA) Boletim	Boletim/horário do veículo oficial na qual serão publicados os valores negociados variável selecionada.
(AB) Taxa de Juros	Taxa de remuneração que, agregada a variável atualiza o valor base.
(AC) Cotação de Início	Utilizado para informar o valor da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor inicial para valorização da curva do contrato de moedas.
(AD) Percentual da variável	Valor percentual do parâmetro com que a Parte e a sua contraparte desejam remunerar cada curva. Informado com até 3 (três) inteiros e 2 (dois) decimais. Poderá ser menor, igual ou maior que 100% de acordo com cada variável.
(AE) Número de Controle Interno	Campo de uso livre do Participante para informar um número de controle interno da operação na instituição.

Gerais	
(AE) Número de Controle Interno	Campo de uso livre do Participante para informar um número de controle interno da operação na instituição.
(AG) Calcula MtM	**Opções: SIM ou NÃO** Se escolhido a opção "sim", a operação registrada será marcada a mercado diariamente pela metodologia e preços divulgados pela BM&FBOVESPA e disponibilizado no relatório de MtM para o Participante. Permitido somente para operação de Termo sem CCP.
(AF) **Data do Fixing**	Data da observação do preço de liquidação da taxa de câmbio ou paridade, objeto do Contrato a Termo. Essa data deverá ser dia útil e após a data de negociação.

Comandos disponíveis na tela:

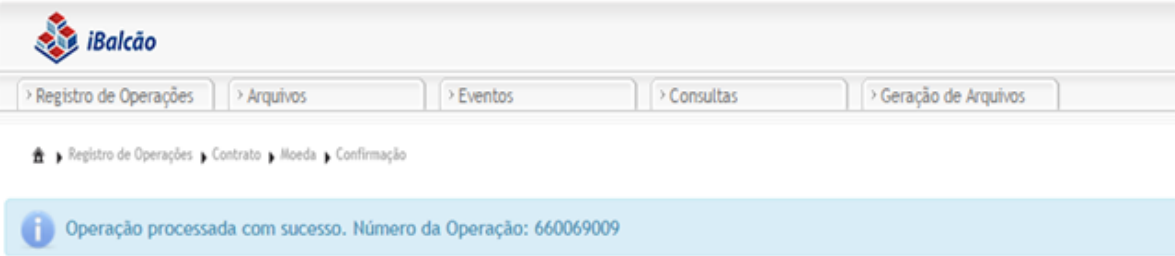
VALIDAR: Submete as informações para checagem primária da operação.

LIMPAR: Recarrega e inicializa a tela com todos os campos em branco a serem preenchidos.

ENVIAR: Submete ao efetivo registro no sistema, após a confirmação das informações da operação.

VOLTAR: Se houver algo incorreto nas informações, clicar em voltar para retornar à tela anterior.

Em operação entre Participante e seus clientes (comando simples), caso nenhuma informação seja invalidada, o sistema gera o número de identificação da Operação.



Em operação entre dois Participantes (duplo comando) após o registro do primeiro comando o sistema gera um número de protocolo até que a contraparte lance o segundo comando.

Somente após o confronto automático das informações o sistema gera o número de identificação da Operação, confirmando o registro da operação.

Caso haja divergência entre as informações fornecidas por cada Participante, o registro ficará com status pendente na tela de ”Consulta – Lançamentos Pendentes” (maiores detalhes no item de ‘Lançamentos pendentes’) até que seja realizado o lançamento com as informações corretas pela parte responsável. Caso o *matching* do lançamento não ocorra no dia do registro, o mesmo será rejeitado ao encerramento do sistema.

3. Eventos

Toda e qualquer movimentação em um contrato derivativo registrado na BM&FBOVESPA, deverá ser refletida no Sistema de Registro pelo Participante com a finalidade de cumprir o disposto no regulamento.

O Participante de Registro tem a possibilidade de realizar os seguintes eventos, de acordo com o permitido por produto e respeitando os limites de prazos para cada evento:

- Liquidação Antecipada;
- Correção;
- Anulação;
- Cancelamento
- Transferência de Conta e Posição
- Cessão Direito
- Brokeragem

Os Participantes de Registro podem realizar, também, o evento de liquidação antecipada por arquivo. Vide capitulo “4. Checar Registro e Eventos por arquivo”.

3.1. Liquidação antecipada

A funcionalidade de solicitar liquidação antecipada de operação de derivativo de balcão tem como objetivo permitir que o participante de registro execute a liquidação total ou parcial da operação. A liquidação total permite o encerramento do contrato antes da data de vencimento enquanto a liquidação antecipada parcial reduz o seu valor base.

A liquidação antecipada do valor total ou parcial do derivativo poderá ser informada em qualquer data entre o dia útil posterior à data de registro e o dia útil anterior à data de vencimento.

No caso de liquidação antecipada de um registro de duplo comando, a mesma deverá ser informada no sistema por **ambas** as partes, e o confronto automático das informações (*matching*) deverão ocorrer no mesmo dia.

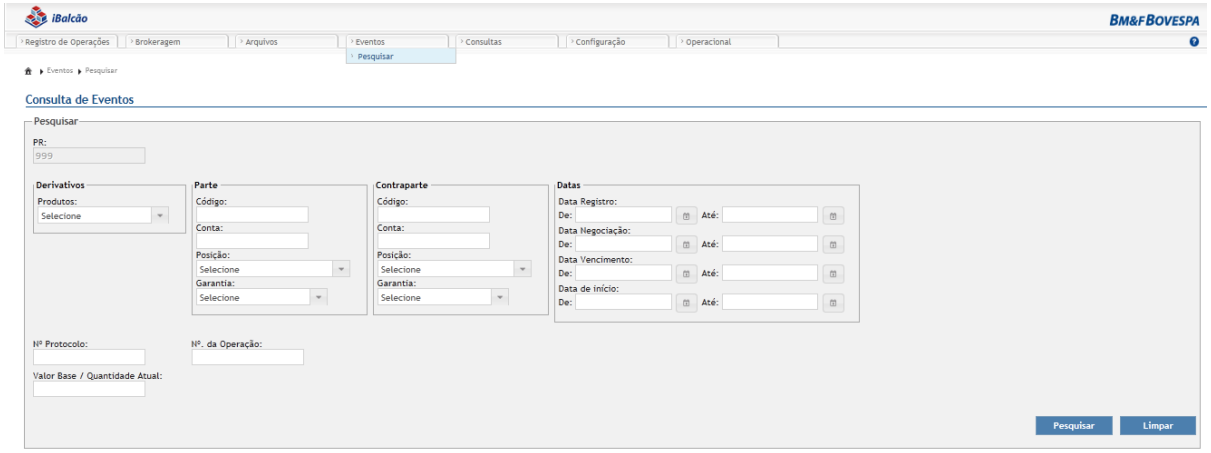
Caso haja divergência entre as informações fornecidas por cada Participante, a solicitação de Liquidação Antecipada ficará com status pendente na tela de ”Consulta Lançamentos Pendentes” (maiores detalhes no item de ‘Lançamentos Pendentes’) até que seja realizado o lançamento com as informações corretas pela parte responsável. Caso o *matching* do lançamento não ocorra no dia da liquidação antecipada, o mesmo será rejeitado ao encerramento do sistema.

Eventualmente, em casos de erro de preenchimento dos dados de liquidação antecipada, entrar em contato imediatamente com a BM&FBOVESPA dentro do horário limite de encerramento do sistema, através do Departamento de Registro de Derivativos de Balcão (derivativos-balcao@bvmf.com.br ou através do telefone 11-2565-4646) para análise.

O registro de liquidação antecipada não deve ser realizado com o objetivo de cancelamento da operação, em função de identificação de registro incorreto, nem deve ser combinado com o registro de uma nova operação para refletir qualquer alteração das condições originalmente pactuadas.

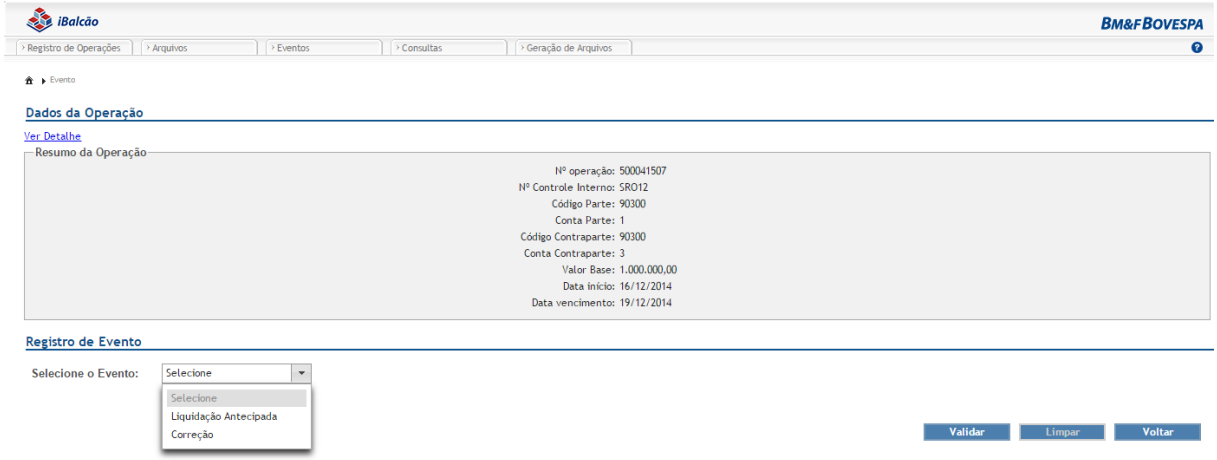
TELA DE PESQUISA NDF

Ao selecionar o Menu “Eventos” e a opção “Liquidação Antecipada”, a tela de pesquisa é apresentada:

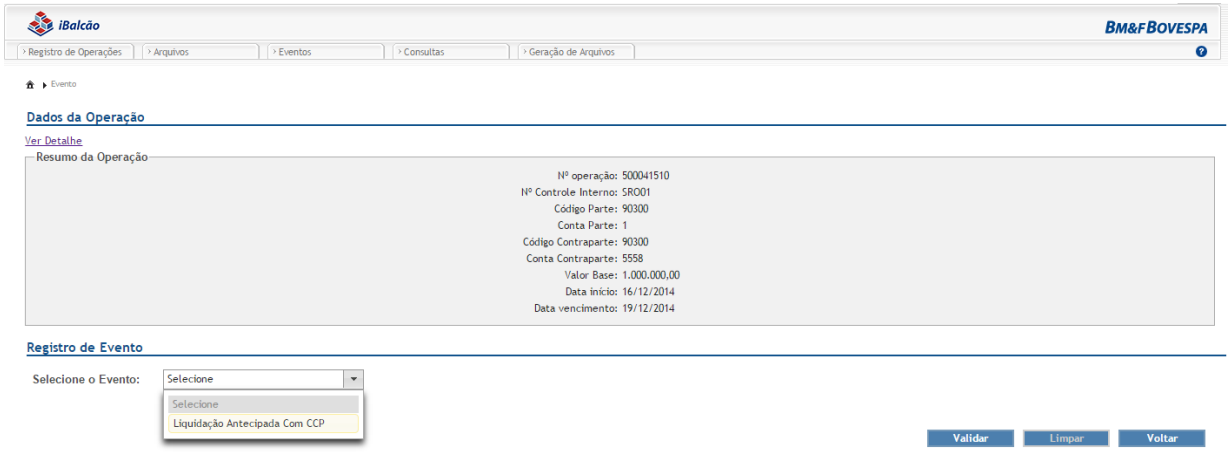


A pesquisa da operação deve ser realizada utilizando os campos acima e serão apresentados os eventos disponíveis para a operação:

- **Termo sem CCP:**

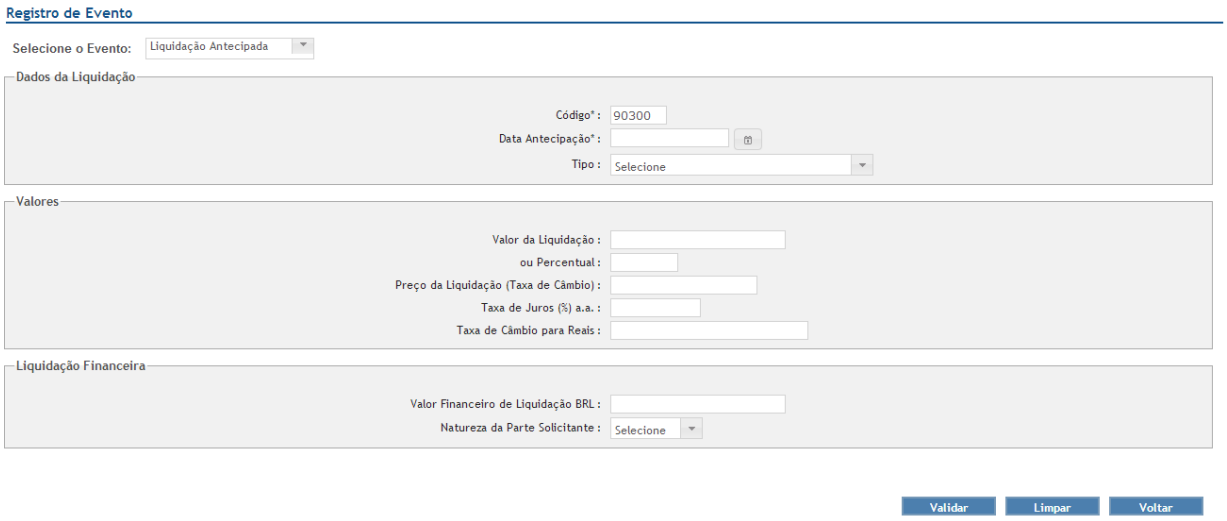


- **Termo com CCP:**



Após selecionar o evento de 'liquidação antecipada', acessar o botão "**VALIDAR**". Caso o participante de registro selecione "**VOLTAR**" o Participante retorna para a tela de pesquisa de eventos.

Para dar continuidade na Liquidação Antecipada, as informações acordadas entre as partes deverão ser informadas na tela, conforme segue:



Nome do Campo	Descrição
(A) Código	**É apresentado o código do PR logado no sistema. Este campo não pode ser editável.**
(B) Data Antecipação	Data da liquidação antecipada da operação. **Termo sem CCP:** pode ser com até 03 dias úteis retroativos, desde que respeite as regras do período autorizado para liquidação antecipada (em qualquer data entre o dia útil

	posterior à data de registro e o dia útil anterior à data de fixing informado). **Termo com CCP:** não permite liquidação antecipada com data retroativa.
(C) Tipo	**Caixas de seleção:** **Valor:** Deverá ser informado um valor mínimo maior que zero até o limite do Valor em Aberto apresentado. Em caso de Liquidação Antecipada Parcial deverá ficar em aberto um saldo remanescente mínimo de R$ 1.000,00; **Percentual:** Segue a mesma lógica especificada para valor. Em caso de Liquidação Antecipada Parcial deverá ficar em aberto um saldo remanescente mínimo de R$1.000,00; **Valor Financeiro de Liquidação BRL:** Apresentará o valor em aberto neste campo, representando a Liquidação Antecipada Total da operação (B). Para qualquer tipo de liquidação antecipada selecionada, o Participante deverá obrigatoriamente informar o campo Valor ou Percentual. **Termo sem CCP:** permite os três tipos de liquidação. **Termo com CCP:** permite SOMENTE liquidação por Valor Financeiro BRL.
(D) Valor de Liquidação	Valor da liquidação antecipada. Para liquidar a operação totalmente, o participante deve informar o valor em aberto da operação.
(E) Percentual	O PR deve informar o percentual da operação que deseja liquidar antecipadamente. Este valor deve ser maior do que 0%. **Campo não existente para termo com CCP.**
(F) Preço da Liquidação (Taxa de Câmbio)	Taxa de câmbio ou paridade de antecipação acordada entre as partes com até 8 casas decimais. **Campo não existente para termo com CCP.**
(G) Taxa de Juros (%) a.a.	Taxa de juros exponencial com até 6 casas decimais, expressa ao ano (base 252 dias úteis), utilizada no desconto para valor presente da liquidação antecipada. **Campo não existente para termo com CCP.**
(H) Taxa de Câmbio para Reais	Taxa de câmbio para conversão do montante financeiro em Reais (BRL) quando a operação for paridade entre moedas estrangeiras. Informado com até 8 casas decimais. **Campo não existente para termo com CCP.**
(I) Valor Financeiro em BRL	O participante deve informar o resultado financeiro da liquidação antecipada que esta liquidando.
(J) Natureza da Parte Solicitante	Obrigatório o preenchimento se selecionado a opção “Sim” no campo “Valor Financeiro em BRL. Este campo deve indicar se a parte é credora ou devedora. **Caixa de seleção:** **Débito**: indicar se a parte da operação for devedora. **Crédito**: indicar se a parte da operação for credora.

Comandos disponíveis na tela:

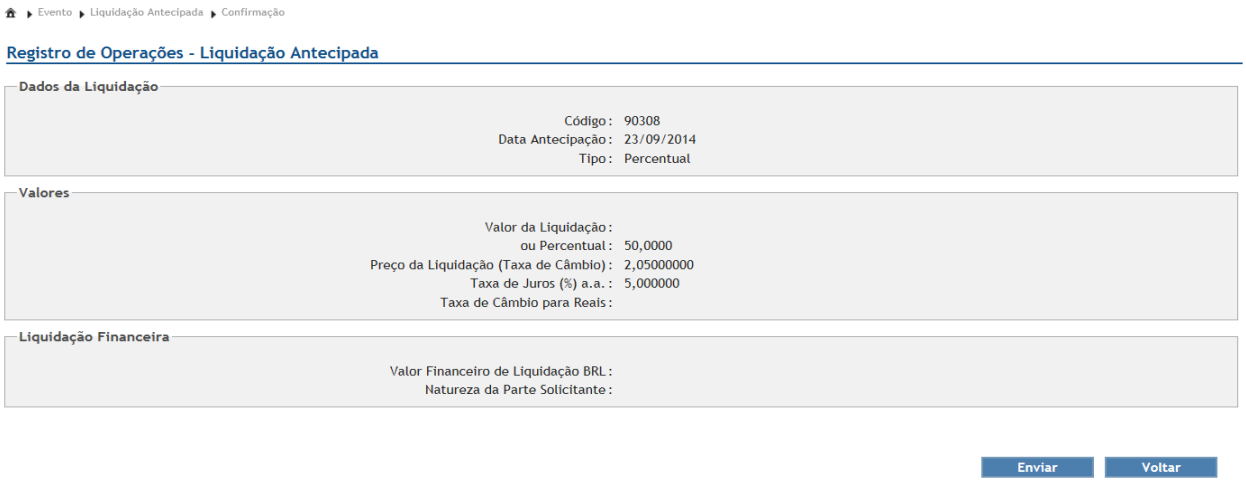
VALIDAR: Submete as informações para checagem primária da operação.

LIMPAR: Limpa os dados preenchidos na tela de liquidação antecipada.

VOLTAR: Se houver algo incorreto nas informações, clicar em voltar para retornar à tela anterior

Se nenhuma inconsistência for apurada, ou seja, nenhum erro no preenchimento, uma tela de confirmação será apresentada com os detalhes finais da liquidação:

- **Termo sem CCP:**

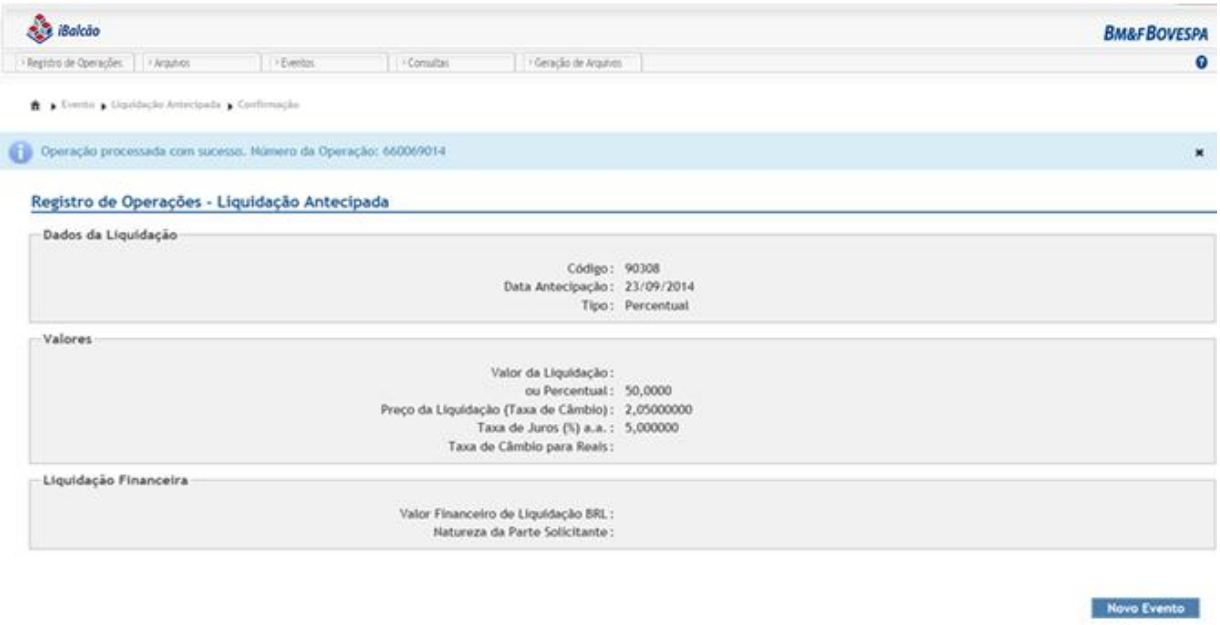


- **Termo com CCP:**

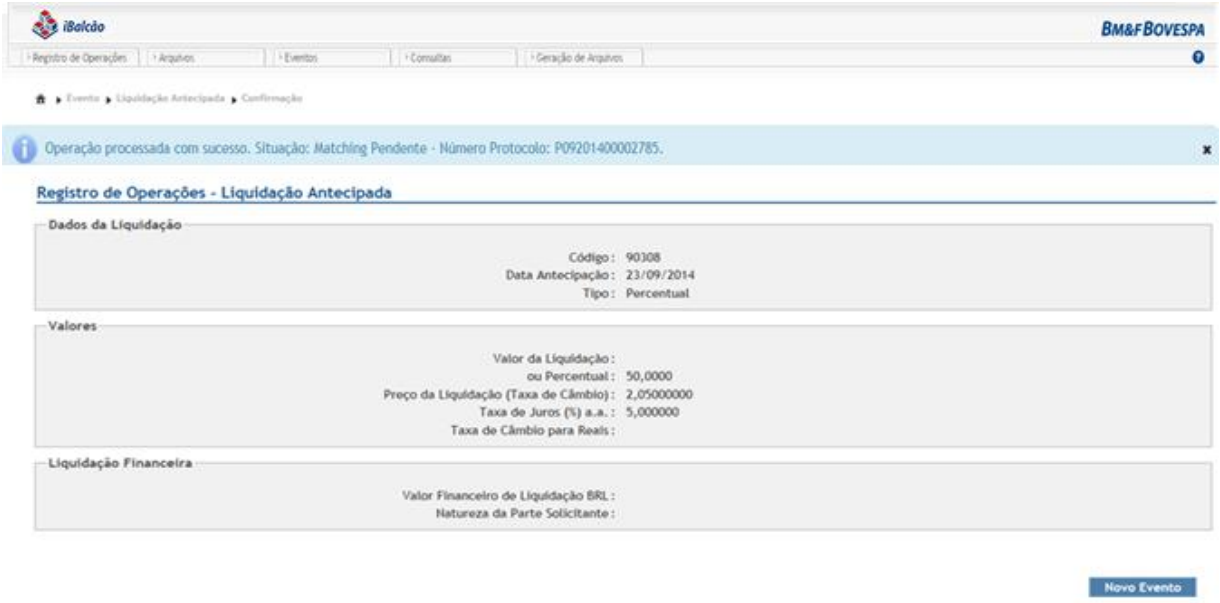
ENVIAR: Caso todas as informações estejam corretas, clicar em **"ENVIAR"** para finalizar a operação.

VOLTAR: Se houver algo incorreto nas informações, clicar em voltar para retornar à tela anterior

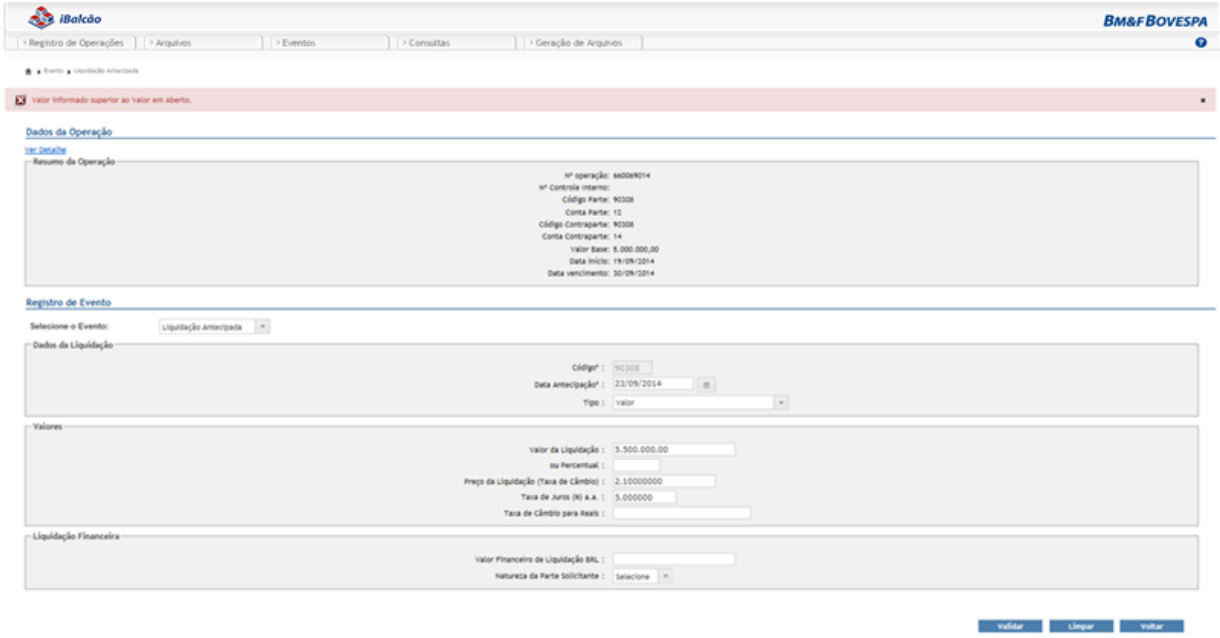
Se a operação for entre Participante e Cliente (comando simples), a operação apresentará uma tela de sucesso conforme abaixo.



Já em operações entre dois Participantes (duplo comando), o sistema aguardará o segundo comando da liquidação antecipada pela parte pendente, conforme tela a seguir. Caso esse comando não seja realizado até o final do horário do sistema, a solicitação do primeiro Participante será descartada e a operação não será liquidada antecipadamente.



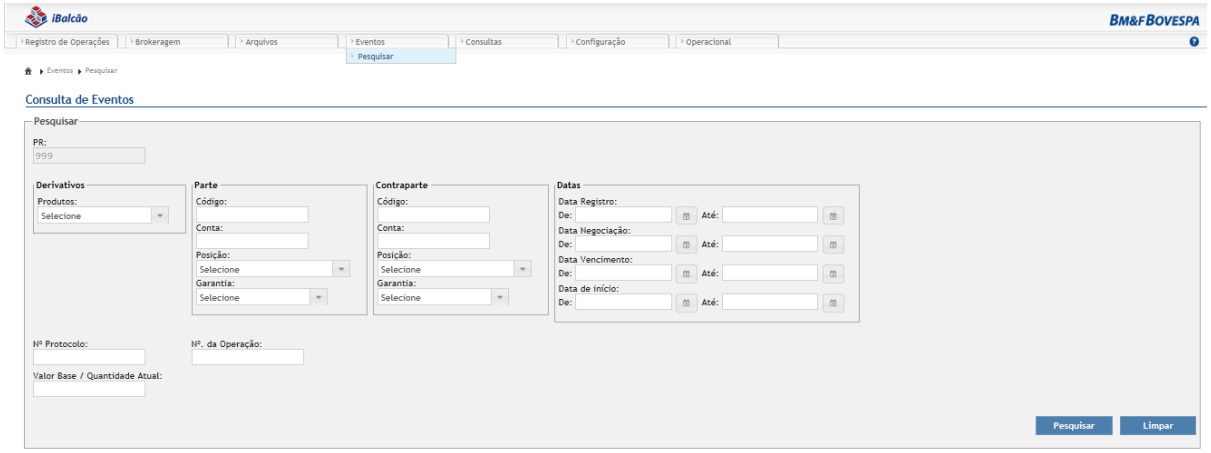
Se por algum motivo o confronto automático das informações não ocorrer por inconsistência nos dados informados, o sistema apresentará os dados divergentes para que o erro possa ser corrigido.



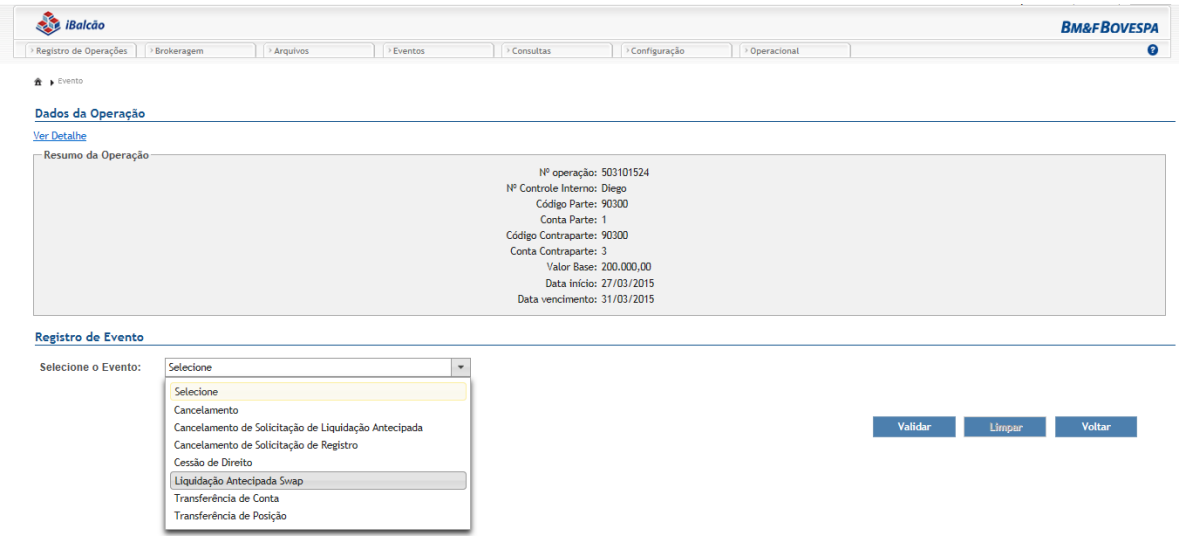
Clicar em **"NOVA LIQUIDAÇÂO**" para que a tela inicial de pesquisa de liquidação antecipada seja recarregada.

TELA DE PESQUISA SWAP

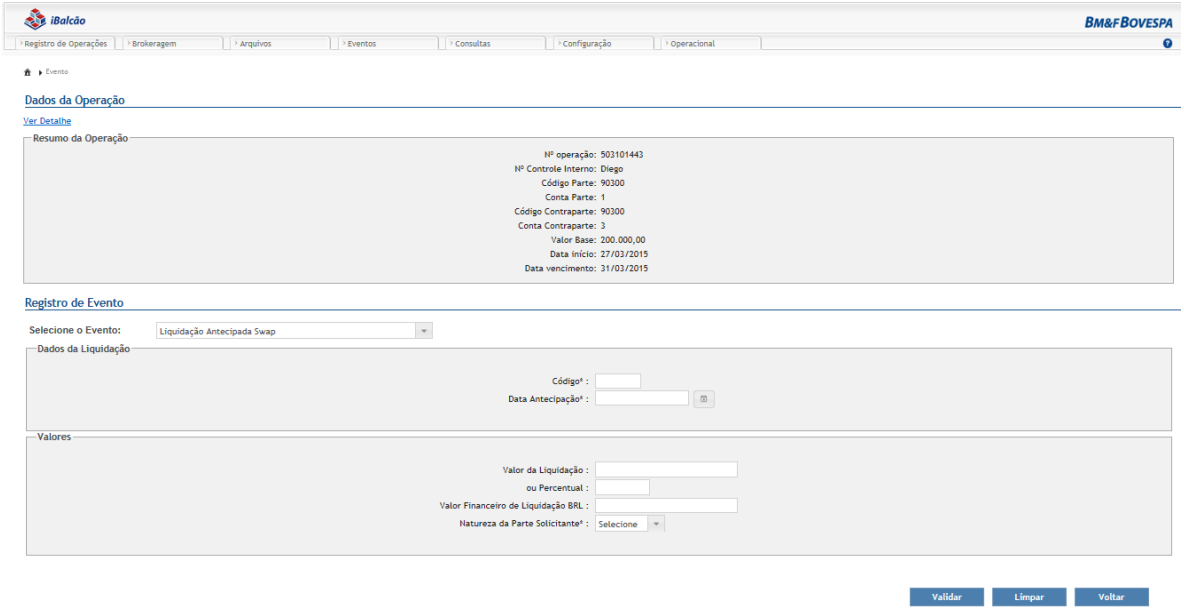
Ao selecionar o Menu “Eventos” e a opção “Liquidação Antecipada”, a tela de pesquisa é apresentada:



A pesquisa da operação deve ser realizada utilizando os campos acima e serão apresentados os eventos disponíveis para a operação:



Após selecionar a opção de Liquidação Antecipada, será apresentada a tela abaixo, no qual o PR deverá preencher os campos necessários para efetivar a liquidação;



Nome do Campo	Descrição
(A) Código	É apresentado o código do PR logado no sistema. Este campo não pode ser editável.
(B) Data Antecipação	Data da liquidação antecipada da operação.
(C) Valor de Liquidação	Valor da liquidação antecipada. Para liquidar a operação totalmente, o participante deve informar o valor em aberto da operação.
(D) Percentual	O PR deve informar o percentual da operação que deseja liquidar antecipadamente. Este valor deve ser maior do que 0%.
(E) Valor Financeiro em BRL	O participante deve informar o resultado financeiro da liquidação antecipada que esta liquidando.
(F) Natureza da Parte Solicitante	Obrigatório o preenchimento se selecionado a opção "Sim" no campo "Valor Financeiro em BRL. Este campo deve indicar se a parte é credora ou devedora. **Caixa de seleção:** **Débito**: indicar se a parte da operação for devedora. **Crédito**: indicar se a parte da operação for credora.

Comandos disponíveis na tela:

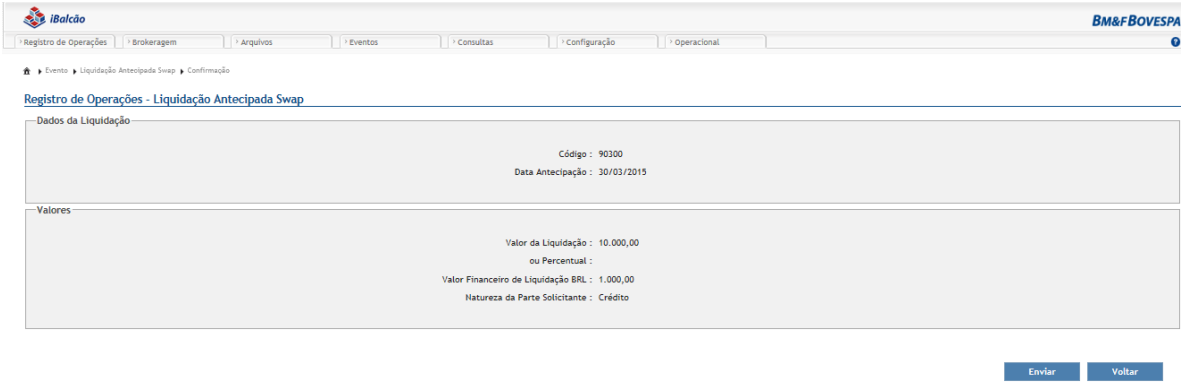
VALIDAR: Submete as informações para checagem primária da operação.

LIMPAR: Limpa os dados preenchidos na tela de liquidação antecipada.

VOLTAR: Se houver algo incorreto nas informações, clicar em voltar para retornar à tela anterior

Se nenhuma inconsistência for apurada, ou seja, nenhum erro no preenchimento, uma tela de confirmação será apresentada com os detalhes finais da liquidação:

Se nenhuma inconsistência for apurada, ou seja, nenhum erro no preenchimento, uma tela de confirmação será apresentada com os detalhes finais da liquidação:



ENVIAR: Caso todas as informações estejam corretas, clicar em **"ENVIAR"** para finalizar a operação.

VOLTAR: Se houver algo incorreto nas informações, clicar em voltar para retornar à tela anterior

Comando Simples

Se a operação for entre Participante e Cliente (comando simples), será apresentado uma mensagem de "Operação processada com Sucesso".

Comando Duplo

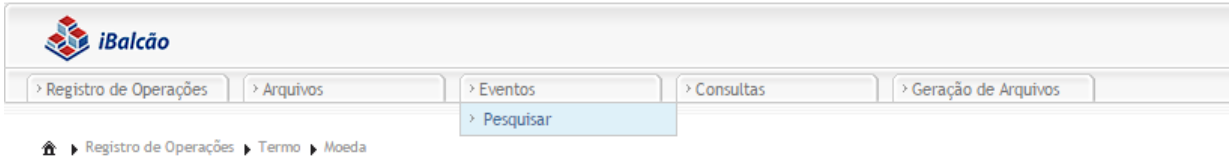
Já em operações entre dois Participantes (duplo comando), após clicar em "enviar" o sistema aguardará o segundo comando da liquidação antecipada pela parte pendente, Caso esse comando não seja realizado até o final do horário do sistema, a solicitação do primeiro Participante será descartada e a operação não será liquidada antecipadamente.

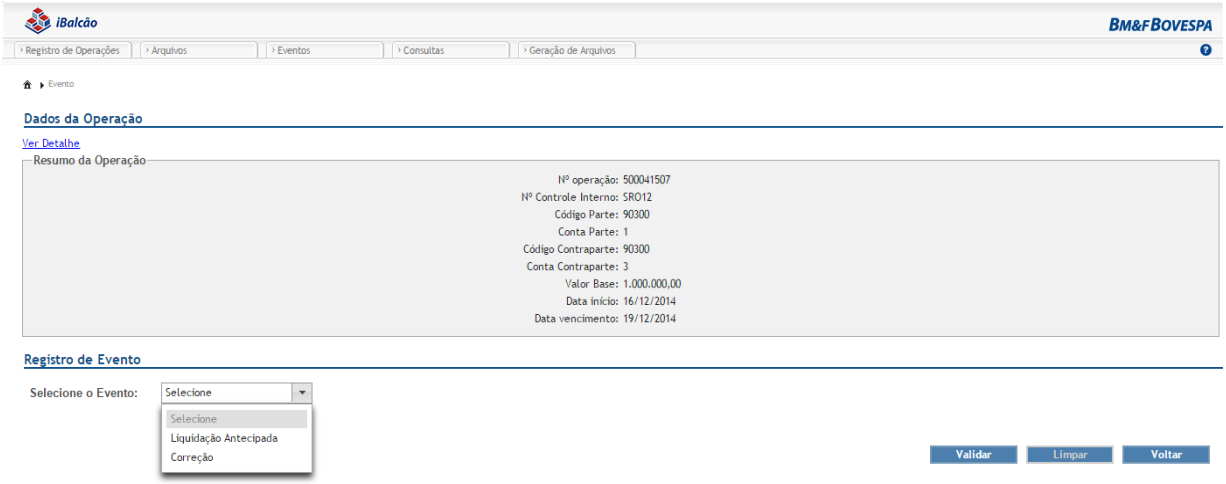
3.2. Correção

Disponível somente para NDF SEM CCP

O Participante de Registro pode solicitar a correção de uma operação por tela no dia do registro até 03 dias úteis após a data de negociação. Não é permitido correção de uma operação que sofreu fluxo financeiro.

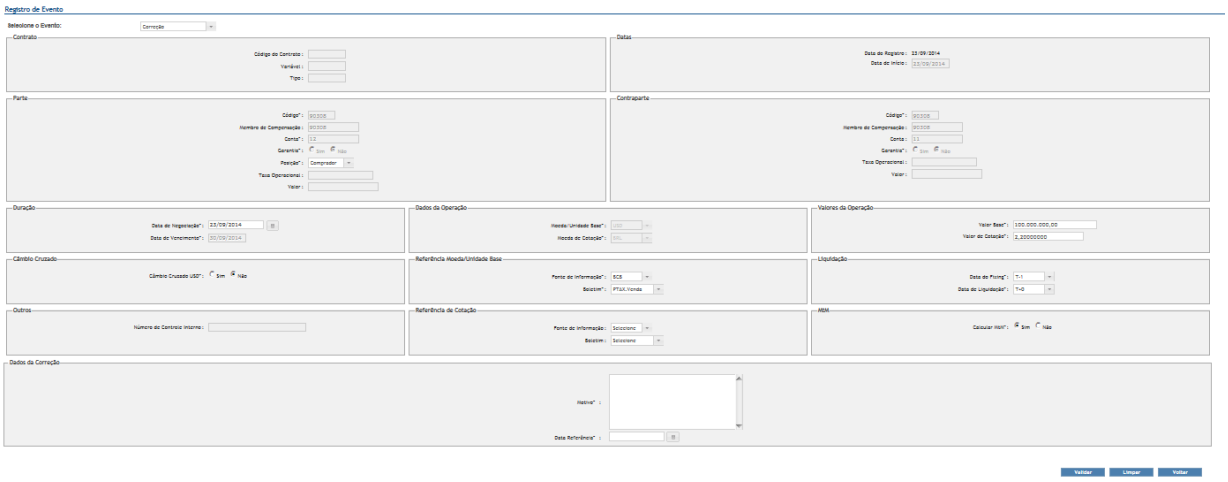
Para realizar a correção de uma operação, o participante de Registro deve acessar o menu de pesquisa de eventos e inserir o número da operação que deseja corrigir, vide figura abaixo:





Após selecionar o evento de 'correção', acessar o botão "**VALIDAR**". Caso o participante de registro selecione "**LIMPA**"' e "**VOLTAR**" o Participante de Registro retorna para a tela de pesquisa de eventos.

Para dar continuidade a correção, as informações acordada entre as partes deverão ser informadas na tela, conforme segue:



Os campos passíveis de correção na operação são:

- Posição;
- Data de Negociação;
- Valor Base;
- Valor de Cotação;
- Câmbio Cruzado USD;
- Fonte de Informação da Moeda Base;
- Boletim da Moeda Base;
- Data de Fixing;
- Data de Liquidação;
- Fonte de Informação da Moeda Cotada;
- Boletim da Moeda Cotada;
- Calcular MtM;

Além disso, o PR deve informar, obrigatoriamente, o **motivo** e a data de Referência da Correção.

Comandos disponíveis na tela:

VALIDAR: Submete as informações para checagem primária da operação.

LIMPAR: Limpa os dados preenchidos na tela de correção.

VOLTAR: Se houver algo incorreto nas informações, clicar em voltar para retornar à tela anterior

Se a solicitação da correção for de operação de Duplo comando, a mesma deve ocorrer *matching* para que a operação seja corrigida. Caso não haja o *matching* da correção da operação até o horário limite estabelecido, a solicitação de correção da operação é rejeitada no final do dia.

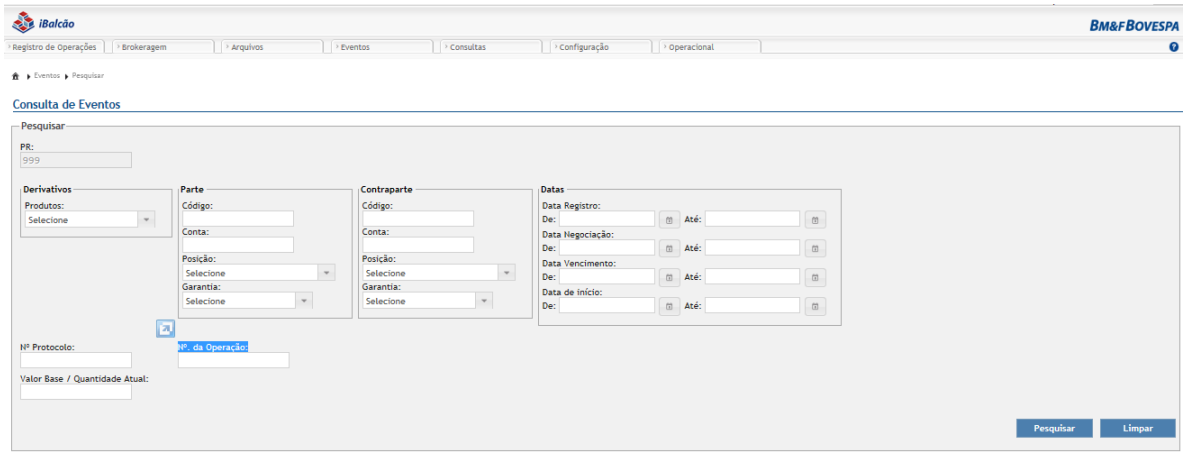
Caso seja necessário realizar uma correção após 03 dias úteis da data de negociação ou cancelar uma solicitação de correção, o Participante de Registro deve solicitar a BVMF.

3.3. Anulação

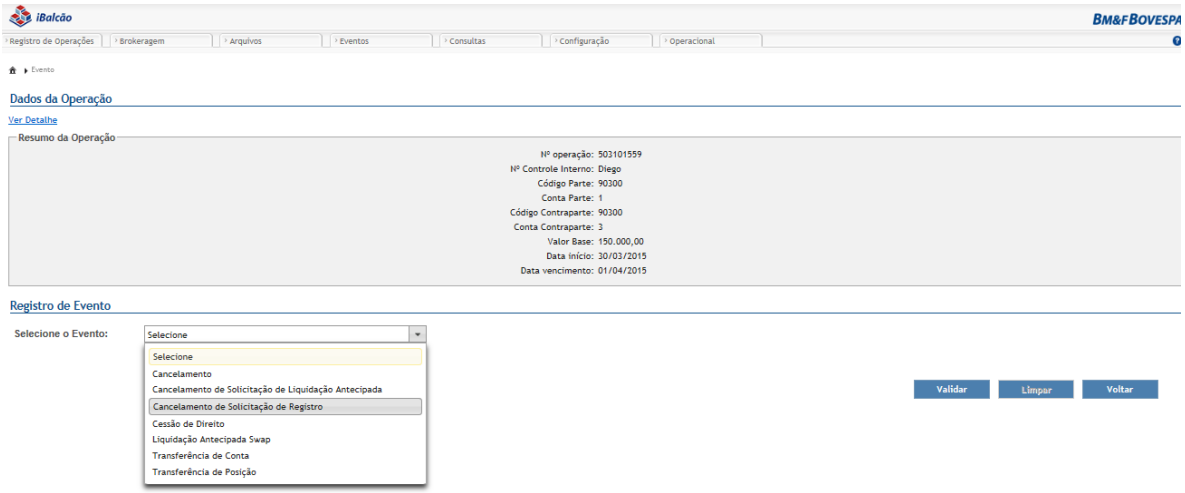
O comando de anulação dentro do sistema iBalcão tem como função revogar o evento realizado indevidamente e; ou de forma incorreta; Está apto para registro de contrato, liquidação antecipada e Brokeragem.

A anulação de registro, liquidação e brokeragem de contratos está disponível para NDF Com CCP; SWAP Com e Sem CCP. O Participante de Registro pode solicitar a anulação de registro por tela somente no dia do registro, ou seja, em D0.

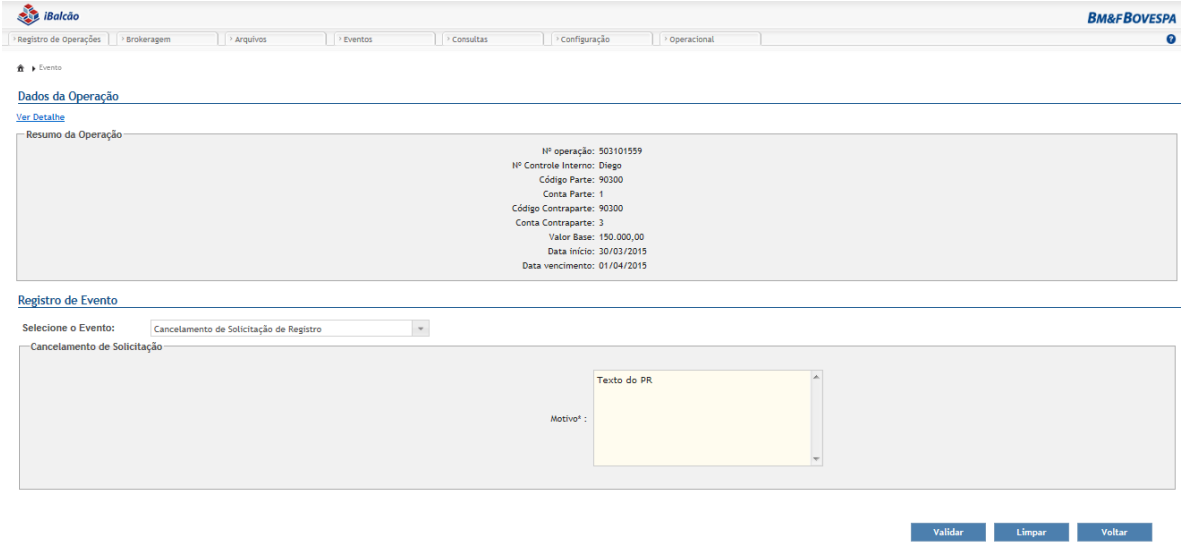
Para realizar a anulação de uma operação, o participante de Registro deve acessar o menu de eventos >> pesquisa e inserir o número da operação que deseja corrigir, vide figura abaixo:



Ao pesquisar o número da operação que deseja anular o registro, o sistema irá apresentar a tela abaixo e o PR deverá selecionar a opção Anulação/Cancelamento de Solicitação de Registro;



Após selecionar a opção de cancelamento de solicitação de registro, o sistema irá solicitar o motivo pelo qual a operação está sendo anulada;(campo obrigatório preenchido pelo participante)



Comandos disponíveis na tela:

VALIDAR: Submete as informações para checagem primária da operação.

LIMPAR: Limpa os dados preenchidos na tela de correção.

VOLTAR: Se houver algo incorreto nas informações, clicar em voltar para retornar à tela anterior

Se a solicitação da correção for de operação de Duplo comando, a mesma deve ocorrer *matching* para que a operação seja corrigida. Caso não haja o *matching* da correção da operação até o horário limite estabelecido, a solicitação de correção da operação é rejeitada no final do dia.

Caso seja necessário realizar uma correção após 01 dia útil da data de negociação, o Participante de Registro deve solicitar a BVMF.

3.4. Cancelamento

O cancelamento de registro tem como objetivo a exclusão do contrato por motivo de erro de preenchimento em campo não passível de alteração, situações de registro em duplicidade, ocorrências justificadas por erro operacional do Participante e em último caso, não aceitação do registro por decisão da BVMF.

O evento de cancelamento não deve ser realizado com o objetivo de Liquidação Antecipada Total, vencimento antecipado do contrato ou em função de cláusulas combinadas em documento assinado entre os envolvidos, nem ser combinado com o registro de um novo contrato para refletir qualquer alteração das condições originalmente pactuadas.

O participante deve remeter a documentação comprobatória para a avaliação da BVMF e, caso julgue pertinente, realizará através de comando interno o cancelamento da operação. Caso a operação seja de comando duplo, a solicitação de cancelamento deve ser realizada por AMBAS as partes da operação.

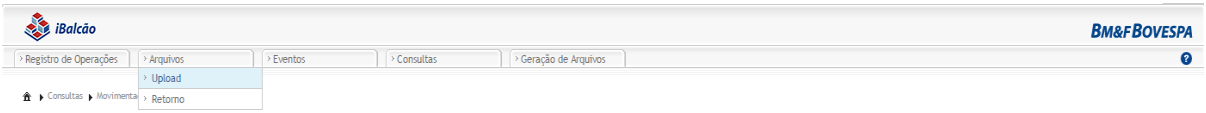
Para operações de termo sem CCP, o cancelamento pode ocorrer através da tela do sistema iBalcão, no dia do registro ou até 03 dias úteis a data de negociação. Solicitações após 3 dias úteis da data de negociação serão tratadas como exceção e analisadas pela BVMF.

Caso a operação tenha sofrido fluxo financeiro, a operação não poderá ser cancelada.

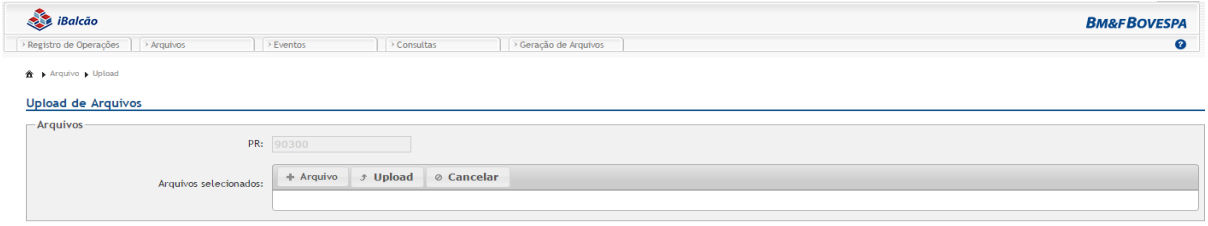
Após o cancelamento da operação o participante não pode solicitar o estorno do cancelamento da operação. Operações canceladas não podem ser reativadas.

3.5. Registro e Eventos por Arquivo

O Registro e o evento de Liquidação Antecipada de operações também pode ser realizado por arquivo (somente no formato ”xml”). Para acessar a tela de Upload deve-se selecionar o menu “ARQUIVOS” e “UPLOAD”.

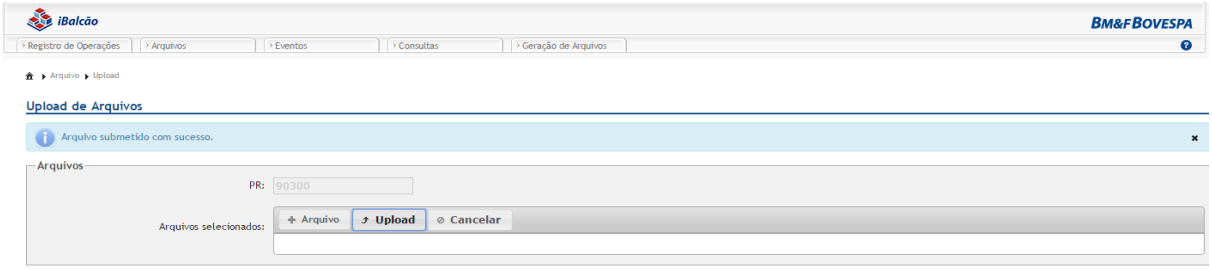


O sistema abrirá a tela abaixo e o arquivo poderá ser carregado clicando em "+ ARQUIVO". O formato do arquivo deve ser XML ou TXT, cujo layout está disponível em www.bmfbovespa.com.br/balcao > Documentos > Termo.



Uma vez selecionado o arquivo, o Participante de Registro deverá clicar em "Upload" para realizar o carregamento dos arquivos no sistema. Caso o PR deseje cancelar os arquivos selecionados, deverá clicar em "Cancelar".

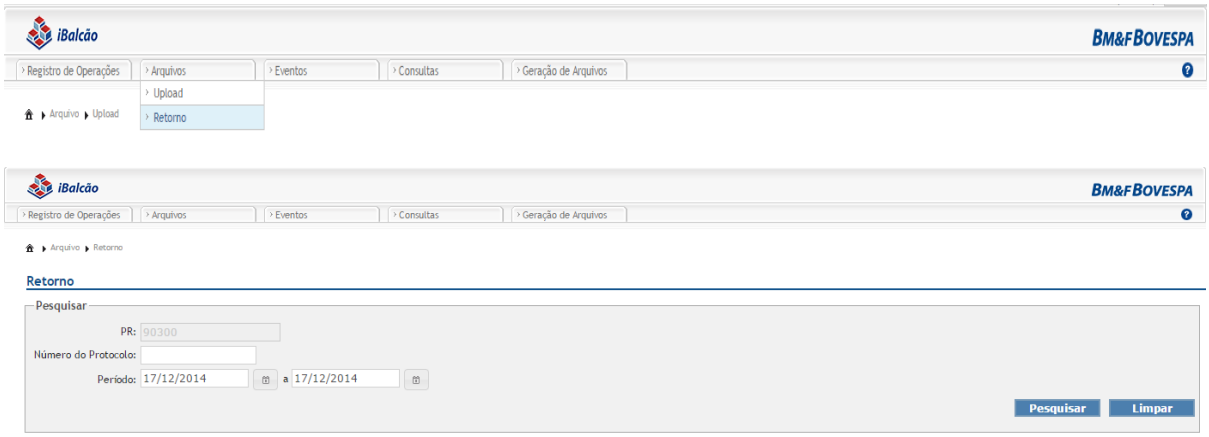
O sistema deve apresentar mensagem de sucesso no upload do arquivo.



Caso o arquivo não possua o layout correto, o sistema apresentará a mensagem de erro

3.6. *Arquivo de Retorno*

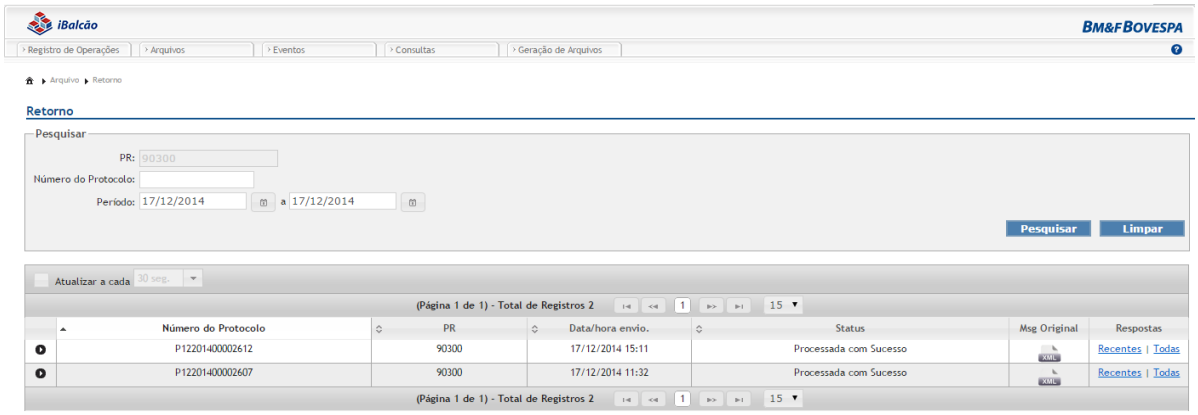
Para obter as informações de retorno de um arquivo importado na opção "Upload", acessar a opção através do menu "Arquivos" e "Retorno":



O sistema exibirá a tela seguinte com os campos para pesquisa, os quais poderão ser preenchidos com os seguintes critérios:

- **PR**: Apresenta *default* o código do Participante de Registro logado no sistema.
- **Número do protocolo**;
- **Período**: Refere-se à data de envio do arquivo, podendo ser até 05 dias retroativos à data do sistema.

Uma vez preenchida as opções de pesquisa, clicando-se em **"PESQUISAR"**, o sistema exibirá o resultado com os detalhes dos arquivos localizados conforme exemplo abaixo:



Para verificar o detalhe do processamento do arquivo, é necessário acessar o link "Recentes" ou "Todas" para baixar os arquivos de retorno em formato XML.

Na próxima tela, são apresentadas todas as operações que estão no arquivo de retorno.

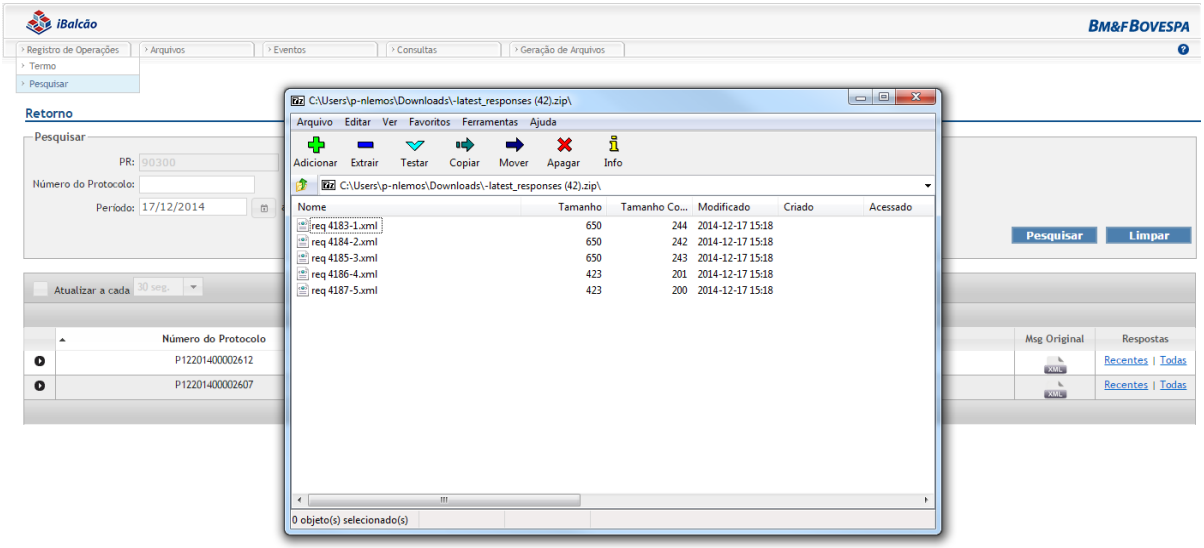
Definição dos campos da grid de resultados:

- **Número do Protocolo** – Se o registro for efetivado com sucesso é apresentado o número da operação. Entretanto, se houver qualquer inconsistência, a informação é apresentada como 'ERRO'.

  Para operações de duplo comando, para a primeira parte a registrar a operação através de arquivo, o sistema irá apresentar a informação de "Pendente", enquanto, se for a segunda parte a responsável a registrar por arquivo, o sistema confirma o *matching* e é apresentado o "Número da Operação".
- **Data/hora envio** – apresenta a data e o horário que o arquivo foi lançado.
- **Status –** Apresenta o status do arquivo, se foi apenas recebido ("Recebida, aguardando processamento") ou processado ("Processada com sucesso").
- **Mensagem original –** Apresenta o arquivo original que foi carregado na função "Upload", disponível para download.

- **Respostas –** Apresenta dois links: “Recentes” e “Todas” onde o Participante realiza o download de resposta do processamento dos arquivos**.**

Ao clicar no link “Recentes” o sistema apresenta arquivo no formato .zip com todas as operações recentes que foram enviadas e o resultado de processamento da operação.



Ao abrir o arquivo, o sistema apresenta o arquivo de retorno da operação, conforme layout disponível no endereço www.bvmf.com.br/balcao > Documentos > Termo.

```
<?xml version="1.0"?>
- <OTC0001R1>
    <DtMovto>2014-09-23</DtMovto>
    <NumrcSeqOpLote>1</NumrcSeqOpLote>
    <TpModBVF>82</TpModBVF>
    <NumCtrlBVF>660069021</NumCtrlBVF>
    <NumProtBVF>P09201400002790</NumProtBVF>
    <NumCtrlPart>VENCIMENTO01</NumCtrlPart>
    <SitOpBVF>Processada</SitOpBVF>
    <DtHrSit>2014-09-23 12:55:08</DtHrSit>
    <GrupoErroGENBVF> </GrupoErroGENBVF>
  </OTC0001R1>
```

3.7. Transferência de Conta e Posição

O evento de transferência promove a transferência de uma operação de uma conta de cliente para outra de cliente sob o mesmo PR ou a transferência da operação de um PR para outro PR.

A transferência pode ser feita a partir de D+1 da Data de Negociação até D-1 do vencimento.

Qualquer transferência deverá ser solicitada a BM&FBOVESPA por meio de carta assinada pelos representantes legais.

3.8. Cessão Direito

A Cessão de Direito representa a transferência de determinada operação de um PR para outro PR mediante pagamento de valor acordado entre as partes.

A Cessão de Direito pode ser feita a partir de D+1 da Data de Negociação até D-1 do vencimento.

O evento de Cessão de Direito deverá ser solicitado a BM&FBOVESPA por meio de carta assinada pelos representantes legais.

3.9. Brokeragem

A Brokeragem é uma função na qual o Participante de Registro intermedia operações de SWAP. Consiste em selecionar operações de SWAP com CCP no qual a conta própria do PR esteja em uma operação comprado em uma variável e na outra operação esteja vendido na mesma variável, assim o PR pode “marcar” as duas operações para que seja formada a operação Broker. As operações Broker dão desconto ao PR nos emolumentos cobrados no registro e liquidação das operações.

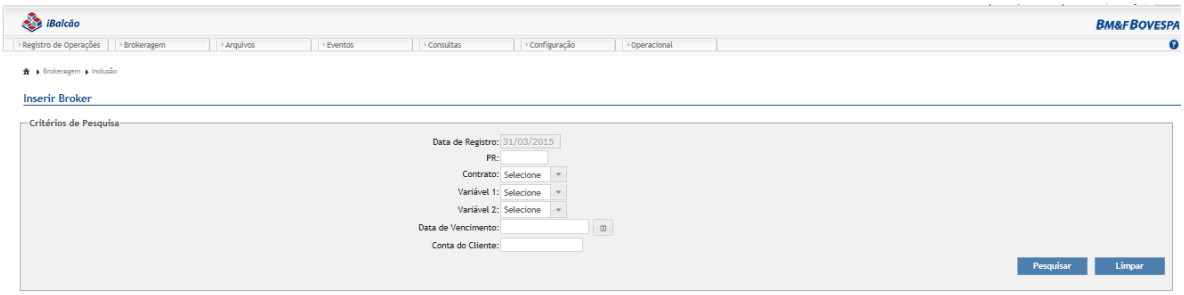
Para caracterizar uma operação Broker as operações devem atender as características abaixo:

- As operações/contratos devem ter garantia da BVMF na parte e contraparte;
- As operações/contratos devem ter sido registradas no mesmo dia;
- As operações tem que ser do mesmo PR/Conta;
- Conta própria do PR deve figurar como uma das partes na operação/contrato;
- As operações devem ter as mesmas variáveis;
- A conta própria do PR deve assumir posições inversas nas variáveis das operações;
- Devem ter as mesmas características:
    - Data do Registro;
    - Data de Vencimento;
    - Data de Início;
    - Variáveis/Contrato.

No caso de um comando duplo, uma operação de swap poderá estar associada a dois brokers, um de cada curva. Esse cenário ocorre quando cada uma das curvas estiverem relacionadas a uma contra própria de brokers diferentes.

O acesso a tela de Brokeragem será pelo menu “Brokeragem”, ao posicionar o cursor em cima de cima, aparecerá uma lista de opções com três alternativas (Inclusão; Anulação e Consulta);

3.9.1 - Inclusão



Após preencher os campos acima, o sistema irá apresentar a lista de operações que estão disponíveis para realizar o broker. Por exemplo:

Variável 1

Id Broker	Número da Operação	Contrato	Valor Base	Variável Compra	Data de Vencimento	Conta
▾	2090022521	SCE	10.000,00	DOL	18/09/2014	00001
▾	2090022522	SCE	50.000,00	DOL	18/09/2014	00003
▾	2090022523	SCE	90.000,00	DOL	18/09/2014	00003

Paginação [1]..[n]

Variável 2

Id Broker	Número da Operação	Contrato	Valor Base	Variável Compra	Data de Vencimento	Conta
▾	2090022524	SCE	15.000,00	REU	18/09/2014	00002
▾	2090022525	SCE	500.000,00	REU	18/09/2014	00002
▾	2090022526	SCE	8.000,00	REU	18/09/2014	00003

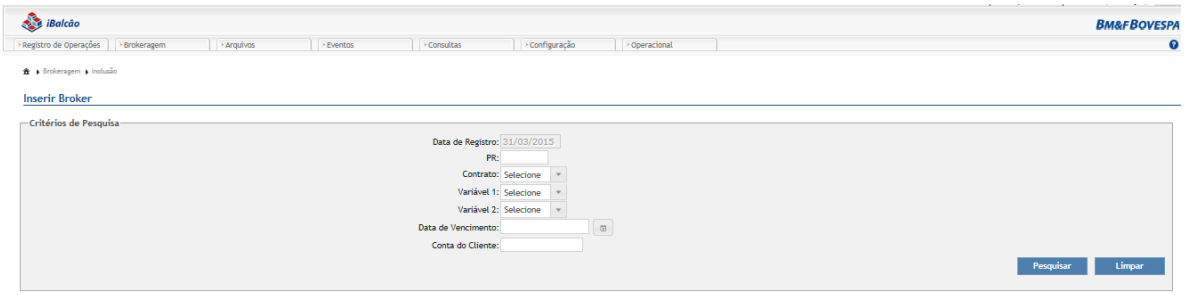
Paginação [1]..[n]

Enviar Limpar

Ao clicar em enviar as operações serão enviados para análise do sistema, porém o Broker será criado definitivamente através de batch noturno, enquanto isso ele permanece como 'Solicitado'. Isso acontece, pois as operações associadas à ele possuirão status provisório até que sejam avaliadas e conduzidas para um status definitivo ('Contrato em Aberto' e 'Rejeitada') através de batch noturno.

3.9.2 – Anulação

A Anulação do broker consiste em cancelar/desistir do evento realizado, poderá ser realizado no mesmo caminho, porém ao invés de inclusão deverá escolher a opção “anulação”. A mesma tela será apresentada e o PR deverá preencher os dados solicitados.



Após o preenchimento das informações o sistema irá apresentar a lista de operações que foram solicitadas para a brokeragem:

Variável 1

Id Broker	Número da Operação	Contrato	Valor Base	Variável Compra	Data de Vencimento	Conta
▼	2090022521	SCE	10.000,00	DOL	18/09/2014	00001
▼	2090022522	SCE	50.000,00	DOL	18/09/2014	00003
▼	2090022523	SCE	90.000,00	DOL	18/09/2014	00003

Paginação [1]..[n]

Variável 2

Id Broker	Número da Operação	Contrato	Valor Base	Variável Compra	Data de Vencimento	Conta
▼	2090022524	SCE	15.000,00	REU	18/09/2014	00002
▼	2090022525	SCE	500.000,00	REU	18/09/2014	00002
▼	2090022526	SCE	8.000,00	REU	18/09/2014	00003

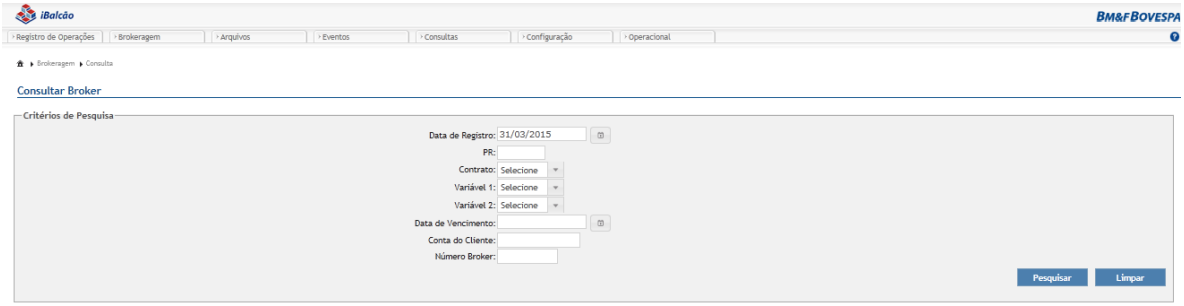
Paginação [1]..[n]

Enviar Limpar

Ao lado de cada operação será apresentado uma caixa de seleção para marcar qual das operações o PR deseja anular o broker solicitado;

3.9.3 – Consulta

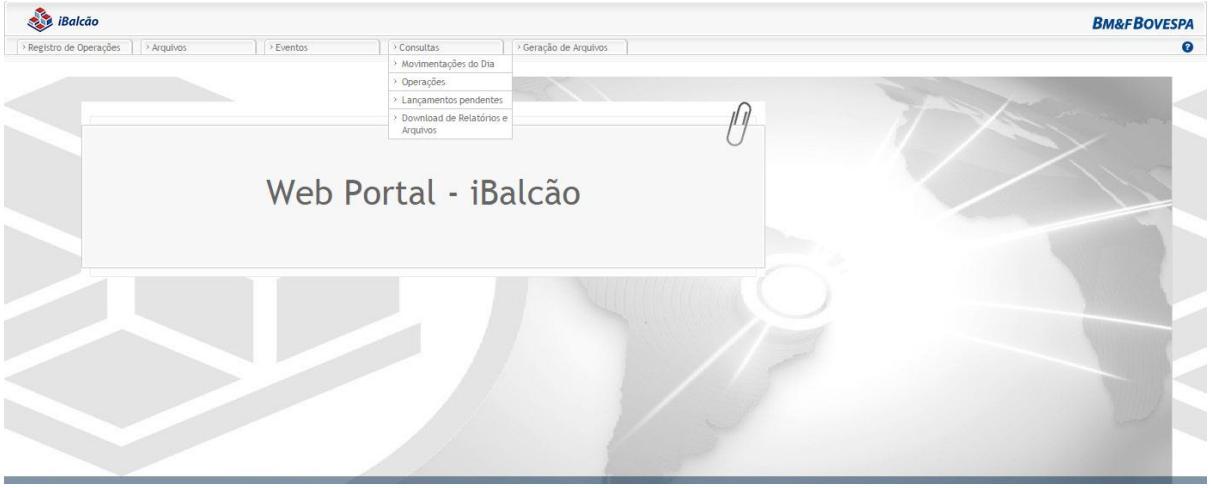
Com a consulta de operações brokeradas, será possível pesquisar todas as solicitações de broker que o PR solicitou em D0. Para isso, ocorrer, o PR deverá ir no menu brokeragem > consulta e preencher os dados solicitados abaixo:



Após isso será apresentado à tela de consulta com as solicitações de brokeragem realizadas em D0.

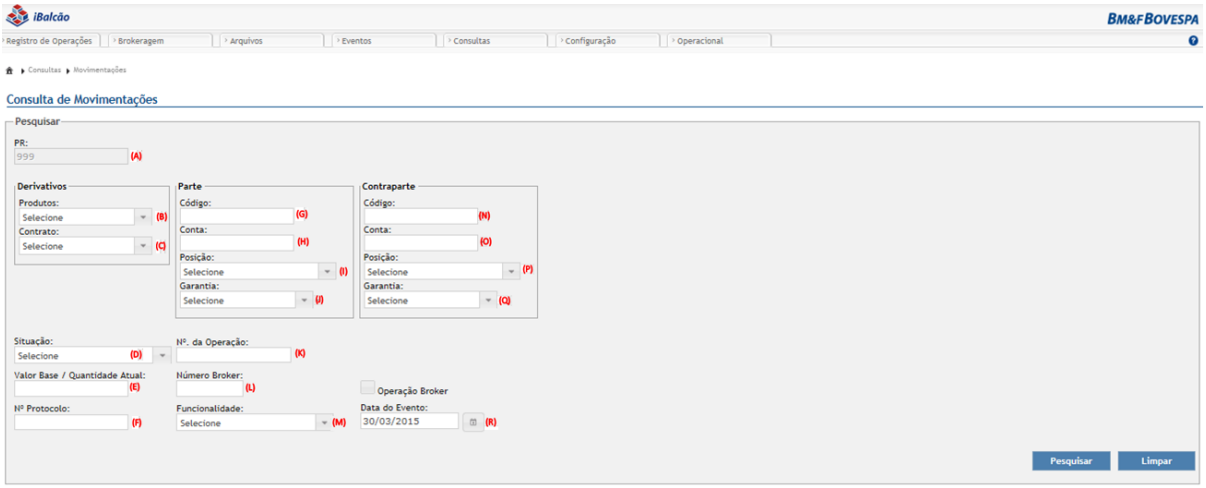
4. Operações

O usuário poderá a qualquer momento verificar as movimentações do dia ou checar as operações realizadas em um período determinado. Essas consultas estão disponíveis no menu principal como **"CONSULTAS"**.



4.1. Consulta de Movimentações

O acesso a essa consulta é realizado através do menu "Consultas", opção "Movimentações".

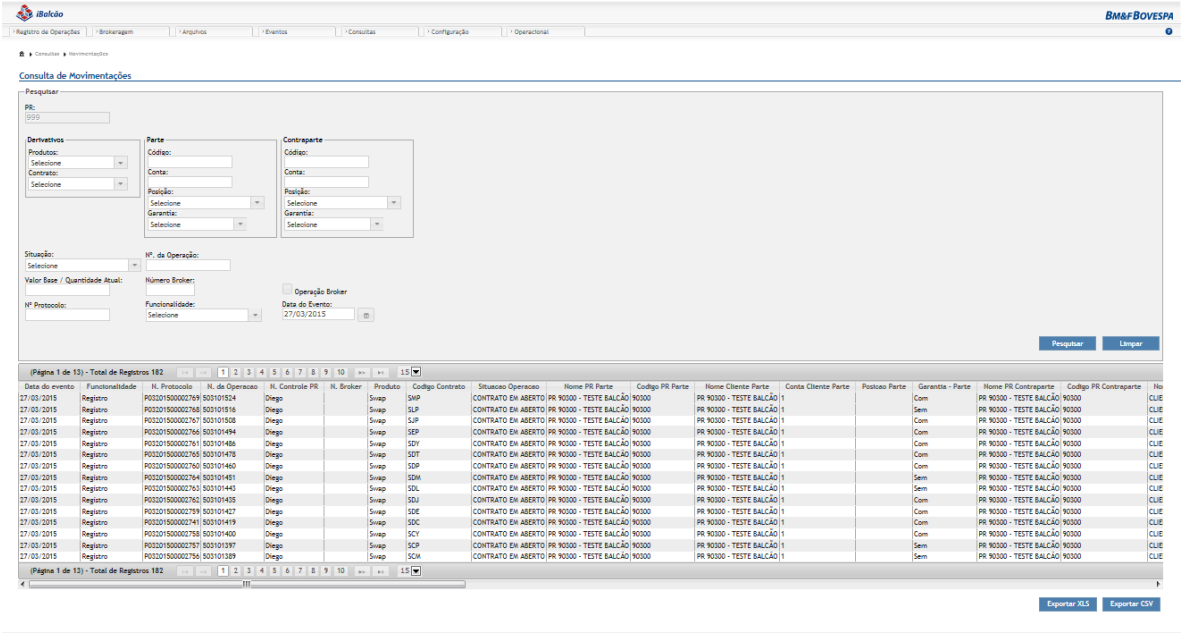


Segue abaixo o detalhamento e explicação de cada campo:

Nome do Campo	Descrição
(A) PR	Apresenta *default* o código do Participante de Registro logado no sistema
(B) Produtos	Produto balcão que está sendo negociado. Inicialmente, será disponibilizado somente a opção Termo.
(C) Contrato	Código do contrato do produto registrado
(D) Situação	Lista pré-definida de situações em que a movimentação do registro da operação se encontra no sistema. Opções de movimentações possíveis para escolha: - Aprovado - Aprovado Provisoriamente pela Câmara de Derivativos - Cancelamento - Cedido - Contrato em Aberto - Liquidado Antecipadamente - Pendente de Confirmação pela Câmara de Derivativos - Rejeitado -Rejeitado Provisoriamente pela Câmara de Derivativos - Transferido - Vencido
(E) Valor Base	Valor Nocional da operação expresso em quantidade de moeda base, respeitando o valor mínimo equivalente à $ 1.000,00 com até 2 (duas) casas decimais.
(F) Número Protocolo	Código gerado automaticamente no registro da primeira ponta da operação.
Parte	
(G) Código	Preenchido *default* com o código do Participante de Registro logado no sistema
(H) Conta	Número da conta própria ou do cliente que é Parte na operação.
(I) Posição	Se a parte da operação é compradora ou vendedora do registro.
(J) Garantia	Indica se a Parte solicita garantia da Contraparte.
(K) Número da Operação	Código alfanumérico atribuído automaticamente no ato do registro.
(L) Número do Broker	Número gerado ao realizar a brokeragem da operação
(M) Funcionalidade	Lista pré-definida que indica a ação do Participante no sistema. Opções de ações possíveis para escolha: - **Cancelamento de Registro** - Correção - Transferência de Contas - Transferência de Posição - Cessão de Direito - Registro - Liquidação no vencimento - Liquidação Antecipada
Contraparte	
(N) Código	Número do PR contraparte do registro cadastrado.

(O) Conta	Número da conta própria ou do cliente que é Parte na operação.
(P) Posição	Se a contraparte da operação é compradora ou vendedora do registro.
(Q) Garantia	Indica se a contraparte solicita garantia da Parte.
(R) Data do Evento	Data em que se deseja realizar a pesquisa de movimentação.

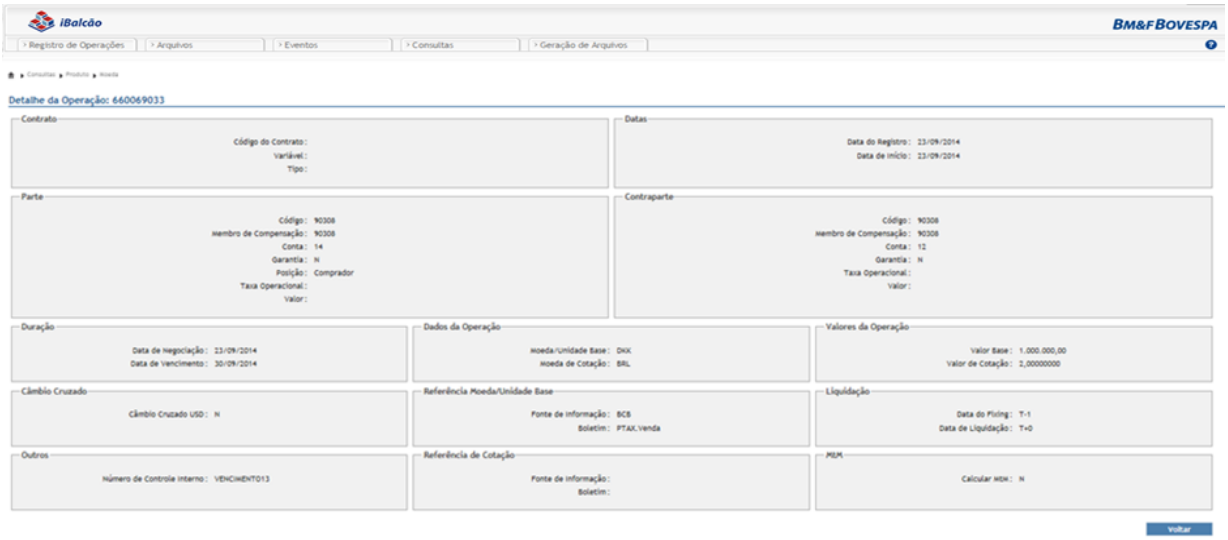
Após a consulta, o sistema trará as operações encontradas de acordo com os filtros selecionados. Caso nenhum campo seja informado, o sistema também realiza a pesquisa trazendo todas as movimentações do dia que estiverem na base, no grid de resultados do produto.



As opções para exportar o resultado da pesquisa estarão disponíveis na parte inferior da tela onde o usuário poderá optar pelo formato em XLS ou CSV:

Basta clicar em "**EXPORTAR XLS**" ou "**EXPORTAR CSV**" para que as caixas de diálogo auxiliem na gravação dos resultados.

É possível, após a consulta, selecionar a operação apresentada no grid de resultados para acessar os detalhes da mesma.

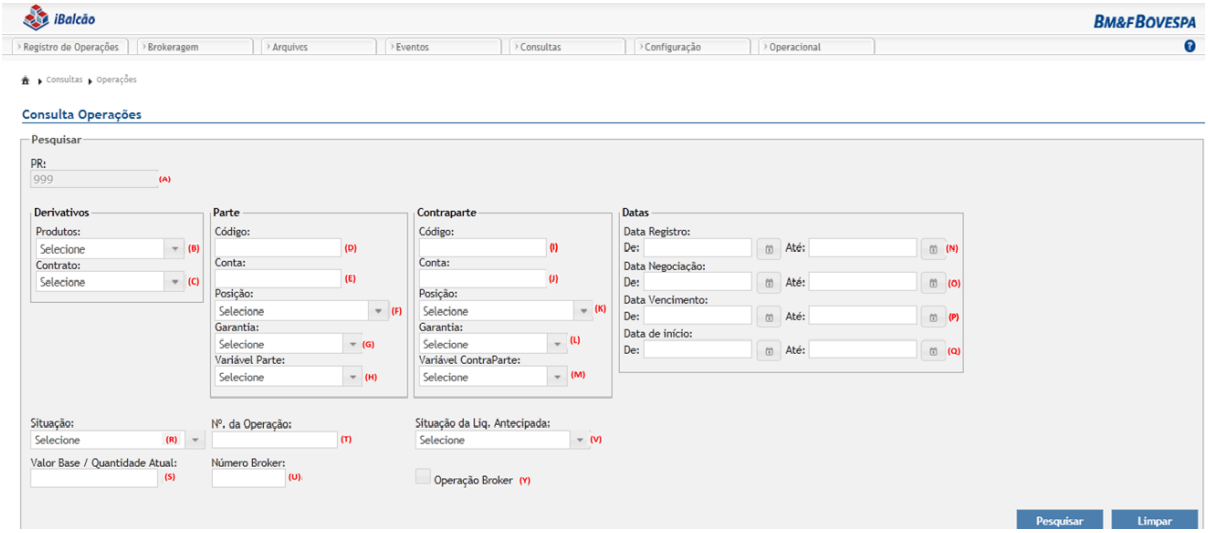


VOLTAR: retornar para a tela de resultados da Consulta.

4.2. Consulta de Operações

O acesso a essa consulta é realizado através do menu “Consultas”, opção “Operações”.

Seguindo a dinâmica de realização de pesquisa onde se pode realizá-la através do preenchimento de múltiplos campos, a consulta de operações também pode ser realizada com o preenchimento dos campos da tela abaixo ou sem informar nenhum:

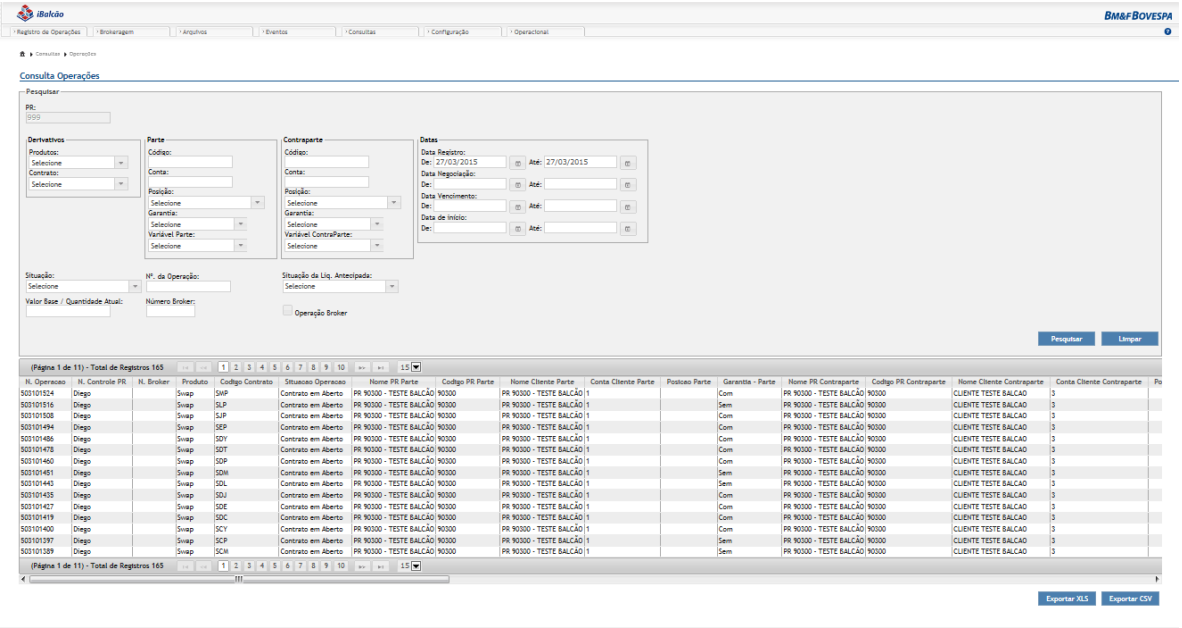


Segue abaixo o detalhamento e explicação do que se espera de cada campo:

Nome do Campo		Descrição
(A) PR		Apresenta *default* o código do Participante de Registro logado no sistema
(B) Produtos		Produto balcão que está sendo negociado. Inicialmente, será disponibilizado somente a opção Termo.
(C) Contrato		Código do contrato do produto registrado
Parte	**(D) Código**	Preenchido **default** com o código do Participante de Registro logado no sistema
	(E) Conta	Número da conta própria ou do cliente que é Parte na operação.
	(F) Posição	Se a parte da operação é compradora ou vendedora do registro.
	(G) Garantia	Indica se a Parte solicita garantia da Contraparte.
	(H) Variável	Indica a variável do contrato negociada pelo PR
Contraparte	**(I) Código**	Número do PR contraparte do registro cadastrado.
	(J) Conta	Número da conta própria ou do cliente que é Parte na operação.
	(K) Posição	Se a contraparte da operação é compradora ou vendedora do registro.
	(L) Garantia	Indica se a contraparte solicita garantia da Parte.
	(M) Variável	Indica a variável do contrato negociada pelo PR
(N) Data de Registro		Data em que o contrato foi registrado no sistema
(O) Data de Negociação		Data em que o contrato foi negociado entre PR x Cliente

(P) Data de Vencimento	Data do vencimento da operação
(Q) Data de Início	Data em que o contrato será iniciado
(R) Situação	Lista pré-definida de situações em que a movimentação do registro da operação se encontra no sistema. Opções de movimentações possíveis para escolha: **- Aprovado** **- Aprovado Provisoriamente pela Câmara de Derivativos** **- Cancelado** **- Cedido** **- Contrato em aberto** **- Liquidado Antecipadamente** **- Pendente de Confirmação pela Câmara de Derivativos** **- Rejeitado** **- Rejeitado Provisoriamente pela Câmara de Derivativos** **- Transferido** **- Vencido**
(S) Valor Base	Valor Nocional da operação expresso em quantidade de moeda base, respeitando o valor mínimo equivalente à $ 1.000,00 com até 2 (duas) casas decimais.
(T) Número da Operação	Código alfanumérico atribuído automaticamente no ato do registro.
(U) Número do Broker	Número gerado ao realizar a brokerage da operação
(v) Situação	Lista pré-definida de situações em que a movimentação do registro da operação se encontra no sistema. Opções de movimentações possíveis para escolha: **- Liq. Ant. - Anulada** **- Liq. Ant. - Aprovada** **- Liq. Ant. - Aprovação Provisória** **- Liq. Ant. - Pendente de Aprovação** **- Liq. Ant. - Rejeitada** **- Liq. Ant. - Rejeitada Provisória**

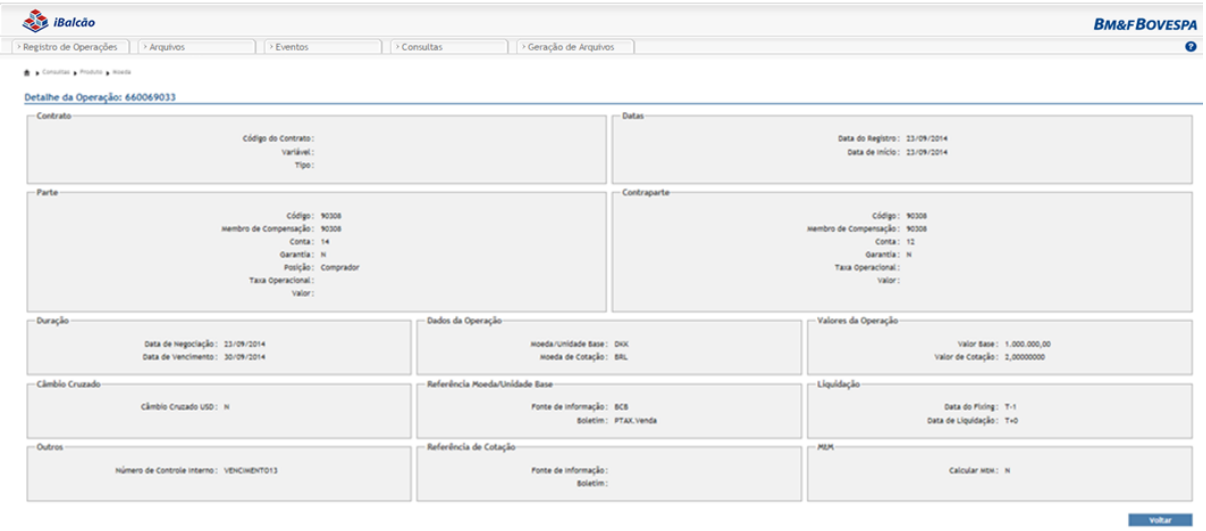
Após a consulta, o sistema trará as operações encontradas de acordo com os filtros selecionados. Caso nenhum campo seja informado, o sistema também realiza a pesquisa trazendo todas as operações que estiverem na base, na parte inferior da tela.



As opções para exportar o resultado da pesquisa estarão disponíveis na parte inferior da tela onde o usuário poderá optar em obtê-lo no padrão XLS ou CSV:

Basta clicar em "**EXPORTAR XLS**" ou "**EXPORTAR CSV**" para que as caixas de diálogo auxiliem na gravação dos resultados.

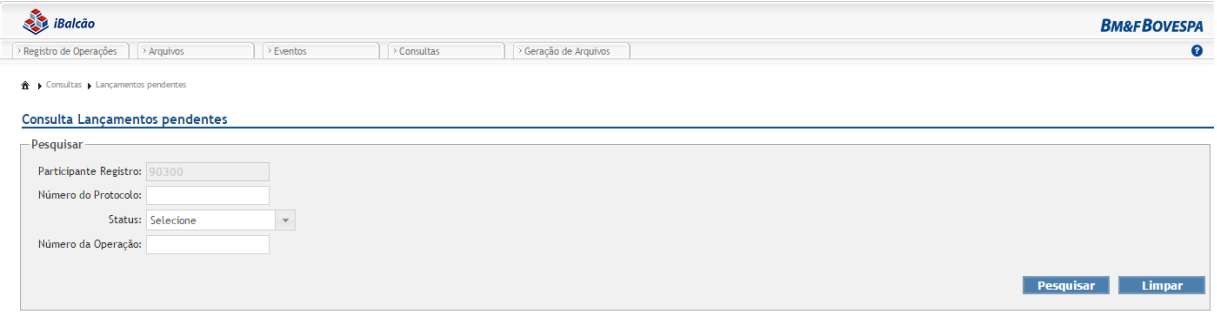
É possível, após a consulta, selecionar a operação apresentada no grid de resultados para acessar os detalhes da mesma.



VOLTAR: retornar para a tela de resultados da Consulta.

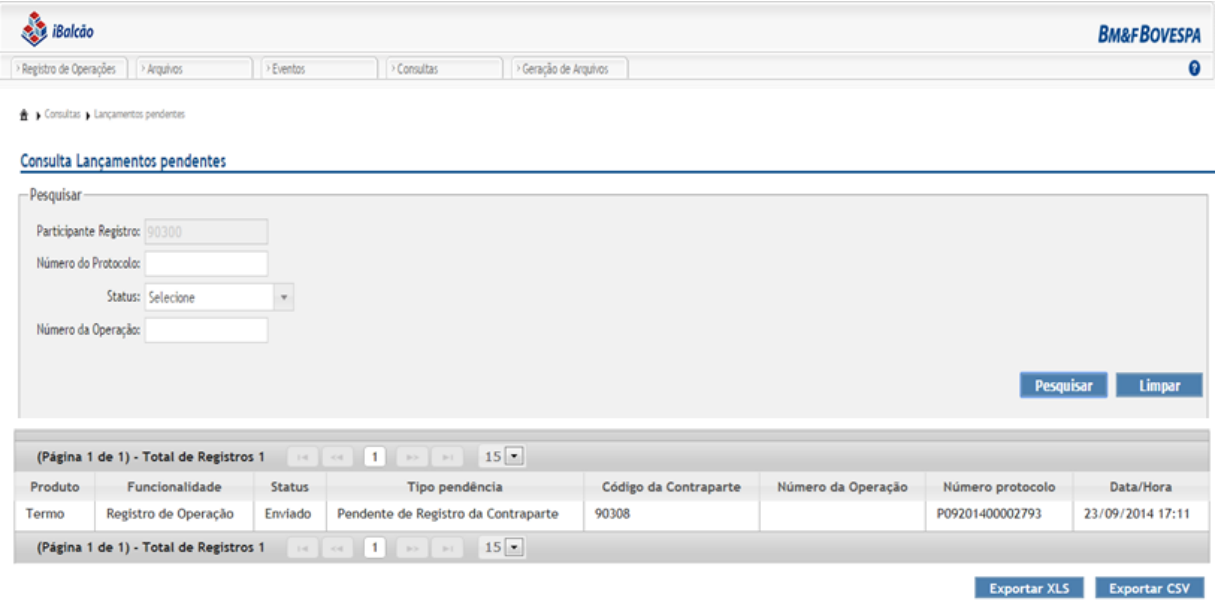
4.3. Consulta de Lançamentos Pendentes

Se selecionado a opção "**Lançamentos Pendentes**" no menu "Consultas" o participante poderá filtrar a consulta através dos campos para que apresente somente as operações conforme filtro. Caso o PR não informe nenhum filtro, serão apresentadas todas as operações pendentes de lançamento.

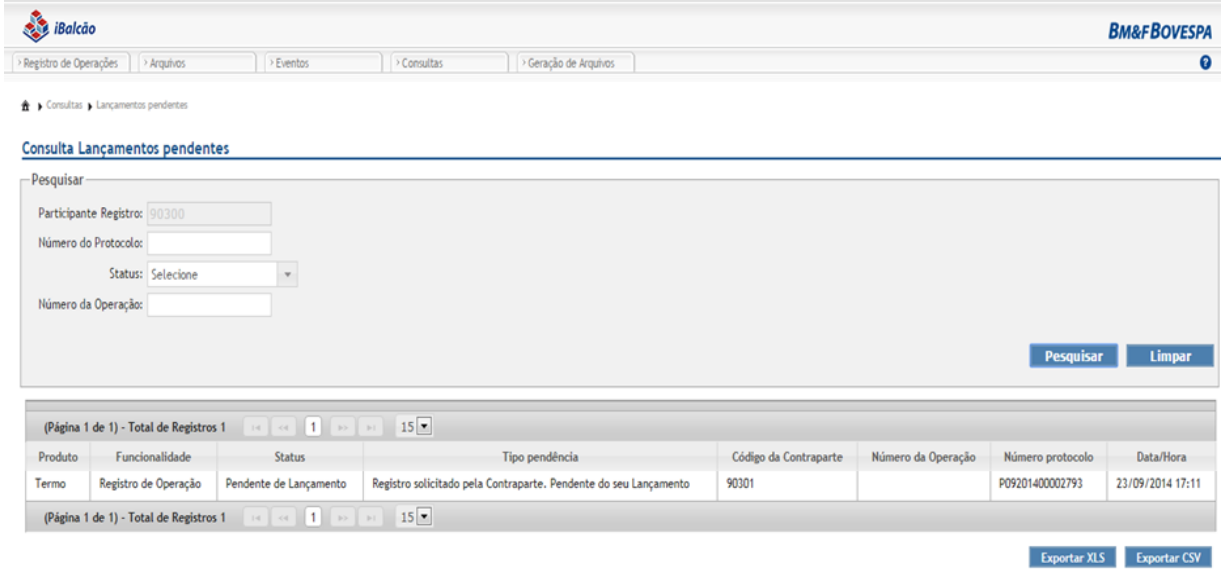


O sistema irá apresentar as operações pendentes conforme figura abaixo, diferenciando de visão da parte que já realizou o registro e visão da contraparte pendente de lançamento:

- Visão PR parte: no campo "tipo de pendência" será apresentado a mensagem "pendente de registro da contraparte"



- Visão PR contraparte: no campo "tipo de pendência" será apresentada a mensagem "Registro solicitado pela Contraparte. Pendente de lançamento"



As colunas apresentadas no grid da consulta de lançamentos pendentes são:

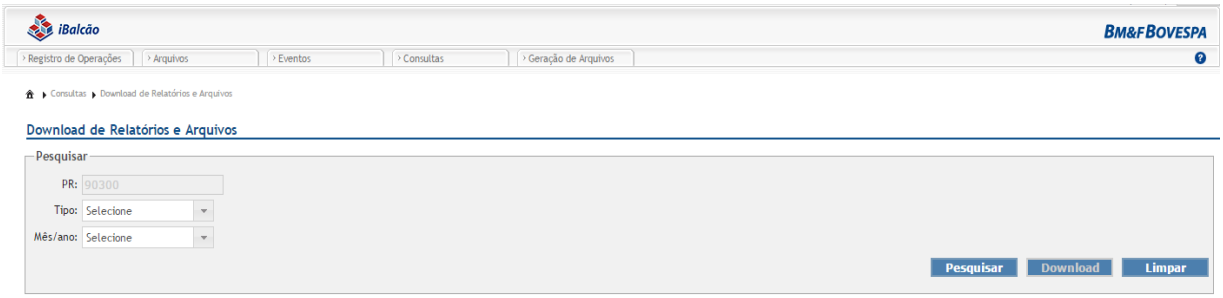
- **Produto** – apresenta o nome do produto pendente de lançamento;
- **Funcionalidade** – refere-se ao comando/evento realizado pela Contraparte (Registro, Liquidação Antecipada, Correção);
- **Status** – mensagem de "Pendente de Lançamento";
- **Tipo Pendência** – apresenta a descrição da pendência conforme funcionalidade realizada;
- **Código da Contraparte** – apresenta o número do código do Participante de Registro que realizou o lançamento;
- **Número da Operação** – apresenta o número da operação gerado na confirmação do registro para os casos de eventos realizados após o registro, caso contrário o campo aparece vazio;
- **Número do Protocolo** – apresenta o número do protocolo gerado no registro da primeira ponta da operação – somente para função de registro;
- **Data e Hora** – é apresentada a data e a hora do lançamento realizado pela Contraparte.

4.4. Download de Relatórios e Arquivos

Esta funcionalidade tem como objetivo disponibilizar os relatórios e arquivos aos Participantes referente às operações registradas no Sistema iBalcão. A BVMF disponibiliza por 15 dias corridos o Relatório de Movimentações do dia, o Relatório de Posições e o Relatório de MtM em formatos CSV, e o arquivo de Operações em formato txt.

No primeiro dia útil subsequente ao mês seguinte, o sistema disponibiliza o Relatório de Tarifação em formato CSV.

Na tela de Download de Relatórios e Arquivos o Participante pode realizar a busca dos seus relatórios e arquivos pela data que deseja consultar:



Após selecionar o tipo (relatório ou arquivo) e o mês/ano da pesquisa, o Participante clica no botão "pesquisar". O participante tem a possibilidade de realizar "*Download*".

- ***Relatório de Movimentações do dia***

Neste relatório são apresentados todas as operações registradas ou que sofreram eventos no dia anterior.

- ***Relatório de Posições***

O relatório de Posições deve apresentar todas as operações em aberto do Participante e dos Fundos de Investimento. São 04 relatórios disponibilizados diariamente com a posição do dia, sendo cada um referente às operações negociadas na data o sistema e 3 dias úteis anterior a data do sistema. Transformando o relatório de D-3, como definitivo e os demais provisórios.

- ***Relatório de MtM***

Este relatório é apresentado **SOMENTE** para operações NDF sem CCP, quando o Participante de Registro seleciona a opção "Sim" no campo "Calcula MtM".

A BVMF realiza o cálculo diariamente da exposição das operações em aberto.

- ***Relatório de tarifação***

Este relatório apresenta todas as tarifas do mês que serão cobradas no 10º dia útil do mês subsequente.

- ***Arquivo de Operações***

Este arquivo apresenta todas as operações realizadas pelo Participante.

5. Anexos

Anexo I - Moedas Base e Fontes de Informação

Moeda	Fonte de Informação	Boletim
Peso Argentino	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	WMReuters	Fechamento
Dólar Australiano	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	16:00h
	WMReuters	Fechamento
Libra Esterlina	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	16:00h
	WMReuters	Fechamento
Dólar Canadense	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	16:00h
	WMReuters	Fechamento
Peso Chileno	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	14:30h
	WMReuters	Fechamento
Peso Colombiano	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	15:00h
	WMReuters	Fechamento
Coroa Dinamarquesa	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	WMReuters	Fechamento
Euro	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	16:00h

	WMReuters	Fechamento
	Banco Central Europeu	Fechamento
Dólar de Hong Kong	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	WMReuters	Fechamento
Ringgit da Malásia	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	WMReuters	Fechamento
Peso Mexicano	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	16:00h
	WMReuters	Fechamento
Lira Turca	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	16:00h
	WMReuters	Fechamento
Dólar da Nova Zelândia	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	16:00h
	WMReuters	Fechamento
Rublo da Rússia	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	WMReuters	Fechamento
Dólar de Singapura	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	WMReuters	Fechamento
Rande da África do Sul	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	16:00h
	WMReuters	Fechamento
Coroa Sueca	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	WMReuters	Fechamento
Franco Suíço	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	16:00h

	WMReuters	Fechamento
Dólar dos Estados Unidos	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
		10:00h
		11:00h
		12:00h
		13:00h
	BOJ	Fechamento
	WMReuters	Fechamento
Won Sul-Coreano	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	WMReuters	Fechamento
Iene	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	16:00h
	WMReuters	Fechamento
	Banco Central do Japão	Fechamento
Yuan	BCB	PTAX Venda
		PTAX Compra
	Bloomberg	05:30h
	WMReuters	Fechamento

Anexo II - Moedas e Tipos de Cotação para NDF sem CCP

Moeda Base	Moeda Cotada	Descrição	Tipo de Cotação
Peso Argentino	Real Brasileiro	ARSBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Peso Argentino	USDARS	Paridade
Dólar Australiano	Real Brasileiro	AUDBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar Australiano	Dólar dos Estados Unidos	AUDUSD	Paridade
Libra Esterlina	Real Brasileiro	GBPBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Libra Esterlina	Dólar dos Estados Unidos	GBPUSD	Paridade
Dólar Canadense	Real Brasileiro	CADBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Dólar Canadense	USDCAD	Paridade
Peso Chileno	Real Brasileiro	CLPBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Peso Chileno	USDCLP	Paridade
Peso Colombiano	Real Brasileiro	COPBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Peso Colombiano	USDCOP	Paridade
Coroa Dinamarquesa	Real Brasileiro	DKKBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Coroa Dinamarquesa	USDDKK	Paridade
Euro	Real Brasileiro	EURBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Euro	Dólar dos Estados Unidos	EURUSD	Paridade
Dólar de Hong Kong	Real Brasileiro	HKDBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Dólar de Hong Kong	USDHKD	Paridade
Ringgit da Malásia	Real Brasileiro	MYRBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Ringgit da Malásia	USDMYR	Paridade
Peso Mexicano	Real Brasileiro	MXNBRL	Taxa de Câmbio

			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Peso Mexicano	USDMXN	Paridade
Lira Turca	Real Brasileiro	TRYBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Lira Turca	USDTRY	Paridade
Dólar da Nova Zelândia	Real Brasileiro	NZDBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar da Nova Zelândia	Dólar dos Estados Unidos	NZDUSD	Paridade
Rublo da Rússia	Real Brasileiro	RUBBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Rublo da Rússia	USDRUB	Paridade
Dólar de Singapura	Real Brasileiro	SGDBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Dólar de Singapura	USDSGD	Paridade
Rande da África do Sul	Real Brasileiro	ZARBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Rande da África do Sul	USDZAR	Paridade
Coroa Sueca	Real Brasileiro	SEKBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Coroa Sueca	USDSEK	Paridade
Franco Suíço	Real Brasileiro	CHFBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Franco Suíço	USDCHF	Paridade
Dólar dos Estados Unidos	Real Brasileiro	USDBRL	Taxa de Câmbio
Won Sul-Coreano	Real Brasileiro	KRWBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Won Sul-Coreano	USDKRW	Paridade
Iene	Real Brasileiro	JPYBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Iene	USDJPY	Paridade
Yuan	Real Brasileiro	CNYBRL	Taxa de Câmbio
			Câmbio Cruzado USD
Dólar dos Estados Unidos	Yuan	USDCNY	Paridade

Anexo III – Combinações de Contratos disponíveis

Contrato	Variável
SCP	DOL X PRE
SCJ	DOL X TJL
SCL	DOL X IAP
SCM	DOL X IGM
SCP	DOL X pre
SCY	DOL X JPY
SDC	DI1 X DOL
SDE	DI1 X REU
SDJ	DI1 X TJL
SDL	DI1 X IAP
SDM	DI1 X IGP-M
SDP	DI1 X PRE
SDT	DI1 X TR
SDY	DI1 X JPY
SEP	EUR X PRE
SJP	PRE X TJL
SLP	IAP X PRE
SMP	IGP-M X PRE

Anexo IV - Indexadores e Fontes de Informação/Boletim

Indexador	Fonte de Informação	Boletim
DOL	BCB	T1 - PTAX VENDA
		T2 - PTAX COMPRA
REU	BCB	T1 - PTAX VENDA
		T2 - PTAX COMPRA
	BCE	T3 - EURO BCE
JPY	BCB	T1 - PTAX VENDA
		T2 - PTAX COMPRA
PRE	-	-
DI1	-	-
TJLP	-	-

TR	-	-
IGP-M	-	-
IPCA	-	-