

Manual de Operações

Swap



Versão: 29/06/2020

Atualizado em: 28/10/2020

Conteúdo

Atualizações da Versão	5
Introdução ao Swap	55
Conhecendo o Produto	56
Ações dos botões das telas	59
Lançamento	61
Registro de Contrato - Pagamento Final	62
Registro de Contrato - Fluxo Constante	76
Registro de Contrato - Fluxo Não Constante	88
Registro Fluxo de Caixa Não Constante	100
Registro de Fluxo de Datas de Verificação	105
Registro de Pagamento de Prêmio	108
Registro de Parâmetros para Disparo de Reset	111
Registro de Curvas Marcadas a Mercado	115
Registro de Reset	117
Intermediação de Contrato	121
Registro de Reset - Alterações	123
Alteração de Contrato - Pagamento Final	127
Alteração de Contrato - Fluxo Constante	136
Alteração de Contrato - Fluxo não Constante	144
Alteração de Fluxo de Caixa Não Constante	152
Alteração de Fluxo de Data de Verificação	155
Alteração de Pagamento de Prêmio	157
Antecipação de Contratos	160
Cessão de Contrato	167
Cancelamento de Contrato	174
Atualização de PU/Fator	176
Registro de Taxas de Juros Mercado Internacional	179
Exercício de Opção	181
Consulta	187
Características de Contrato de Swap	188
Agenda de Eventos	196
Fluxo não Constante	198
Histórico de Parâmetros Para Disparo de Reset	202
Histórico de Curvas Marcadas a Mercado	204

Histórico Reset.....	207
Resumo de Contratos	209
Contratos com Opção de Arrependimento	210
Contratos de Swaption/Compound.....	211
Histórico de Alteração de Contratos	212
Consulta Tipo Classe	214
Curvas Não-Calculadas (VCP).....	215
Moedas	217
Taxas de Juros Nacionais	219
Taxas de Juros Internacionais	221
Índices	224
Índices de Preço.....	224
Índices Nacionais	226
Índices Internacionais.....	227
ETFs	231
Futuro de Índices.....	239
Outros Índices	241
Futuro de Taxas de Juros	244
Futuro de Moedas	245
Futuro de Mercadorias	246
Futuro de Ativos.....	248
Ações Nacionais	249
Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira).....	255
Ações Internacionais.....	257
Ativos.....	273
Estratégia.....	283
Paridade de Moedas	284
Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais.....	288
Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	291
Commodity.....	296
Títulos Públicos Nacionais	299
Bloqueio e Desbloqueio VCP	300
Informações Adicionais	301
Código dos contratos	302
Prazos para Alteração.....	303
Contratos com Funcionalidades	304
Cruzamento de Funcionalidades x Operações.....	309

Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 1	310
Contratos com limitador	312
Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2	313
Cancelamento referente aos prêmios e comissões	315
Registro Contrato com curva VCP	317
Regras de Negócios.....	318
Metodologia de Cálculo.....	319
Formação dos Códigos do Instrumento Financeiro Swap	320
Glossário.....	321

Atualizações da Versão

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/06/2020	28/10/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15496 GMATDEA ID Equity
29/06/2020	28/10/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15493 IGTA3 BZ Equity
29/06/2020	28/10/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15492 SKYY UP Equity; 15495 IXJ US Equity
29/06/2020	28/10/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15490 VRTX UW Equity; 15491 DXCM UW Equity; 15497 EQX US Equity
29/06/2020	07/10/2020	Ações Nacionais	Alteração do ativo: 5074 - NATU3 para NTCO3 .
29/06/2020	07/10/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15449 SPXESUP Index.
29/06/2020	07/10/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15468 GME US Equity e 15488 CLF US Equity.
29/06/2020	28/09/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15448 MATRDHC ID Equity.
29/06/2020	28/09/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 15433 BRFSBZ 5 ¾ 09/21/50 REGS CORP.
29/06/2020	28/09/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15430 QQQ UP Equity; 15431 MCHI UN Equity e 15432 Ewt up equity.
29/06/2020	14/09/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15419 JJN US Equity; 15421 XHB US Equity; 15423 DBA US Equity e 15429 SHE US Equity.
29/06/2020	14/09/2020	Futuro de Mercadorias	Inclusão do Tipo/Classe: 15428 Mini Futuro de Prata.
29/06/2020	14/09/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15425 BIDI4 BZ Equity.
29/06/2020	14/09/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15420 BLMN US Equity; 15422 NGD US Equity e 15424 CCJ US Equity
29/06/2020	01/09/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15417 ICLN US Equity e 15418 UUP UP Equity.
29/06/2020	25/08/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15388 KWEB US Equity e 15408 VNQ US Equity.
29/06/2020	25/08/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15409 BTGPGRD KY Equity; 15410 BTGPGA1 KY Equity; 15411 BTGPA1A KY Equity e 15412 BTGPGRD KY Equity.
29/06/2020	25/08/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15384 GILD US Equity; 15385 AZN US Equity; 15413 NEM UM Equity; 15414 GOLD UM Equity; 15415 AU UM Equity e 15416 AEM UM Equity.
29/06/2020	12/08/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15344 VSTA US Equity; 15347 ARCE US Equity; 15348 FM CN Equity e 15364 TAST US Equity.
29/06/2020	12/08/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15345 TLT US Equity
29/06/2020	31/07/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15331 SHOP UM Equity e 15332 SQ UM Equity.
29/06/2020	31/07/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15284 NEOE3 BZ Equity.
29/06/2020	31/07/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 15305 RDEDOR 4 ½ 01/22/30 REGS CORP e 15306 BANVOR 4 3/8 07/29/25.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/06/2020	31/07/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15285 DSI UP Equity e 15324 GDXJ US Equity.
29/06/2020	31/07/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14544 CSTREND Index; 15327 MSUSMPT6 Index; 15328 MSFDVT12 Index; 15329 MSFDMSV9 Index e 15330 MSFDMS11 Index.
29/06/2020	31/07/2020	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15325 MSUSBS17 Index e 15326 MSUSBZ20 Index. Exclusão do Tipo/Classe: 14544 CSTREND5 Index.
29/06/2020	22/07/2020	Índices Nacionais Índices Internacionais ETFs	Alteração na descrição sobre o “Cupom Limpo” no campo “Informações Necessárias”.
29/06/2020	14/07/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12567 NDX Index.
29/06/2020	01/07/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15166 USFD US Equity e 15184 TECK US Equity
29/06/2020	01/07/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15244 CIEQPU01 Index; 15245 CIEQDUV3 Index e 15246 CIEQCUOI Index.
29/06/2020	01/07/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15164 DBB US Equity; 15185 ESGU US Equity; 15186 ESGE US Equity; 15187 ESGD US Equity; 15204 MCHI UP Equity e 15224 URTH US Equity.
29/06/2020	29/06/2020	Alteração de Contrato	Informação de que podem ser realizadas mais de uma alteração do contrato no dia, conforme divulgado no comunicado 019/2020-VPC.
29/06/2020	29/06/2020	-Registro de Contrato – Pagamento Final -Registro de Contrato – Fluxo Constante -Registro de Contrato – Fluxo não Constante	Alteração na descrição dos campos “Cupom Limpo” e “Data de Cotação” do bloco: Cupom Limpo/Data Cotação – Parte/Contraparte.
29/06/2020	29/06/2020	Alteração de Contrato – Pagamento Final	Alteração na descrição dos campos “Cupom Limpo” e “Data de Cotação” do bloco: Cupom Limpo/Data Cotação – Parte/Contraparte.
29/06/2020	29/06/2020	- Ações Nacionais - Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira)	Alteração na descrição sobre o “Cupom Limpo” no campo “Informações Necessárias”.
29/06/2020	29/06/2020	Ações Internacionais	Alteração na descrição sobre “Denominação” no campo “Informações Necessárias”.
29/06/2020	29/06/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15065 IWM UP Equity; 15124 RSX US Equity e 15127 SIL US Equity.
29/06/2020	29/06/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 15104 BRFSBZ 4 7/8 01/24/30 REGS CORP e 15105 AEGEBZ 5 ¾ 10/10/24 REGS CORP.
29/06/2020	29/06/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15125 FNV US Equity e 15126 GOLD US Equity.
29/06/2020	29/06/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15144 VVAR3 BZ Equity.
17/02/2020	26/05/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15084 F2036CP BZ Equity.
17/02/2020	18/05/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15066 BKLN IS Equity.
17/02/2020	14/05/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15048 AGI US Equity e 15049 AEM US Equity.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
17/02/2020	14/05/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15050 MTRE3 BZ Equity.
17/02/2020	14/05/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15064 XLV UP Equity.
17/02/2020	06/05/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15044 XPH UP Equity.
17/02/2020	06/05/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 15045 BEEFBZ 6 ½ 09/20/26 REGS CORP.
17/02/2020	28/04/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15025 YDUQ3 BZ Equity; 15026 COGN3 BZ Equity.
17/02/2020	28/04/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15024 EWZ UP Equity.
17/02/2020	23/04/2020	Taxas de Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14967 FEDL01 Index.
17/02/2020	23/04/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14904 CRAK US Equity; 14965 FEZ US Equity; 14968 IEF US Equity; 14988 XOP US Equity; 14990 GREK US Equity; 14991 EWU US Equity; 15004 EWUS US Equity; 15007 IVVB11 BZ Equity.
17/02/2020	23/04/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14985 BRCR11 (CNPJ 08.924.783/001-0).
17/02/2020	23/04/2020	Futuro de Mercadorias	Inclusão do Tipo/Classe: 14925 Futuro de Palladium; 15006 Futuro de Platina.
17/02/2020	23/04/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14924 PETBRA 5 ¾ 02/01/29 CORP; 14944 ARGENT 2 12 12/31/38 GOVT; 14966 SBSPBZ 6 ¼ 16/12/20 REGS CORP; 14969 BVMFBZ 5 ½ 07/16/20 REGS CORP.
17/02/2020	23/04/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14970 TOTS3 BZ Equity
17/02/2020	23/04/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14984 ENIC US Equity; 14986 JNJ UN Equity; 15005 NLMK LI Equity.
17/02/2020	23/04/2020	Ações Internacionais	Atualização de participação para Ações Internacionais
17/02/2020	15/04/2020	Registro de Contrato - Pagamento Final	Ajuste nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
17/02/2020	23/03/2020	Ações Nacionais	Atualização de participação para Ações Nacionais
17/02/2020	12/03/2020	Índices Internacionais (ETF)	Atualização de proventos para ETF
17/02/2020	27/02/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14824 VVNT US Equity; 14825 SCR CN Equity; 14864 CNE CN Equity e 14885 FCX US Equity.
17/02/2020	27/02/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14823 PETRA 6.9 03/19/49 CORP; 14843 CSNABZ 6 34 01/28/28 REGS-CORP; 14846 ELEBRA 4 5/8 02/04/2030 REGS-CORP e 14884 4 5/8 PERP REGS-CORP.
17/02/2020	27/02/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14847 IYW UP Equity; 14848 JJC US Equity; 14849 OESA GR Equity;

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
			14850 TUR US Equity; 14886 SLX US Equity e 14887 COPX US Equity.
17/02/2020	17/02/2020	- Contratos com funcionalidade - Exercício de Opção	Alteração do funcionamento da funcionalidade da opção de arrependimento, exclusivamente no vencimento, conforme comunicado no 002/2020-VPC.
28/05/2019	20/01/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14805 PETBRA 6 7/8 01/20/40 CORP; 14806 HIDRVS 5.95 01/24/25 CORP
28/05/2019	20/01/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14804 CSEAGG20 Index.
28/05/2019	20/01/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14763 ACEL/WS US Equity; 14783 GM UN; 14803 UBER UN Equity
28/05/2019	06/01/2020	Taxa de Juros Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14743 Selic REFIS.
28/05/2019	17/12/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14723 BMEBMZ 9 5/8 07/16/20 REGS-CORP
28/05/2019	12/12/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14683 BAC US Equity; 14684 SCHW US Equity; 14685 KO UN Equity e 14686 XP US Equity.
28/05/2019	10/12/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14663 V UN Equity.
28/05/2019	09/12/2019	Taxa de Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14624 EONIA Index.
28/05/2019	09/12/2019	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14643 MJ US Equity.
28/05/2019	02/12/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14623 BAKIDE 7.45 11/15/29 CORP.
28/05/2019	02/12/2019	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14544 CSTREND5 Index.
28/05/2019	02/12/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14583 GOOGL UW Equiy.
28/05/2019	28/11/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14603 NEXA RESOURCES SA.
28/05/2019	21/11/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14543 DESP US Equity.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2019	11/11/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14503 BA US Equity
28/05/2019	01/11/2019	Registro de Contrato – Pagamento Final	Alteração na descrição do campo “Valor (R\$)”
28/05/2019	23/10/2019	Taxa de Juros Nacionais	Inclusão no campo “ Informações Necessárias” sobre o Percentual da Curva.
28/05/2019	22/10/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14444 MVFPO 6.748 06/01/34 REGS – CORP.
28/05/2019	22/10/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14423 FTCH US Equity e 14443 V US Equity.
28/05/2019	15/10/2019	Lançamentos	Alteração na descrição do campo “Adesão a Contrato”.
28/05/2019	11/10/2019	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14400 BZRFIB5+ Index; 14401 BZRFIRFM Index e 14402 BZRFIMAB Index.
28/05/2019	10/10/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14391 IB5M 11 BZ Equity; 14392 IRFM11 BZ Equity e 14393 IMAB11 BZ Equity
28/05/2019	10/10/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14351 BONSUC 9 1/4 11/03/20 REGS - CORP.
28/05/2019	10/10/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14331 MCD UN Equity.
28/05/2019	12/09/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14312 IJR US Equity.
28/05/2019	12/09/2019	Futuro de Mercadorias	Inclusão do Tipo/Classe: 14310 FUTURO DE AÇUCAR; 14311 FUTURO DE ZINCO.
28/05/2019	06/09/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14291 SBS US Equity.
28/05/2019	27/08/2019	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14272 MGOIEAA LX Equity.
28/05/2019	27/08/2019	Futuro de Taxas de Juros	Inclusão do Tipo/Classe: 14271 Futuro de Cupom IPCA (DAP).
28/05/2019	27/08/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14250 GDX US Equity.
28/05/2018	15/08/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14159 SPXU US

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
			Equity e 14190 QID US Equity.
28/05/2018	15/08/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14191 7974 JT; 14210 IFS US Equity e 14230 KER FP Equity.
28/05/2018	15/08/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14231 BIDI11 BZ Equity.
28/05/2018	26/07/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13995 EXITO CB Equity.
28/05/2018	26/07/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14110 USIM 5 7/8 07/18/26 REGS – CORP.
28/05/2018	26/07/2019	Indices Internacionais (ETF)	Inclusão dos Tipos/Classe: 14090 SQQQ US Equity e 14130 SRTY US EQUITY.
28/05/2018	26/07/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14075 TAEE11 BZ Equity.
28/05/2018	24/06/2019	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: 13993 WORK US Equity; 13990 DIS UN Equity
28/05/2018	24/06/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 13992 JSLGBZ 7 3/4 07/26/24 REGS - CORP
28/05/2018	24/06/2019	Indices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13991 Futuro de DXY Index
28/05/2018	18/06/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 13972 UNIGEL 10 1/2 01/22/24 REGS - Corp
28/05/2018	18/06/2019	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: 13973 SUZ US Equity; 13951 WCAGY US Equity
28/05/2018	18/06/2019	Cotas de Fundos de Investimento Internacional	Inclusão dos Tipos/Classe: 13971 PGIPVA ID Equity; 13970 MORAMAH LX Equity
28/05/2018	18/06/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13932 ENAT3 BZ Equity
28/05/2018	13/05/2019	Moedas	Melhoria da descrição das Informações Necessárias.
28/05/2018	13/05/2019	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13789 EURBARR LX Equity
28/05/2018	13/05/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 13809 PDCAR 7 1/8

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
			06/10/21 CORP; 13829 KLAB 5 3/4 04/03/29 CORP; 13930 BUENOS 9 58 04/18/28 CORP; 13931 BUENOS 6 12 02/15/23 CORP

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

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2018	21/01/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 13510 EDNAR 9 ¾ 10/25/22 Corp; 13509 BUENOS 7 78 06/15/27 Corp; 13490 BUENOS 4 05/15/35 Corp; 13489 ARGENT 2 12 12/31/38 Corp
28/05/2018	26/12/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13389 FSD11 (CNPJ 16.543.270/0001-89)
28/05/2018	26/12/2018	Futuro de Moedas	Inclusão do Tipo/Classe: 13409 Futuro de CHF
28/05/2018	06/12/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 9255 FCFS US Equity
28/05/2018	04/12/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13309 STNE US Equity; 13349 SE US Equity
28/05/2018	04/12/2018	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13329 MSDIUSP7 Index
28/05/2018	04/12/2018	Cotas de Fundo Nacional	Inclusão do Tipo/Classe: 13370 AQLL11 (CNPJ 13.555.918/0001-49); 13369 ARFI11B (CNPJ 14.069.202/0001-02).
28/05/2018	22/11/2018	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13289 GSIS150B Index.
28/05/2018	22/11/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13290 GSGLCEE LX Equity.
28/05/2018	14/11/2018	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13299 SPXT10UE Index.
28/05/2018	14/11/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13269 AMZN UW Equity; 13270 BABA UN Equity.
28/05/2018	14/11/2018	Ações Nacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: 13250 HAPV3 BZ Equity; 13251 POMO4 BZ Equity; 13252 MGLU3 BZ Equity; 13253 STBP3 BZ Equity.
28/05/2018	31/10/2018	Índices Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: 13211 CPURNSA Index; 13189 ENHABDAP Index; 13108 VGT US Equity; 13109 JNK US Equity
28/05/2018	31/10/2018	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: 13209 CRESY US Equity; 13210 CEPU US Equity; 13149 AGG US Equity; 13129 BNR GR Equity

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2018	31/10/2018	Registro de Fluxo de Datas de Verificação	Melhoria da descrição dos campos “Quantidade de Datas e Verificação Parte” e “Quantidade de Datas de Verificação Contraparte”.
28/05/2018	28/09/2018	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13107 BNPIMOMA Index
28/05/2018	26/09/2018	Índices	Separação de tipos de Índices.
28/05/2018	26/09/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13088 ACBFF US Equity e 13067 LINU GR Equity
28/05/2018	26/09/2018	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/ Classe: 13047 SMLS3 BZ Equity.
28/05/2018	05/09/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13027 DIICELC LX Equity.
28/05/2018	05/09/2018	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 13007 BUENOS 10 7/8 01/26/21 REGS Corp; 12887 BUENOS 9 1/8 03/16/24.
28/05/2018	30/08/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 12988 EFJPFU5E Index; 12987 EFJPFE5N Index
28/05/2018	28/08/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12969 MSUEGAH LX Equity; 12968 ALSFFCT LX Equity; 12967 MSGOPAH LX Equity.
28/05/2018	28/08/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12950 GLP UP Equity
28/05/2018	28/08/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 8166 SX7E Index; 12949 SOLWGOAL Index; 12948 BNPIECFT Index; 12947 BNPIMAD5 Index; 12927 BNPICASE Index.
28/05/2018	10/08/2018	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 12807 CMIGBZ 9 ¼ 12/05/24 (ISIN USP2205LAT28)
28/05/2018	10/08/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12867 NH2ADRC FP Equity; 12847 ABMGA2A LX Equity
28/05/2018	30/07/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 12767 QQQ UQ Equity.
28/05/2018	30/07/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12787 MALLPLAZ CI Equity.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2018	30/07/2018	Registro de Contrato - Fluxo Não Constante	Exclusão das opções Índices e Índices de Preços na descrição do campo "Categoria".
28/05/2018	19/07/2018	Ativos	Inclusão dos Tipo/Classe: 12707 VOTORA 4 ¾ 06/17/24 CORP; 12647 RAILBZ 5 7/8 01/08/25 CORP – REGS
28/05/2018	19/07/2018	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classes: 12568 PX US Equity; 12667 CRM US Equity
28/05/2018	19/07/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 12567 NDX Index
28/05/2018	19/07/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12727 MSGBRCA LX Equity
28/05/2018	02/07/2018	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão dos Tipo/Classe: 12610 SCHGCAH LX Equity; 12609 OMEAEHA ID Equity; 12608 NORMABP LX Equity; 12607 MGOIAEA LN Equity; 12588 GAMSCOE ID Equity; 12587 BKRSPEA LX Equity; 12638 CSGRBHE LX Equity; 12637 JPGIAEA LX Equity; 12636 JPMECAA LX Equity; 12635 JUPLEUR LX Equity; 12634 LEODEUB LX Equity; 12633 MERGAAA LX Equity; 12632 NIMEHYB LX Equity; 12631 NOCEBPE LX Equity; 12630 PFSECPC LX Equity; 12629 SCIEHYA LX Equity; 12628 WAMOAHE ID Equity; 12627 XCRER1C LX Equity.
28/05/2018	06/06/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 12447 GLOBAL X MSCI ARGENTINA ETF
28/05/2018	06/06/2018	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipo/Classe: 12507 BIDU US Equity; 12487 SCCO US Equity; 12467 BOX US Equity
28/05/2018	28/05/2018	Lançamentos – Antecipação de Contratos	Alteração no comportamento das antecipações de derivativos com Redutor do Risco de Crédito, conforme divulgado no COMUNICADO EXTERNO 006/2018-VPC, 008/2018-VPC, 005/2018 – VPC e 012/2017 – DN.
29/01/2018	08/05/2018	Registro de Contrato – Pagamento Final	Melhoria da descrição do campo "Valor Base"
29/01/2018	08/05/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 12327 EZU US Equity
29/01/2018	08/05/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12411 PAC US Equity; 12387 SPOT US Equity; 12347

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
			SUPV US Equity
29/01/2018	08/05/2018	Moedas	Inclusão do Tipo/Classe: 12367 Cólón costarriquenho Melhoria da Descrição de Critério de Cálculo de PU ou de Fator e inclusão de Informações Necessárias.
29/01/2018	08/05/2018	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 12427 LIGTBZ 7 ¼ 05/03/23 Corp – REGS
29/01/2018	16/04/2018	Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo Não Constante	Melhoria da descrição do campo "Data Vencimento" e "Data Operação".
29/01/2018	14/03/2018	Taxa de Juros Nacionais	Melhoria do Critério de Cálculo de PU ou de Fator
29/01/2018	14/03/2018	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipo/Classe: 12207 6758 JT Equity; 12208 BBVS SM Equity; 12267 SQM US Equity; 12307 LTM US Equity; 12187 FCFE18 MM Equity; 12167 CAAP US Equity; 12166 ARCO US Equity.
29/01/2018	14/03/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 12228 TPX Index
29/01/2018	14/03/2018	Cotas de Fundos de Investimento	Inclusão do Tipo/Classe: 12247 HEJSA2J LX Equity
29/01/2018	05/03/2018	Taxas de Juros Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12227 Fator IPCA – BNDES e melhoria das informações necessárias.
29/01/2018	20/02/2018	Taxas de Juros Nacionais	Melhoria das informações necessárias.
29/01/2018	08/02/2018	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 12085 VXX US Equity, 12126 SPECFR6P e 12127 SP5LVI.
29/01/2018	08/02/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12165 PAGS US Equity e 12105 SFTBY US Equity
29/01/2018	29/01/2018	Registro de Contrato - Pagamento Final	Melhoria nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
29/01/2018	29/01/2018	Registro de Contrato - Pagamento Final Registro de Contrato - Fluxo Constante Registro de Contrato - Fluxo Não	Alteração de tela de registro, melhoria da descrição do campo PU inicial/ cupom limpo e inclusão do campo Data de Cotação Final – Termo, conforme o comunicado 008/2017 – DN.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
		Constante Alteração de Contrato - Pagamento Final Alteração de Contrato - Fluxo Constante Alteração de Contrato - Fluxo não Constante	
11/09/2017	16/01/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12044 FCAU UN Equity
11/09/2017	08/01/2018	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 12125 GSHPBR 10 08/10/26
11/09/2017	04/01/2018	Ações Internacionais	Correção da Curva VCP 12044 .
11/09/2017	03/01/2018	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12084 GICSAB MM Equity
11/09/2017	27/12/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12064 MAUÁ CAPITAL P FIM CP IE
11/09/2017	27/12/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11985 FIHO12 MM Equity
11/09/2017	27/12/2017	Taxa de Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12024 LIBOR – FRANCO SUIÇO
11/09/2017	27/12/2017	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12004 ITUB3
11/09/2017	27/12/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12047 TCEHY US Equity, 12044 FCAU UN Equity, 12045 JD US Equity e 12046 TTWO US Equity.
11/09/2017	19/12/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 10941 BRAZIL REALTY FII
11/09/2017	19/12/2017	Commodity	Inclusão do Tipo/Classe: 11984 LOAHDY LME Comdty e 11964 FUTURO DE PRATA
11/09/2017	05/12/2017	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 11963 CMIGBZ 9 ¼ 12/05/24 Corp
11/09/2017	05/12/2017	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11923 SUZB3 BZ Equity e 11943 SAPR11 BZ Equity
11/09/2017	27/11/2017	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11903 SAPR4 BZ Equity
11/09/2017	27/11/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11883 ATTO US Equity e Melhoria nas informações necessárias.
11/09/2017	27/11/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11743 PINEEHA ID Equity
11/09/2017	10/11/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11863 GLO LN Equity e 11843 LOMA US Equity
11/09/2017	01/11/2017	Ações Internacionais	Correção do nome do Tipo/Classe 11783 .
11/09/2017	25/10/2017	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 11803 AZULSA 5 7/8 10/26/24 Corp - REGS
11/09/2017	25/10/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11783 CDB US Equity
11/09/2017	25/10/2017	Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 11804 ECH US Equity
11/09/2017	09/10/2017	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11744 FUNO11 MM Equity
11/09/2017	09/10/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11763 NFLX US Equity
11/09/2017	09/10/2017	Antecipação de Contratos	Melhoria da visão geral da função e melhoria da descrição dos campos Fator para Antecipação (Ponta1) e (Ponta 2)
11/09/2017	06/10/2017	Registro Fluxo de Caixa Não Constante	Melhoria da descrição do campo "Taxa Juros"

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
11/09/2017	19/09/2017	Registro Fluxo de Caixa Não Constante	Melhoria da descrição do campo "Taxa Amortização"
11/09/2017	12/09/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11684 SNH GY Equity e 11685 SNH GR Equity
11/09/2017	11/09/2017	Características de Contrato de Swap	Inclusão dos campos "Sistema Origem" e "Código IF Sistema Origem".
29/05/2017	01/09/2017	Índices Ações Nacionais	Melhoria das Informações Necessárias.
29/05/2017	30/08/2017	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11642 ODPV3 BZ Equiy
29/05/2017	14/08/2017	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 11623 VISTAA MM Equity e 11622 TRICOT CI Equity

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
21/09/2015	21/10/2015	Taxas de Juros Nacionais	Inclusão do item “a) Caso o fixing seja diferente do vencimento, informa-lo no campo “Denominação” (D-1,...,D-5)” no campo de informações necessárias.
21/09/2015	21/09/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 10090 BCOBMG 9.95 11/05/19 Corp e 10091 CSNABZ 6 7/8 09/21/19 Corp.
21/09/2015	13/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 10070 OO2FIM BZ EQUITY.
21/09/2015	08/10/2015	Ações Internacionais	Inclusão do texto “Obs.:” e “i” no item 3) no campo Informações necessárias.
21/09/2015	08/10/2015	Índices	Alteração no texto do campo “Informações necessárias” iniciadas no Tipo/Classe 5029 e 5019 .
21/09/2015	08/10/2015	Registro de Contrato - Pagamento Final (Terceira Curva)	Exclusão do índice IPCA no campo “Cupom Limpo”.
21/09/2015	05/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 10051 PETBRA 4 7/8 03/17/20 Corp.
21/09/2015	05/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 2555 CFF 1204310F63 10010 DOMC11 BZ EQUITY 10011 BTGPALP BZ EQUITY 10030 LSTGLB BZ Equity e 10031 KAPKFFF BZ EQUITY.
21/09/2015	05/10/2015	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Disponibilização da nova curva VCP.
21/09/2015	02/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 9990 PE&OLES* MM EQUITY, 9991 TSN US EQUITY, 9992 PPC US EQUITY, 9993 NEM US EQUITY e 9994 BVN US EQUITY.
21/09/2015	02/10/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 10050 MINI FUTURO DE OURO
21/09/2015	21/09/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 2556 ABCBBZ 7 7/8 04/08/20 Corp – REGS.
21/09/2015	21/09/2015	Atualização de PU/Fator	Disponibilização da opção Contrato a Termo no campo “Tipo de Atualização”.
21/09/2015	21/09/2015	Atualização de PU/Fator	Inclusão do campo “Valor Financeiro” na Tela de Confirmação.
21/09/2015	21/09/2015	Registro de Contrato - Pagamento Final (Terceira Curva)	Permissão do preenchimento do campo “Cupom Limpo” se informado curva IPCA, para que o sistema possa realizar o cálculo.

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

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

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

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
25/08/2014	23/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9438 The FTSE/JSE Top 40 Index Future.
25/08/2014	23/04/2015	Contratos com Funcionalidades	Em Swap com Knock In, Knock Out ou Knock In-Out Forma de Verificação de Disparo Discreto, mudança De: Euro Para: EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE.
25/08/2014	23/04/2015	Registro de Contrato - Pagamento Final	Na Terceira Curva nos campos “Curva” e “+ / -”, mudança De: Euro Para: EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE.
25/08/2014	22/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 9417 POST US Equity, 9418 DHR US Equity, 9419 DFE US Equity e 9437 IBA US Equity.
25/08/2014	15/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9420 DVA 5 05/01/25 Corp
25/08/2014	09/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9396 STQ FP EQUITY
25/08/2014	09/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9395 The SGX Nifty Index Future
25/08/2014	07/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Exclusão do tipo classe 8846 por motivo de bloqueio.
25/08/2014	02/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9375 DUFSCA 5 1/2 10/15/20 Corp - REGS
25/08/2014	02/04/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9355 KRFT US EQUITY
25/08/2014	31/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9335 SHOW3 BZ EQUITY.
25/08/2014	26/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Exclusão do Tipo/Classe: 8606 por motivo de bloqueio.
25/08/2014	25/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9315 SX5EEX GY EQUITY
25/08/2014	25/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9316 PCLN US Equity
25/08/2014	23/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 9275 VGK US Equity, 9276 FJP US Equity e 9277 DAX Index.
25/08/2014	23/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 9235 STX US Equity, 9255 FCFS US Equity, 9278 ANN GY Equity, 9279 P1Z GY Equity, 9295 DWN1 GY Equity, 9296 LEG GY Equity, 9297 TEG GY Equity e 9298 GFJ GY Equity.
25/08/2014	16/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9233 Rand
25/08/2014	16/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas de Juros Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 9232 JIBA3M Index.
25/08/2014	13/03/2015	Curvas Disponíveis para VCP –Cotas de Fundos de Investimento	Desabilitação do tipo classe 5902 - MAUA ORION FIQ FIM.

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

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

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
25/08/2014	08/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Alteração da descrição da curva VCP código 8246.
25/08/2014	03/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 8806 EWY US Equity
25/08/2014	01/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do item 7, na parte referente à curva 1018.
25/08/2014	01/12/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 8766 IFS PE Equity e 8787 ESRX US Equity.
25/08/2014	27/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Mudança no nome e na descrição do Tipo/Classe 5200 .
25/08/2014	27/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Taxas	Em informações necessárias, inclusão do item 6.
25/08/2014	24/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Retirada do seguinte Tipo/Classe: 7121 - TSIP1062 Index, por motivo de bloqueio.
25/08/2014	24/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 8726 MEXBOL Index.
25/08/2014	24/11/2014	Diversas funções	Alteração de tela (layout, forma e cor).
25/08/2014	18/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Mudança do nome da curva 8707 para T 2 ¾ 08/15/24 Govt.
25/08/2014	18/11/2014	Diversas funções	Alteração de tela (layout, forma e cor).
25/08/2014	12/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 8708 BRK/A US Equity e 8709 ZTS US Equity.
25/08/2014	12/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 8706 FRTR 1 ¾ 11/25/24 Corp e 8707 T 2 ⅜ 08/15/24 Govt.
25/08/2014	07/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 8686 XLF US Equity.
25/08/2014	04/11/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 8666 BSBR US Equity.
25/08/2014	30/10/2014	Atualizações da Versão	Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais nova para a mais antiga.
25/08/2014	30/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 8646 ABRE3 BZ Equity.
25/08/2014	30/10/2014	Registro de Contrato com Pagamento Final; Registro de Contrato de Fluxo Constante e Registro de Contrato Fluxo Não Constante.	No campo Índice Termo, inclusão do código indexador 78 (FRANCO SUIÇO BCE).
25/08/2014	29/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 8626 GAPB MM Equity, 8627 AMXL MM Equity, 8628 GMEXICOB MM Equity e 8629 PREC CB Equity.
25/08/2014	27/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadoria	Em informações necessárias, item 2 adicionar (exceto quando se tratar de um primeiro futuro), Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 8586 FUTURO DE HEATING OIL.
25/08/2014	27/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 8566 JEFFIN 7 1/2 04/15/21 Corp - 144A e 8606 DLM 7 5/8 02/15/19 Corp
25/08/2014	22/10/2014	Curvas Disponíveis para VCP - Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 8526 INTEL 8 1/8 06/01/23 Corp.

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

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

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
10/02/2014	30/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 8005 DVA 6 5/8 11/01/20 Corp, 8025 INTEL 6 3/4 06/01/18 Corp e 8026 SCI 4 1/2 11/15/20 Corp
10/02/2014	28/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Paridade de Moedas	Retirada da curva VCP 343 - Peso Argentino (ARS) EMTA
10/02/2014	25/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7986 RÚPIA
10/02/2014	25/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7663 MCABREF KY EQUITY Inclusão da letra “a” no item 2 das Informações Necessárias.
10/02/2014	24/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7985 ALTICE USL0179ZAA23
10/02/2014	23/07/2014	Todo o manual.	Inclusão do caminho completo da função no NoMe.
10/02/2014	21/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7984 OMAB US Equity
10/02/2014	15/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7943 Energia Elétrica PLD - CCEE
10/02/2014	11/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7923 GOL US Equity
10/02/2014	11/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7924 ASCMA 9 1/8 04/01/20 Corp
10/02/2014	07/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Alteração no nome da Curva VCP 7883 de 01/15/2021 para 02/15/2021.
10/02/2014	04/07/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7883 VECTOR GROUP LTD
10/02/2014	27/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 7843 QUEST YIELD FIC FI RF LP, 7844 MAUA INSTITUCIONAL FIC FIM e 7845 MAUA ABSOLUTO II FIC FI MULT.
10/02/2014	27/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7823 DVR US EQUITY
10/02/2014	27/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7824 CASCADES INC
10/02/2014	16/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Alteração no tópico 7 das informações necessárias para VCP de moedas.
10/02/2014	11/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7803 TCSA3 BZ EQUITY
10/02/2014	11/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7804 Futuro de Título do Tesouro Espanhol
10/02/2014	11/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7805 CIE SM Equity
10/02/2014	10/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7783 SAB LN EQUITY
10/02/2014	06/06/2014	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 7763 CNK 5 1/8 15/12/2022 Corp

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

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

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

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
18/11/2013	13/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundo de Investimentos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6921 INFLII BZ EQUITY
18/11/2013	13/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6941 KLBNI1 BZ EQUITY
18/11/2013	09/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6901 CORPBANC CI EQUITY.
18/11/2013	04/12/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundo de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6881 POCFJIU ID EQUITY.
18/11/2013	27/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6841 AXP US EQUITY.
18/11/2013	18/11/2013	Swap com Reset	Permitir indicar o valor mínimo 0,00 para o campo "Valor".
18/11/2013	18/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6821 TSLA US EQUITY.
01/07/2013	14/11/2013	Registro de Contrato – Fluxo Não Constante	Mudança na descrição do campo Juros % a.a. em CURVAS PARA ATUALIZAÇÃO - Parte/Contraparte.
01/07/2013	12/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do item 7 na coluna referente às informações necessárias.
01/07/2013	12/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Inclusão do subitem c) no item 2, na coluna referente às informações necessárias.
01/07/2013	12/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadoria	Inclusão da frase "e "Praça" de negociação da mercadoria para referência de preço, se houver." no item 2 na coluna referente às informações necessárias. Inclusão do subitem d) no item 3, na coluna referente às informações necessárias.
01/07/2013	11/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6781 BOND US EQUITY
01/07/2013	07/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 6761 CIB US EQUITY, 6762 CL US EQUITY e 6763 RBGLY US EQUITY.
01/07/2013	06/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 6721 GRUMAB MM EQUITY e 6722 CHDRAUIB MM EQUITY.
01/07/2013	06/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6741 MIGOEUH LX EQUITY.
01/07/2013	05/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6701 NKY INDEX - NIKKEI
01/07/2013	04/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Mudança no nome do Tipo/Classe 5154 De: DUFN SW EQUITY Para: DUFN VX EQUITY.
01/07/2013	04/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Mudança no texto numero 6 de Informações Necessárias.
01/07/2013	04/11/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Mudança no texto numero 3 de Informações Necessárias.
01/07/2013	29/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6681 Futuro de RUB
01/07/2013	18/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6660 CEMEX - CX US EQUITY

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
01/07/2013	18/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Mudança no nome do Tipo/Classe: 5977 .
01/07/2013	16/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ativos	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6644 BNDES 5,75 26/09/2023
01/07/2013	16/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6645 LALAB MM EQUITY
01/07/2013	11/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6643 Futuro de Palm Oil.
01/07/2013	10/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Inclusão do item 2 das “Informações Necessárias”.
01/07/2013	10/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6641 EXX SJ EQUITY
01/07/2013	08/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6623 NKE US EQUITY
01/07/2013	04/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6622 BBHCOSI:LX
01/07/2013	03/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6620 PT US
01/07/2013	03/10/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6621 SCSGUSA:ID
01/07/2013	30/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6600 BRK/B US EQUITY
01/07/2013	26/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6580 HTZ:US
01/07/2013	25/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6560 FRI:US
01/07/2013	25/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6540 MMXM11
01/07/2013	20/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6500 GGB:US
01/07/2013	13/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6499 CCU US EQUITY
01/07/2013	12/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 6479 ASR:SJ e 6480 ARI:SJ.
01/07/2013	06/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Taxas	Mudança no texto de informações necessárias nº (3).
01/07/2013	06/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Commodity	Mudança no texto de informações necessárias a) e b) nº (3).
01/07/2013	06/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Mudança no texto de informações necessárias nº (3).
01/07/2013	03/09/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 6459 XLI:US e 6460 XLY:US.
01/07/2013	29/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Moedas	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6440 PYG.
01/07/2013	29/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 6439 ENI:US
01/07/2013	29/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do grupo: Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais
01/07/2013	29/08/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 6441 FRTIEEQ:LX e 6442 NBUSU1A:ID

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

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

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

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

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
10/12/2012	08/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5632 IYR UP EQUITY
10/12/2012	05/04/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5609 RAL FP EQUITY e 5629 NIHD US EQUITY
10/12/2012	28/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5206 IENOV * MM
10/12/2012	22/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadorias	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5205 NG
10/12/2012	15/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5204 FXG US Equity
10/12/2012	12/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5202 TV US EQUITY e 5203 TSCO LN Equity
10/12/2012	08/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5201 EWZ US EQUITY
10/12/2012	04/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Futuro de Mercadoria	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5199 FUTURO DE COPPER e 5200 LIVE CATTLE FUTURES.
10/12/2012	01/03/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5198 MES INDEX - mini MSCI Emg Mkt
10/12/2012	27/02/2013	Informações Adicionais	Inclusão do tópico Procedimentos Especiais para Liquidação Financeira.
10/12/2012	26/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5196 DL NA EQUITY e 5197 TSCDY US EQUITY.
10/12/2012	25/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5190 SX5E INDEX
10/12/2012	25/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Títulos Públicos Nacionais	Inclusão da curva Títulos Públicos Nacionais e os seguintes Tipo/Classe: 5191 LTN, 5192 NTN-F, 5193 NTN-B e 5194 LFT
10/12/2012	25/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5195 AMX US EQUITY
10/12/2012	21/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Paridade de Moedas - Sem Cross Rate	Código 5008 , melhoria nas Informações Necessárias.
10/12/2012	21/02/2013	Campos com a descrição opcional.	Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
10/12/2012	21/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP - Commodity	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5186 SUGAR No.11, 5187 TIN = ESTANHO, 5188 ROUGH RICE = ARROZ e 5189 COFFEE "C" = CAFÉ.
10/12/2012	15/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão dos seguintes Tipo/Classe: 5184 PRE CN EQUITY e 5185 BKW US EQUITY
10/12/2012	15/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Paridade de Moedas - Com Cross Rate	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5183 CNH-BRL
10/12/2012	08/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5181 GSANBOB1 MM EQUITY
10/12/2012	08/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Índices	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5182 S&P 500 INDEX
10/12/2012	05/02/2013	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Internacionais	Inclusão do seguinte Tipo/Classe: 5180 VALE US EQUITY.

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

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

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

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

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

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

Introdução ao Swap

Conhecendo o Produto

Swap Fluxo de Caixa

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

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

Registro de Contrato

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

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

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

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

Troca de diferenciais de Juros

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

Troca de diferenciais de Amortizações

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

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

Agenda de Eventos

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

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

Outra funcionalidade disponível é a previsão de pagamento de prêmios.

Swap Pagamento Final

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

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

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

Observação:

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

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

Swap com Reset

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

Condições para pagamento de ajustes periódicos

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

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

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

Responsabilidade da informação das curvas marcadas a mercado

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

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

Campos passíveis de redefinição

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

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

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

Swap com Agenda de Redutor de Risco Crédito

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

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

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

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

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

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

Observação:

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

Ações dos botões das telas

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

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

Lançamento

Registro de Contrato - Pagamento Final

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Contrato – Pagamento Final

Visão Geral

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

Tela Registro de Contrato - Pagamento Final

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

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

(fim)

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

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

Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato - Pagamento Final

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

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

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

Exclusivo para Contrato à Termo

Data Operação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Pode ser a própria data de registro ou D-2 da data de registro, se for com cliente 1. Data início da operação a termo. Não há limite de prazo para o período a termo.
Índice Termo	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Se este campo não for preenchido, o sistema considera que o Valor Base não será corrigido, a partir da Data Operação (que deve estar preenchida) até a Data Início. Os participantes pactuam um único índice para atualização do Valor Base. Indica o parâmetro com o qual deve ser atualizado o Valor Base inicial, a partir da Data Operação até a data de efetivação do termo (Data Início), exclusive. Indexadores permitidos para atualização do Valor Base, quando contrato a termo: DI, SELIC, DOLAR, EURO/COM.EUROPEIA, EURO-BCE, IENE, LIBRA, FRANCO SUICO, PESO MEXICANO, OURO, TR, TJLP, FRANCO SUÍÇO BCE e VCP. Observações: ➤ No registro retroativo de contrato a termo com Cliente 1, não é permitido índice termo quando data de registro maior que data de início do contrato. ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978) ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
Perc. Termo	Campo de preenchimento obrigatório se o Índice Termo for preenchido. Informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais. Valor percentual do Índice Termo que corrige o Valor Base inicial da operação a partir da Data Operação até a data de efetivação do termo (Data Início).

Se Índice Termo

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

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

Sinal + / -	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher em conjunto com Juros. Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, DI 360 d, SELIC, Prefixado 252 d, Prefixado 360 d, Dólar, Dólar Com. Exp., Franco Suíço, Franco Suíço WMR, EURO/COM.EUROPEIA, Euro-BCE, Euro-WMR, Iene, Peso Mexicano, LIBOR, TJMI e Ibovespa Liquidação e Ibovespa Liquidação Contínuo (exclusivo para contrato com funcionalidade que envolva trigger). Aceitam taxas de juros negativas. Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa. Observações: ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978) ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) ➤ EURO-WMR = Paridade USD/EUR (WMR) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)] ➤ FRANCO SUÍÇO WMR = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (WMR) / Paridade USD/EUR (WMR)]
Juros % a.a.	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher em conjunto com Sinal. Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais. É a taxa de remuneração que, agregada ao parâmetro, atualiza o Valor Base.
Lim. Inferior (Floor)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais. Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o módulo usa o limite para corrigir a curva. Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.
Lim. Superior (Cap)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais. Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o módulo usa o limite para corrigir a curva. Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”.
Terceira Curva – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Parte/Contraparte	Caixa de Seleção com as opções: Parte e Contraparte.

Cupom Limpo	Na utilização de Terceira Curva, exclusivamente para os parâmetros baseados em Moeda e Ibovespa de Liquidação, de comum acordo entre as partes, que o módulo usa como valor inicial para valorização da curva do contrato. Informado com até 8 (oito) números inteiros e 7 (sete) decimais.
Percentual	Valor percentual do parâmetro de atualização da Terceira Curva do Swap, usada como Limite Inferior ou Superior. Informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais.
Curva	Na utilização de Terceira Curva que o módulo necessita para atualização do contrato. Caixa de Seleção com as opções: DI, Selic, Dólar, Dólar Com. Exponencial, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, Franco Suíço, Iene, Peso Mexicano, IGP-M, IGP-DI, INPC, TR, TJLP e Ouro. Observações: ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978) ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
+ / -	Indica se o juro a ser agregado ao parâmetro de atualização é positivo ou negativo. Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, SELIC, Dólar, Dólar Com. Exp., Franco Suíço, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, Iene e Peso Mexicano, aceitam taxas de juros negativas. Observações: ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978) ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)].
Juros (% aa)	Taxa de Juros que, agregada ao parâmetro escolhido para terceira curva, atualiza o valor base. Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.
Limitador	Caixa de Seleção com as opções: Limite Inferior e Limite Superior.
Se Curva (s) = VCP - Parte/Contraparte – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
PU	Campo de preenchimento obrigatório quando curva 00 ou contrato à vista ou decorrido. Valor unitário do índice na data de contratação do Swap em que a variação do parâmetro não disponibilizado pela Cetip é aplicada. É o PU inicial quando a

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

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

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

	Esse campo deverá ser preenchido através do RIC. Esta informação já existe nos arquivos públicos relacionados à Mercadorias.
Média Asiática Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa de seleção com as opções: Branco (quando opção não for Asiática), SIMPLES ou PONDERADA.
Data da Cotação para Ajustes	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Data de Cotação para Ajuste da Parte/Contraparte. Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 5 (D-5). Dentre as opções disponíveis, a que for selecionada também será considerada para o cálculo da cotação da moeda atrelada à mercadoria.
Funcionalidades - Campos exclusivos Trigger in / Trigger out – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Parte / Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Define a Parte/Contraparte do Trigger. Caixa de Seleção com as Opções: Parte e Contraparte.
Fator / Valor / Taxa	Magnitude do parâmetro que determina a efetivação (Trigger In) ou rescisão (Trigger Out) do Swap. Informado com até 8 (oito) inteiros e 8 (oito) decimais. Fator - informar com 8 (oito) casas decimais, se parâmetro informado for IGP-M, IGP-DI, INPC, TR ou qualquer outro parâmetro aceito como trigger, cuja verificação seja final. Taxa - informar com 2 (duas) casas decimais, se parâmetro informado for DI, SELIC ou TJLP. Valor - informar com 4 (quatro) casas decimais, se parâmetro informado for Dólar, Dólar Comercial Exponencial ou Ouro. Informar com 5 (cinco) decimais, se parâmetro informado for Franco Suíço ou Euro. Informar com 6 (seis) decimais, se parâmetro informado for Iene ou Peso Mexicano. Informar com 8 (oito) decimais, se parâmetro informado for Ibovespa de Liquidação.
Verificação	Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger. Caixa de Seleção com as opções: Diária e Final. Consulte Capítulo Informações Adicionais – Item <i>Contratos com Funcionalidades</i>.
Titular da Funcionalidade / Prêmio – Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Titular	Define se o titular é a Parte ou a Contraparte. Indica o Participante que pagará o prêmio. Caixa de Seleção com as opções: Parte e Contraparte.
Prêmio (1) de Funcionalidade – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Valor (R\$)	Valor do prêmio. Pode ser informado como “0” (zero).

Rebate (R\$)	Define o valor da devolução do prêmio, pago no registro, ao titular do contrato, caso o contrato vença e não seja efetivado ou rescindido. O valor do rebate pode ser menor, igual ou maior que o valor do prêmio de funcionalidade. Pode ocorrer desde que, até a data de vencimento, não dispare o Trigger de Knock In ou dispare o Trigger de Knock Out. Válido somente para as funcionalidades: Knock In; Knock Out; Knock In-Out; e Knock Out com Opção de Arrependimento.
Liquidação do Rebate	Caixa de Seleção com as opções Vencimento, Trigger Out e Após Número de Dias.
Dias Úteis Após o Trigger Out	Identifica a quantidade de dias úteis, após ocorrer o Knock Out, que é pago o Rebate. Não pode ultrapassar o dia do vencimento original do Swap.
Prêmio (2) de Funcionalidade – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Valor (R\$)	Valor do prêmio. Pode ser informado como "0" (zero).
Data Exercício	Data em que o titular paga prêmio para exercer a opção de permanência no contrato. Preencher somente para a modalidade Compound Swaption.

Observações:

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

Tela Registro de Pagamento de Prêmio

Registro de Pagamento de Prêmio

Código do Contrato

Forma de Pagamento

Quantidade de Prêmios

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

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

Tela Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Código do Contrato

Forma de Disparo

Quantidade de Datas

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

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

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

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

As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

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

Registro de Contrato - Fluxo Constante

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Contrato – Fluxo Constante

Visão Geral

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

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

Tela Registro de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

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

(continua)

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

(fim)

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

Exemplo - Contrato aguardando lançamento de contraparte

Registro de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

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

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

Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato

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

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

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

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

Campo	Descrição
Índice Termo	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caso este campo não esteja preenchido, o sistema deve considerar que o Valor Base não será corrigido, a partir da Data Operação (que deve estar preenchida) até a Data Início do contrato de Swap. Os participantes pactuam um único índice para atualização do Valor Base. Para que o sistema atualize o valor base quando indicada a opção VCP, o participante deve utilizar a função Atualização de PU/Fator. Indica o parâmetro com o qual deve ser atualizado o Valor Base inicial, a partir da Data Operação até a data do contrato de Swap, exclusive. Indexadores permitidos para atualização do Valor Base, quando contrato a termo: DI; Selic; Dólar; EURO/COM.EUROPEIA, EURO-BCE, Iene; Libra; FRANCO SUÍÇO BCE e VCP. Observações: ➤ No registro retroativo de contrato a termo com Cliente 1, não é permitido índice termo quando data de registro maior que data de início do contrato. ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 978) ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)].
Perc. Termo	Campo de preenchimento obrigatório se o campo Índice Termo for informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais. Valor percentual do Índice Termo que corrige o Valor Base inicial.
Se Índice Termo	
PU Inicial/Cupom Limpo	Campo deve ser preenchido apenas na data de registro do Swap. Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser 00 - VCP. No caso de Swap à Termo, só deve ser preenchido quando Índice Termo for VCP, DOLAR ou EURO. PU inicial para atualização do Valor Base. O Participante deve informar o PU que servirá para iniciar a atualização do valor base do contrato a termo. Cupom Limpo, exclusivo para utilização em caso de índice Termo = dólar. Utilizado para informar o valor da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor inicial para valorização da curva do contrato quando código de registro igual a Dólar (Cupom Limpo).

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

Campo	Descrição
Data Início Pagto Amort.	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Define a Data da primeira troca de amortização. Embora admitidos fluxos diferentes entre troca de principal e de juros, as datas dos eventos de troca de principal, quando houver, devem ser coincidentes com as datas de trocas de juros. Será efetuado primeiramente o cálculo dos juros, e somente depois o cálculo das amortizações.
Tipo Amortização	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Indica o tipo de amortização escolhido. Caixa de Seleção com as opções: Vazio, Sobre valor Base original (valor base da data do início do contrato) ou Sobre valor Base Remanescente (valor base original decrescido das amortizações já efetuadas).
CURVAS PARA ATUALIZAÇÃO - Parte/Contraparte - Curvas do Swap, para atualização conforme os parâmetros definidos - Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Percentual	Campo de preenchimento obrigatório. Valor percentual do parâmetro com que o participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva. Até 3 inteiros e 2 decimais. O percentual pode ser menor, igual ou maior que 100%, com exceção da curva Libor, havendo ou não taxa de juros. Curvas iguais ou diferentes, inclusive VCP: Se os campos "Curva" forem iguais -> Os campos "Percentual" e/ou "Juros %a.a." deverão ser diferentes; e Não é permitido a indicação dos campos "Curva", "Percentual" e "Juros %a.a." idênticos.
Categoria	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de Seleção com as opções: COMMODITIES, JUROS, JUROS INTERNACIONAIS, TAXAS DE CÂMBIO E VCP.
Curva	Campo de preenchimento obrigatório. A caixa de opções abrirá de acordo com a categoria escolhida. A relação de curvas por categoria pode ser consultada no arquivo público "Indexadores Swap".
+ / -	Preencher em conjunto com Juros. Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, Moeda, Libor e TJMI aceitam taxas de juros negativas. Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa.
Juros % a.a.	Preencher em conjunto com Sinal. Informar com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais. É a taxa de remuneração que, agregada ao parâmetro, atualiza o Valor Base.

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

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

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

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

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

Telas Registro de Pagamento de Prêmio

Registro de Pagamento de Prêmio

Código do Contrato

Forma de Pagamento

Quantidade de Prêmios

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

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

Registro de Contrato - Fluxo Não Constante

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

Visão Geral

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

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

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

Tela Registro de Contrato - Fluxo de Caixa Não Constante

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

(continua)

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

(fim)

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

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

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

Observação para o preenchimento:

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

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

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

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

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

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

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

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

Campo	Descrição
Índice Termo	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caso este campo não esteja preenchido, o sistema deve considerar que o Valor Base não será corrigido, a partir da Data Operação (que deve estar preenchida) até a Data Início do contrato de Swap. Os participantes pactuam um único índice para atualização do Valor Base. Para que o sistema atualize o valor base quando indicada a opção VCP, o participante deverá utilizar a função Atualização de PU/Fator. Indica o parâmetro com o qual deve ser atualizado o Valor Base inicial, a partir da Data Operação até a data do contrato de Swap, exclusive. Indexadores permitidos para atualização do Valor Base, quando contrato a termo: DI; Selic; Dólar; EURO/COM.EUROPEIA, EURO-BCE; Iene; Libra, FRANCO SUÍÇO BCE e VCP. Observações: - No registro retroativo de contrato a termo com Cliente 1, não é permitido índice termo quando data de registro maior que data de início do contrato. - EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978) - EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) - FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
Perc. Termo	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Valor percentual do Índice Termo que corrige o Valor Base inicial. Deve ser preenchido se o campo Índice Termo for informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais.
Se Índice Termo	
PU Inicial/Cupom Limpo	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caso não seja preenchido, o Valor Base é atualizado pelo Fator (campo abaixo). Pode ser preenchido apenas na data de registro do Swap. No caso de Swap à Termo, só deve ser preenchido quando Índice Termo for VCP, DOLAR ou EURO. PU inicial para atualização do Valor Base. Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser 00 - VCP. Cupom Limpo, exclusivo para utilização em caso de índice Termo = dólar Utilizado para informar o valor da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor inicial para valorização da curva do contrato quando código de registro igual a Dólar (Cupom Limpo). Obs.: Na utilização do Índice Termo = dólar, a cotação que é utilizada pelo sistema Cetip é D-1; Para cotação do dólar de correção do termo for diferente de D-1 utilizar Índice termo = VCP

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

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

Campo	Descrição
PU	Campo de preenchimento obrigatório, quando contrato à vista ou decorrido. Pode ser atualizado pela função Registro de PU / Fator até a data do evento de juros/amortização. Informado com até 6 (seis) números inteiros e 6 (seis) decimais. Define o PU base de valorização da curva referenciada em VCP.
Tipo/Classe	Campo de preenchimento obrigatório. Qualificação da curva VCP. Caixa de Seleção com as opções descritas no tópico Consulta de Tipo de Classe.
Denominação	Campo não deve ser preenchido quando a ponta do contrato for Curva VCP e Tipo/Classe 73 (Estratégia). Descrição do parâmetro escolhido como VCP para a(s) curva(s) do(s) Participante e da Contraparte, caso seja(m) do tipo VCP. Texto livre com 320 posições. Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo "Tipo/Classe". Para maiores consultar a seção "Consulta Tipo Classe".
Cupom Limpo/Data Cotação - Parte/Contraparte	
Cupom Limpo	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Utilizado para Índice Ibovespa, Moedas e VCP. Cotação inicial informada pelas partes para valorização da curva do contrato. Caso não seja informada a cotação inicial, será utilizada a cotação capturada automaticamente pelo Módulo conforme indicado no campo "Data de Cotação". Nos casos em que a cotação inicial será diferente daquela capturada automaticamente pelo Módulo, esta deve ser indicada exclusivamente por meio deste campo, não devendo ser informada no campo "Denominação".
Data de Cotação	Data de Cotação a ser utilizada no início e no vencimento do contrato. Para curvas calculadas, são permitidas 3 (três) opções de datas de cotação: D-1, D-2 e D-3. Preenchimento Obrigatório, independentemente da indicação de "Cupom Limpo". Para curvas VCP, são permitidas 5 (cinco) opções de datas de cotação: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5. Preenchimento Obrigatório, independentemente da indicação de "Cupom Limpo". Caso a Data de Cotação seja D0, indicar esta informação no campo "Denominação", não sendo permitido a indicação no campo "Data de Cotação".
EXCLUSIVO PARA CURVA LIBOR - Parte/Contraparte - Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Libor	

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

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

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

Tela Registro Fluxo de Caixa Não Constante

Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

Parte	05000	00	5
Contraparte	10020	00	1
Meu Número (Oper Original)	6		
Número de Datas de Eventos	2		

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

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

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

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

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

Tela Registro de Pagamento de Prêmio

Registro de Pagamento de Prêmio

Código do Contrato	14K00079316
Forma de Pagamento	DEFINIR FLUXO
Quantidade de Prêmios	2

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

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

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

Registro Fluxo de Caixa Não Constante

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

Visão Geral

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

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

Tela Filtro Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

Parte

Contraparte

Meu Número (Oper Original)

Número de Datas de Eventos

Confirmar

Limpar Campos

Desistir

Todos os campos da tela acima são de preenchimento obrigatório.

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

Tela Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

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

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

Observações:

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

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

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

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

Tela - Confirmação Fluxo de Caixa - Não Constante

Registro Fluxo de Caixa - Não Constante					
Contrato					
Código IF		Data Início		Data Vencimento	
14K00079317		14/11/2014		14/12/2014	
Código Parte		Código Contraparte		Meu Número (Oper Original)	
05000.00-5		10020.00-1		1111	
Parte (Nome Simplificado)		Contraparte (Nome Simplificado)		Papel	
RIOBM		LEMEBM		PONTA 1	
Curva Parte		Curva Contraparte			
DI		DOLAR DOS EUA			
Tipo Amortização		Meu Número			
Sobre valor Base Original		1111			
Fluxo Não Constante Ponta 1					
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
28/11/2014					50,00000
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
14/12/2014					50,00000
Fluxo Não Constante Ponta 2					
Data	+/-	Juros(% aa)			Taxa Amortização
28/11/2014					50,00000
Data	+/-	Juros(% aa)			Taxa Amortização
14/12/2014					50,00000

Registro de Fluxo de Datas de Verificação

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

Visão Geral

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

Tela de Registro de Data de Verificação

Registro de Data de Verificação		
Parte		
ContraParte		
Meu Número (Oper Original)		
Quantidade de Datas de Verificação Parte		
Quantidade de Datas de Verificação ContraParte		
Confirmar Limpar Campos Desistir		

Descrição dos Campos da Tela Registro de Data de Verificação

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

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

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

Ponta 1	Ponta 2

Descrição dos Campos da Tela Registro de Data de Verificação

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

Registro de Pagamento de Prêmio

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Pagamento de Prêmio

Visão Geral

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

Tela Filtro Registro de Pagamento de Prêmio

Registro de Pagamento de Prêmio

Código do Contrato

14K00079316

Forma de Pagamento

DEFINIR FLUXO

Quantidade de Prêmios

2

Pesquisar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

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

Descrição dos Campos da Tela Filtro Registro de Pagamento de Prêmio

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

Tela Registro de Pagamento de Prêmio

Registro de Pagamento de Prêmio		
Contrato		
Código do Contrato	Data Início	Data Vencimento
14K00079316	14/11/2014	14/12/2014
Ponta 1	Ponta 2	
05000.00-5	10020.00-1	
Ponta 1 (Nome Simplificado)	Ponta 2 (Nome Simplificado)	Meu Número
RIOBM	LEMEBM	006
Curva Ponta 1	Curva Ponta 2	Papel
DI	DOLAR DOS EUA	PONTA 1

Eventos de Prêmio		
Data	Valor do Prêmio	Titular
21 /11/2014	500 ,	PONTA 1 ▼
Data	Valor do Prêmio	Titular
28 /11/2014	500 ,	PONTA 1 ▼

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

Descrição dos Campos da Tela Registro

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

Liquidação Financeira de Prêmios

Liquidação de prêmio na data de registro:

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

Liquidação de prêmio em data posterior a do registro

- Realizada na Modalidade de Liquidação Bilateral

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

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

Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

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

Visão Geral

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

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

Tela Filtro Registro de Parâmetros para Disparo de Reset



Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Código do Contrato 14K00079320

Forma de Disparo DATA OU VALOR

Quantidade de Datas 2

Pesquisar Limpar Campos Desistir

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

Formas de Disparo

Por Data:

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

Por Valor:

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

Por Data ou Valor:

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

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

Por Data e Valor:

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

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

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

Tela Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

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

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

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

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

Descrição dos Campos da Tela de Registro

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

Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Visão Geral

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

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

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

Tela Filtro Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Registro de Informação de Derivativos	
Código do Contrato	14K00079311
Pesquisar	Limpar Campos Desistir

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

Tela de Registro de Curvas Marcadas a Mercado

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

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

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

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

Descrição do Campo da Tela Registro de Curvas Marcadas a Mercado

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

Registro de Reset

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Reset

Visão Geral

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

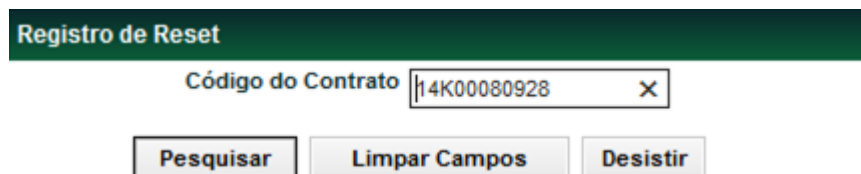
Essa função só pode ser utilizada quando for disparado o Reset, esta condição pode ser consultada em:

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

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

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

Tela Filtro Registro de Reset



Registro de Reset

Código do Contrato 4K0080928 X

Pesquisar Limpar Campos Desistir

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

Tela Registro de Reset

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

Curvas Marcadas a Mercado	
Ponta 1	Ponta 2
1,01000000	1,02000000
Diferencial das Curvas	Credor
10,00	PONTA 2
Liquidação do Reset	Continuidade do Contrato
SIM	SIM

Alteração no Contrato		
Altera Contrato		
SIM		
Altera Parâmetros Reset	Forma de Disparo	Quantidade Datas Reset
NAO	VALOR	1

Opções para fixar o momento do Reset:

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

Na ocorrência de registro de Reset com liquidação financeira e:

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

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

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

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

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

Descrição dos Campos de Tela Registro

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

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

Intermediação de Contrato

Menu Swap > Lançamentos > Intermediação de Contrato

Visão Geral

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

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

Tela Intermediação de Contrato

Registro de Intermediação de Contrato

Parte: 05000,00,5

Contraparte: 10020,00,1

Código do Contrato: 14K00079310

Meu Número: 125

Comissão: 1,00

Enviar Limpar Campos Desistir

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

Observações:

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

Descrição dos campos da Tela Intermediação de Contrato

Campo	Descrição
Parte	Código Cetip que identifica o membro que está acessando o módulo.
Contraparte	Código Cetip que identifica o outro membro envolvido na operação.
Código do Contrato	Número do contrato de Swap gerado pelo sistema.

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

Registro de Reset - Alterações

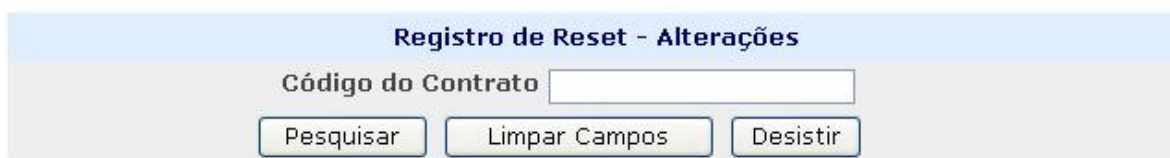
Menu Swap > Lançamentos > Registro de Reset - Alterações

Visão Geral

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

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

Tela Filtro Registro de Reset Alterações



Registro de Reset - Alterações

Código do Contrato

Pesquisar Limpar Campos Desistir

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

Tela Registro de Reset - Alterações

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

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

Descrição dos Campos da Tela Registro - Alterações

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

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

Alteração de Contrato - Pagamento Final

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Contrato – Pagamento Final

Visão Geral

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

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

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

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

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

Tela Filtro Alteração de Contrato - Pagamento Final

Alteração de Contrato - Pagamento Final

Código do Contrato

Ação **CORREÇÃO**

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

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

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

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

Tela de Registro de Alteração de Contrato - Pagamento Final

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

(continua)

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

(Fim)

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

Descrição dos Campos da Tela de Registro de Alteração de Contrato

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

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

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

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

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

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

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

Alteração de Contrato - Fluxo Constante

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Contrato – Fluxo Constante

Visão Geral

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

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

Tela Filtro Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante



Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Código do Contrato

Ação **CORREÇÃO**

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

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

Observação:

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

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

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

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

(continua)

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

(fim)

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

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

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

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

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

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

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

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

Alteração de Contrato - Fluxo não Constante

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

Visão Geral

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

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

Tela Filtro Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Não Constante



Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Código do Contrato 14k00079320

Ação CORREÇÃO

Pesquisar Limpar Campos Desistir

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

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

Observação:

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

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

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

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

(continua)

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

(fim)

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

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

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

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

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

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

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

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

Alteração de Fluxo de Caixa Não Constante

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

Visão Geral

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

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

Tela Filtro Alteração de Fluxo de Caixa - Não Constante

Alteração de Fluxo de Caixa - Não Constante

Código do Contrato

Ação

Alterar Número de Datas de Eventos

Número de Datas de Eventos

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

Observação:

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

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

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

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

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

Tela de Registro Alteração de Fluxo de Caixa - Não Constante

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

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

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

Campo	Permissão para alteração / Observações
É válida a regra de obrigatoriedade de preenchimento dos campos presente no “Registro”	
Tipo Amortização	Se alterado, o valor desse campo é criticado em conjunto com o campo Taxa Amortização .

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

Alteração de Fluxo de Data de Verificação

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

Visão Geral

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

Tela de Alteração de Fluxo de Data de Verificação

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

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

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

Tela Alteração de Fluxo de Data de Verificação

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

Descrição dos Campos da Tela Registro de Data de Verificação

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

Alteração de Pagamento de Prêmio

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Pagamento de Prêmio

Visão Geral

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

Prazo para alteração

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

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

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

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

Tipo da Operação	Prazos para alterações
À vista , com contrato registrado em D ; data de início em D , agenda de prêmios para D+n	Se não existe operação de pagamento de prêmio para D : Permitida alteração (inclusões e exclusões) da agenda de prêmios das datas D até D+n.
À termo , com contrato registrado em D ; data de início em D+n , agenda de prêmios para D+n	
À vista , com contrato registrado em D ; data de início em D , agenda de prêmios para D+n , operação de pagamento de prêmio em D e D+1	Se operação de pagamento de prêmio com status Pendente de Liquidação Financeira: - É permitida alteração da agenda de prêmios somente para os prêmios futuros; - Não é permitida alteração do prêmio da data de registro, se houver essa necessidade o participante deve cancelar a operação de pagamento de prêmio, assim o sistema cancela automaticamente a agenda de prêmios e retorna o status do contrato para Pendente de Agenda de Prêmios para nova definição do fluxo de pagamentos de prêmio.
À termo , com contrato registrado em D ; data de início em D+n , agenda de prêmios para D+n , operação de pagamento de prêmio em D e D+1	
Contrato com clientes próprios e entre clientes	

Tipo da Operação	Prazos para alterações
À vista , com contrato registrado em D , Data de Início em D , Agenda de Prêmios para D+n	Se não existe operação de pagamento de prêmio para D: - É permitida alteração (inclusões e exclusões) da agenda de prêmios das datas D até D+n. Se existe operação de pagamento de prêmio: - É permitida alteração da agenda de prêmios somente para os prêmios futuros.
À termo , com contrato registrado em D , Data de Início em D+n , Agenda de Prêmios para D+n	
À vista , com contrato registrado em D , Data de Início em D , Agenda de Prêmios para D+n , operação de prêmio em D e D+n	Se operação de pagamento de prêmio com status Finalizado: - É permitida alteração da agenda de prêmios somente para os prêmios futuros; - Para alteração do prêmio da data de registro, é necessário primeiramente o cancelamento da operação de pagamento de prêmio, o sistema cancela automaticamente a agenda de prêmios e retorna o status do contrato para Pendente de Agenda de Prêmios para nova definição do fluxo de pagamentos de prêmio.
À termo , com contrato registrado em D , Data de Início em D+n , Agenda de Prêmios para D+n , operação de prêmio em D e D+n	

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

Observação2:

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

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

Tela Filtro Alteração de Pagamento de Prêmio

Alteração de Pagamento de Prêmio

Código do Contrato

Quantidade de Prêmios

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

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

Tela de Registro de Alteração de Pagamento de Prêmio

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

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

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

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

Antecipação de Contratos

Menu Swap > Lançamentos > Antecipação de Contratos

Visão Geral

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

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

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

O lançamento de antecipação não deve ser realizado com o objetivo de cancelamento do contrato, em função de identificação de registro incorreto, nem ser combinado com o registro de um novo contrato para refletir qualquer alteração das condições originalmente pactuadas. Nestes casos, o Participante deve remeter a documentação comprobatória para a avaliação da área operacional da Cetip.

Ressaltamos que a utilização da função de antecipação com a finalidade de realizar alteração e/ou cancelamento de contrato poderá caracterizar a inadimplência regulamentar do Participante, sujeitando-o às penalidades previstas no regulamento da Cetip.

Tela Filtro Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato

Código do Contrato 14K00079315

Pesquisar Limpar Campos Desistir

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

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

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

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

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

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

Tela de Antecipação de Contrato

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

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

Descrição dos Campos da Tela Antecipação de Contrato

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

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

Observações:

Contratos com Fluxo de Caixa – Antecipação Parcial:

- 1) Quando o contrato tiver previsão de amortização do “Tipo 0” – percentuais incidentes sobre o Valor Base Original – será aplicado um fator de ajuste sobre os percentuais de amortização a decorrer (eventos futuros) originalmente informados, para que os mesmos passem a refletir a antecipação efetuada.
- 2) Caso haja previsão de amortização do “Tipo 1” – percentuais incidentes sobre Valor Base Remanescente não haverá ajuste dos percentuais de amortização a decorrer (eventos futuros).

Contratos de Swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito

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

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

Possibilidade de antecipação nos contratos com Fluxo Constante e Não Constante

Possibilidade de antecipação nos contratos com FLUXO Constante e Não Constante

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

Possibilidade de ANTECIPAÇÃO nos Contratos de Pagamento Final

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

Possibilidades de antecipação nos contratos COM e SEM MODALIDADE

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

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

CONTRATOS SEM MODALIDADE

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

Antecipação referente aos prêmios e comissões

Situação dos prêmios e comissões na antecipação dos contratos

Pagamento da COMISSÃO de intermediação de contrato na DATA DE INÍCIO .	A comissão tem curso normal de liquidação.
Pagamento do PRÊMIO da OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO .	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade KNOCK IN . (O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade KNOCK OUT . (O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade KNOCK IN-OUT . (O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade SWAPTION A TERMO . (Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 na data de início).	Pagamento Prêmio 1, tem curso normal. Pagamento Prêmio 2, depois de exercida a opção, o pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade COMPOUND SWAPTION . (Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).	Pagamento Prêmio 1, tem curso normal. Pagamento Prêmio 2: • Antes de exercida a opção: É cancelado automaticamente. ▪ Depois de exercida a opção: O pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade SWAP COM PRÊMIO .	Pagamento Prêmio 1, tem curso normal.

Cessão de Contrato

Menu Swap > Lançamentos > Cessão de Contrato

Visão Geral

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

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

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

Tela de Cessão de Contrato

Cessão de Contrato

Cedente 05000.00.5

Adquirente 01409.00.2

CPF/CNPJ (Adquirente)

Código do Contrato 14K00202512

Contrato Inadimplente NAO ▼

Meu Número 132468

Papel CEDENTE ▼

Anuente 10020.00.1

Valor do Prêmio

Titular do Prêmio ▼

Enviar Limpar Campos Desistir

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

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

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

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

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

Descrição dos Campos da Tela de Cessão de Contrato

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

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

Confirmação de Cessão de Contrato (Cedente ou Adquirente)

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

Cessão de Contrato

Cedente 05000.00-5

Adquirente 01409.00-2

CPF/CNPJ (Adquirente)

Código do Contrato 14K00202512

Meu Número 132468

Anuente 10020.00-1

Valor do Prêmio

Cedente (Nome Simplificado) RIOBM

Adquirente (Nome Simplificado) FLORIDAINV

Contrato Inadimplente NAO

Papel CEDENTE

Anuente (Nome Simplificado) LEMEBM

Titular do Prêmio

Confirmar

Corrigir

Desistir

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

Confirmação de Cessão de Contrato (pelo Anuente)

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

Cessão de Contrato	
Cedente 05000.00-5	Cedente (Nome Simplificado) RIOBM
Adquirente 01409.00-2	Adquirente (Nome Simplificado) FLORIDAINV
CPF/CNPJ (Adquirente)	
Código do Contrato 14K00202512	Contrato Inadimplente NAO
Meu Número 8742	Papel ANUENTE
Anuente 10020.00-1	Anuente (Nome Simplificado) LEMEBM
Valor do Prêmio	Titular do Prêmio
Enviar	Limpar Campos Voltar Desistir

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

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

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

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

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

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

Possibilidades de Cessão nos contratos COM e SEM MODALIDADE

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

Tipos de Contratos	Knock In	Knock Out	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio
À termo decorrido Registra do em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.	Não se aplica.	Não se aplica.	Não se aplica.	A partir de D+1 ou 2, até a data vencimento, exclusive.	Não se aplica.	A partir de D+1 ou 2, até a data vencimento, exclusive.

CONTRATOS SEM MODALIDADE

À vista Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.
À termo Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N.	A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.
À vista com Cliente1 Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.
À termo decorrido Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.	A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.

Cessão referente aos prêmios

Cessão de contrato e a situação dos prêmios.

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

Cessão de contrato e a situação dos prêmios.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN**.

(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK OUT**.

(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN-OUT**.

(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.

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

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

Os direitos são transferidos.

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

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

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

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

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

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

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

Prêmio já foi pago.

Cancelamento de Contrato

Menu Swap > Lançamentos > Cancelamento de Contrato

Visão Geral

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

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

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

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

Tela Filtro Cancelamento

Cancelamento de Contrato			
Parte	05000	,00	5
Contraparte	05000	,10	8
Código do Contrato	14K00079310		
Meu Número	1212		
Enviar		Limpar Campos	
		Desistir	

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

Descrição dos Campos da Tela Filtro Cancelamento

Tipo de contrato	Prazo de Cancelamento
Campos de preenchimento obrigatório.	
Parte	Código Cetip que identifica o membro que registrou o contrato.

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

Tela de Confirmação de Cancelamento de Contrato

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

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

Atualização de PU/Fator

Menu Swap > Lançamentos > Atualização PU/Fator

Visão Geral

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

Tela Filtro Atualização PU/Fator

Atualização PU/FATOR

Código do Contrato

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

Tela de Atualização PU/Fator

Atualização PU/FATOR

Código do Contrato 15D00034137

Ponta 1 05000.00-5

Ponta 2 05000.10-8

Ponta 1 (CPF/CNPJ)

Ponta 2 (CPF/CNPJ) 420.750.176-20

Papel PONTA 1

Curva

Meu Número

Ponta 1 (Nome Simplificado) RIOBM

Ponta 2 (Nome Simplificado) RIOBM

Tipo de Atualização

Data PU/FATOR /09/2015

PU ,

FATOR ,

Descrição dos Campos da Tela de Atualização de PU/Fator

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

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

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

Tela confirmação de Atualização PU/FATOR

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

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

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

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

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

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

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

Informação obrigatória de dados adicionais

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

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

Registro de Taxas de Juros Mercado Internacional

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

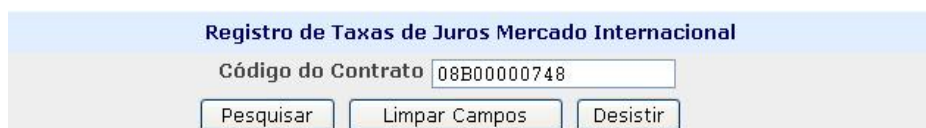
Visão Geral

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

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

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

Tela Filtro Registro de TJMI

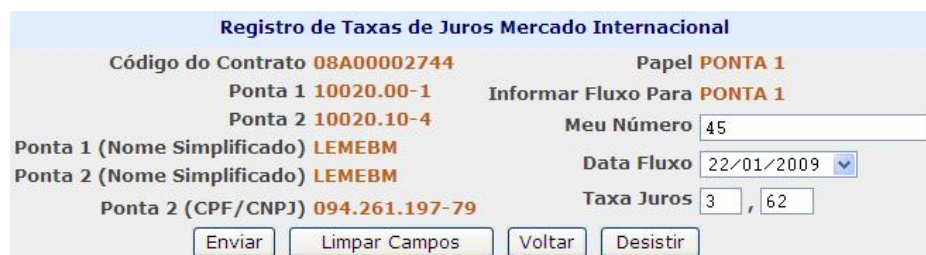


Registro de Taxas de Juros Mercado Internacional

Código do Contrato

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

Tela de Registro de TJMI



Registro de Taxas de Juros Mercado Internacional

Código do Contrato **08A00002744** Papel **PONTA 1**

Ponta 1 **10020.00-1** Informar Fluxo Para **PONTA 1**

Ponta 2 **10020.10-4** Meu Número

Ponta 1 (Nome Simplificado) **LEMEBM** Data Fluxo

Ponta 2 (Nome Simplificado) **LEMEBM** Taxa Juros ,

Ponta 2 (CPF/CNPJ) **094.261.197-79**

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

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

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

Descrição dos Campos da Tela de Registro de TJMI

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

Exercício de Opção

Menu Swap > Lançamentos > Exercício de Opção

Visão Geral

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

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

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

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

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

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

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

Exercício de opção quanto ao Tipo de registro

Possibilidade do exercício de opção nos contratos

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

Exercício de opção referente aos prêmios e comissões

Situação dos prêmios e comissões no exercício de opção dos contratos

Pagamento do PRÊMIO da OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO.	O pagamento do prêmio da opção de arrependimento, pago na data de registro tem curso normal independente se exerce ou não a opção.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade SWAPTION A TERMO. (Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 na data de início).	Pagamento Prêmio 1 tem curso normal. Pagamento Prêmio 2: • Se não foi exercida a opção: É cancelado automaticamente. • Se exercida a opção: O pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.

Situação dos prêmios e comissões no exercício de opção dos contratos

Pagamento de PRÊMIO da modalidade COMPOUND SWAPTION.

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

Pagamento Prêmio 1 tem curso normal.

Pagamento Prêmio 2:

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

Exercício de opção na data de Vencimento do Contrato

Possibilidade do exercício de opção no vencimento do contrato

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Tela Filtro Exercício de Opção

Exercício de Opção

Código do Contrato 14K00202507

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

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

Tela Exercício de Opção

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

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

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

Exercício de opção quanto ao tipo de registro

Possibilidade do exercício de opção nos contratos	
Contrato à vista. Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D+1 ou 2) até a data de vencimento, inclusive.
Contrato a termo. Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D+N+1) até a data de vencimento, inclusive.
Contrato à vista com cliente 1. Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D+1 ou 2) até a data de vencimento, inclusive.

Possibilidade do exercício de opção nos contratos

Contrato a termo decorrido.

Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.

A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D+N+1) até a data de vencimento, inclusive.

Exercício de opção referente aos prêmios e comissões

Situação dos prêmios e comissões no exercício de opção dos contratos

Pagamento do PRÊMIO da **OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO**.

O pagamento do prêmio da opção de arrependimento, pago na data de registro tem curso normal independente se exerce ou não a opção.

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

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

Pagamento Prêmio 1 tem curso normal.

Pagamento Prêmio 2:

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

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

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

Pagamento Prêmio 1 tem curso normal.

Pagamento Prêmio 2:

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

Consulta

Características de Contrato de Swap

Menu Swap > Consultas > Características de Contrato de Swap

Visão Geral

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

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

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

Tela Filtro Consulta Contratos

Consulta Contratos

Parte (Nome Simplificado)

Parte (Conta)

Código do Contrato

Tipo do Contrato

Situação do Contrato

Cesta Garantias

Agenda Prêmio

Reset

Funcionalidades

Indexador da Parte

Indexador da Contraparte

Contrato - Data de Registro

Data Vencimento

Evento - Data do Evento

Sistema Origem

Código IF Sistema Origem

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

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

Descrição dos Campos da Tela de Filtro Consulta Contratos

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

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

Tela de Relação

Consulta Contratos												
Página 1 de 2 (Linhas 1 a 25 de 41)												
Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 15:19:38												
 Critério de pesquisa												
Código do Contrato	Continuidade do Contrato	Tipo do Contrato	Data de Registro	Dt Última Correção	Dt Último Aditamento	Valor Base	Percentual Índice Termo	Índice Termo	PU Inicial Termo	PU Atual Termo	Dt PU Atual Termo	Fator de Atualização Termo
11D00000950	CONFIRMADO	CONSTANTE	18/04/2011			10.000,00						0,00000000

(continua)

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

(continua)

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

(continua)

								CONTRAPARTE							
Diferença da Curva	Cesta de Garantias	Lim. Inf.	Lim. Sup.	Lim. Inf. Libor	Lim. Sup. Libor	Lim. Inf. TJMI	Lim. Sup. TJMI	Contraparte	Nome Simplificado	CPF/CNPJ	Ponta	Percentual do indexador	Indexador	Dt Atualizacao	PU Inicial
-5.332,69								05000.10-8	RIOBM	296.366.368-42	P2	100,00	VCP		1,00000000

(continua)

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

(continua)

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

(continua)

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

(fim)

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

Descrição dos Campos da Tela de Relação

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

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

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

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

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

Campo	Descrição
Nome Simplificado	Nome simplificado do Responsável pela Aceleração

Agenda de Eventos

Menu Swap > Consultas > Agenda de Eventos

Visão Geral

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

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

Tela Filtro Consulta Agenda

Consulta Agenda de Eventos

Código do Contrato

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

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

Tela de Relação

Consulta Agenda de Eventos

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


Critério de pesquisa

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

<<
1
Exibir página
>>

Atualizar
Voltar

Obter no formato:
Excel

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

Tela Detalhe Agenda de Eventos

Agenda de Eventos							
Código do Contrato 11D00000950							
Data Registro 18/04/2011		Data Início 15/04/2011		Data Vencimento 17/10/2016			
Valor Base 10.000,00		Valor Amortizado 5.454,54					
Parte				Contraparte			
Parte (Conta) 05000.00-5		Parte (Nome Simplificado) RIOBM		Contraparte (Conta) 05000.10-8		Contraparte (Nome Simplificado) RIOBM	
Percentual 100,00		Curva DI		Percentual 100,00		Curva VCP	
+/-		Juros(% aa) 0,0000		+/-		Juros(% aa) 0,0000	
Data Atualizacao da Parte 23/07/2014		Valor da Curva Atualizado - Parte 4.667,31		Data Atualizacao da Contraparte		Valor da Curva Atualizado - Contraparte 10.000,00	
Dados do Evento							
Data Original 17/10/2011	Data Ocorrencia 17/10/2011	Operação PAGAMENTO DE JUROS	Dias Úteis 126	Taxa TJMI	% Amortização	Tx Juros (ñ constante)	Estado ATIVO
Lim. Inf.	Lim. Sup.						

Nesta tela o Participante pode consultar detalhadamente o evento selecionado.

Fluxo não Constante

Menu Swap > Consultas > Fluxo não Constante

Visão Geral

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

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

Tela Filtro Consulta de Fluxo da Caixa Não Constante

Consulta de Fluxo de Caixa Não Constante

Código do Contrato

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

Tela Detalhe Consulta de Fluxo da Caixa Não Constante

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

Fluxo Não Constante Ponta 1					
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2008	+	3,0000			2,62300
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2009	+	3,0000			2,68900
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2009	+	3,0000			2,75700
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2010	+	3,0000			2,82700
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2010	+	3,0000			2,89900
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2011	+	3,0000	0,00000000		2,97300
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2011	+	3,0000			3,04800
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2012	+	3,0000			3,12600
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2012	+	3,0000			3,20500
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2013	+	3,0000			3,28700
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2013	+	3,0000			3,37000
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2014	+	3,0000			3,45600
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2014	+	3,0000			3,54300
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2015	+	3,0000			3,63300
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/08/2015	+	3,0000			3,72600
Data	+/-	Juros(% aa)	Lim. Inferior	Lim. Superior	Taxa Amortização
04/02/2016	+	3,0000			3,82000

(continua)

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

Fluxo Não Constante Ponta 2

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

(continua)

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

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

(fim).

Histórico de Parâmetros Para Disparo de Reset

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

Visão Geral

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

Tela Filtro do Histórico de Parâmetros

Histórico de Parâmetros para Disparo de Reset

Parte (Nome Simplificado)
 Parte (Conta) - -
 Contraparte (Nome Simplificado)
 Contraparte (Conta) - -
 Código do Contrato
 Forma de Disparo
 Data Registro / / - / /

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

Descrição dos Campos da Tela Filtro Histórico de Parâmetros

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

Tela de Relação

Histórico de Parâmetros para Disparo de Reset

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 6 de 6)

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



Critério de pesquisa

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

<< 1 >> Exibir página

Atualizar

Voltar

Obter no formato:

Excel

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

Tela Detalhe Histórico de Parâmetros

Histórico de Parâmetros para Disparo de Reset

Dados do Contrato

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

Permissibilidade para Registros

Curvas Marcadas a Mercado	Reset
PONTA 2	PONTA 2

Condição de Disparo

Forma de Disparo	Credor
DATA	PONTA 1

Datas de Disparo

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

Voltar

Sair

Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Menu Swap > Consultas > Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Visão Geral

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

Tela Filtro Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Consulta de Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Parte (Nome Simplificado)	LEMEBM
Parte (Conta)	- -
Nome Simplificado Contraparte	
Contraparte (Conta)	- -
Código do Contrato	
Data de Registro	23 / 2 / 2014 - 23 / 7 / 2014
Pesquisar Limpar Campos Desistir	

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

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

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

Tela de Relação

Consulta de Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 12 de 12)

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



Data de Registro	Código do Contrato	Parte (Nome Simplificado)	Parte (Conta)	Nome Simplificado Contraparte	Contraparte (Conta)	Fator Parte	Fator Contraparte	Diferencial das Curvas	Credor	Código do Usuário
06/06/2014 00:00:00	14F00000315	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	10,00000000	10,00000000	0,00	PONTA 1	HFERSI
06/06/2014 00:00:00	14F00000315	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	10,00000000	10,00000000	0,00	PONTA 2	HFERSI
28/04/2014 00:00:00	14D00031126	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	10.009,00000000	10.008,00000000	1.000,00	PONTA 1	P21402
28/04/2014 00:00:00	14D00031126	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	1.005,00000000	1.006,00000000	1.000,00	PONTA 2	P21402
28/04/2014 00:00:00	14D00031126	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	100.010,00000000	100.002,00000000	8.000,00	PONTA 1	P20349
28/04/2014 00:00:00	14D00031126	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	100.002,00000000	100.010,00000000	8.000,00	PONTA 1	P20349
28/04/2014 00:00:00	14D00031126	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	10.008,00000000	10.009,00000000	1.000,00	PONTA 1	P21402
28/04/2014 00:00:00	14D00031126	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	1.006,00000000	1.005,00000000	1.000,00	PONTA 2	P21402
07/04/2014 00:00:00	14D00000255	LEMEBM	10020.00-1	MOSSOROB	01535.00-0	100.000,00000000	1,00000000	99.999.000,00	PONTA 2	SANDIM
07/04/2014 00:00:00	14D00000278	LEMEBM	10020.00-1	MOSSOROB	01535.00-0	100.000,00000000	1,00000000	99.999.000,00	PONTA 2	SANDIM
03/04/2014 00:00:00	14D00000178	LEMEBM	10020.00-1	LEMEBM	10020.10-4	1,00000000	100.000,00000000	99.999.000,00	PONTA 2	TDSS
03/04/2014 00:00:00	14D00000178	LEMEBM	10020.10-4	LEMEBM	10020.00-1	100.000,00000000	1,00000000	99.999.000,00	PONTA 2	TDSS

<< 1 >>

Atualizar Voltar

Obter no formato: Excel

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

Características de Contrato de Swap

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

Características

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

Exclusivo para Contrato à Termo

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

Curvas para Atualização

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

Terceira Curva

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

(continua)

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

Voltar

Sair

[Versão para Impressão](#)

(fim)

Histórico Reset

Menu Swap > Consultas > Histórico de Reset

Visão Geral

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

Tela Filtro Histórico de Reset

Histórico de Reset

Parte (Nome Simplificado)

LEMEBM X

Parte (Conta)

Contraparte (Nome Simplificado)

Contraparte (Conta)

Código do Contrato

Liquidação do Reset

▼

Data Registro

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

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

Descrição dos Campos da Tela Filtro Histórico de Reset

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

Tela de Relação

Histórico de Reset

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 9 de 9)

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



Critério de pesquisa

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

<< 1 >>

Exibir página

Atualizar

Voltar

Obter no formato:

Excel

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

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

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

Resumo de Contratos

Menu Swap > Consultas > Resumo de Contratos

Visão Geral

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

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

Tela Filtro Resumo de Contratos

Filtro Consulta Resumo dos Contratos

Parte

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

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

Tela de Relação

Consulta Resumo dos Contratos

Página 1 de 6 (Linhas 1 a 25 de 138)

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



Critério de pesquisa

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

Atualizar

Voltar

◀ ◀ Exibir página ▶ ▶▶

Obter no formato:

Excel



Contratos com Opção de Arrependimento

Menu Swap > Consultas > Contratos com Opção de Arrependimento

Visão Geral

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

Tela Filtro Contratos com Opção de Arrependimento

Consulta Contratos Com Opção de Arrependimento do Participante

Parte

Data

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

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

Tela de Relação

Consulta Contratos Com Opção de Arrependimento do Participante

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 7 de 7)

Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 16:39:41



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

« 1 » Exibir página » »

Atualizar

Voltar

Obter no formato:

Excel

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

Contratos de Swaption/Compound

Menu Swap > Consultas > Contratos Swaption/Compound

Visão Geral

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

Tela Filtro Contratos Swaption/Compound

Consulta de Contratos Swaption/Compound Participante

Parte

Data

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

Tela de Relação

Consulta de Contratos Swaption/Compound Participante

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 3 de 3)

Data e Hora da Consulta: 19/11/2014 - 14:49:42

 **Critério de pesquisa**

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

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

Histórico de Alteração de Contratos

Menu Swap > Consultas > Consulta Histórico

Visão Geral

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

Tela Filtro Consulta Histórico

Consulta Historico - Alteração de Contratos

Parte (Nome Simplificado)	RIOBM
Parte (Conta)	05000 00 5
Código do Contrato	
Tipo do Contrato	CONSTANTE
Situação do Contrato	CONFIRMADO
Indexador da Parte	
Indexador da Contraparte	

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

Descrição dos Campos Tela Filtro Consulta Histórico

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

Tela de Relação

Consulta Contratos Alterados

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 4 de 4)

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



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

<< 1 >> Exibir página

Obter no formato:

Excel

(continua)

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

(continua)

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

Atualizar

Voltar

(continua)

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

(continua)

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

(fim)

Consulta Tipo Classe

Curvas Não-Calculadas (VCP)

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

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

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

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

Informação obrigatória de dados adicionais

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

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

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

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

Curvas Disponíveis

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

*Sistema NoMe > Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos > **AAAAMMDD_
_INDEXADORESSWAP_VCP.TXT***

Cadastro de novos ativos subjacentes

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

A seguir também estão listadas as curvas disponíveis para VCP.

Moedas

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
17	US\$ Austrália	Dólar (Austrália)	1) As curvas de moeda desta categoria se referem à paridade entre a moeda estrangeira da curva e o real (BRL/ME).	1) Informações sobre a moeda Informar no campo "Denominação": fonte de informação; tipo de cotação (Compra, Venda, Média) e horário de consulta da cotação. Caso seja utilizada a paridade invertida entre a moeda estrangeira e o real (ME/BRL ao invés de BRL/ME), informar "paridade invertida" no campo "Denominação".
18	US\$ Canadá	Dólar (Canadá)		2) Cross Rate Informar no campo "Denominação" se há cross rate, e se houver, informar qual a moeda de passagem utilizada, a fonte de informação, tipo de cotação (Compra, Venda, Média) e horário de consulta da cotação. 3) Cotação inicial Informar exclusivamente no campo "Cupom Limpo". a) Caso o campo "Cupom Limpo" não seja preenchido, será considerada como cotação inicial a cotação na data de referência resultante do deslocamento informado no campo "Data de Cotação" em relação à data de início. Caso a "Data de Cotação" seja D0, indicar esta informação no campo "Denominação" e o combo do campo "Data de Cotação" não deverá ser preenchido. b) Se houver Cross Rate, informar no campo "Denominação" a cotação inicial da moeda de passagem em relação ao real.
21	US\$ Spot	Dólar US Spot		
22	Euro	Euro		
23	Coroa Suécia	Coroa (Suécia)		
24	Lira Turquia	Lira (Turquia)		
25	Libra Inglesa	Libra (Inglaterra)	2) As moedas devem ser utilizadas exclusivamente como fator de correção cambial, contemplando a variação entre a cotação definida para o vencimento e a indicada para a data de início do contrato.	4) Fixing para vencimento: Informar no campo "Data de Cotação". a) Caso o fixing para vencimento seja D0, informar no campo "Denominação". b) Na hipótese de utilização de cross rate com "Data de Cotação" distinta entre as moedas, ambas as datas devem ser informadas no campo "Denominação".
26	Iene Spot	Iene (Japão)		
27	Yuan China	Yuan (China)		
50	Ringgit Malásia	Ringgit Malásia		
53	Coroa Noruega	Coroa Noruega	3) Permitida a utilização com ou sem cross rate para apuração das cotações para estes códigos de Tipo_Classe.	5) Sobre cupom de juros/spread , informar, quando houver: a) cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)", i. Caso o cupom de juros/spread não seja em % a.a., informar no campo "Denominação" a periodicidade (exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.) b) a base de cálculo do cupom de juros/spread no campo "Denominação"; c) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou
54	Franco Suíço	Franco Suíço		
55	Coroa Dinamarca	Coroa Dinamarca		
58	QAR/RIAL-Catar	QAR/RIAL-Catar		
69	Peso/ México	Peso/ México		
72	SOL PERUANO	SOL PERUANO		
74	Peso Argentino	Peso Argentino		
1011	US\$ Hong Kong	US\$ Hong Kong		
1013	WON/Coreia do Sul	WON/Coreia do Sul		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
1015	Peso Chileno	Peso Chileno		linear) no campo "Denominação".
59	Peso Colombiano	Peso Colombiano		6) Incidência de juros
6440	PYG	GUARANI/PAR AGUAI (BACEN 450)		a) informar caso a incidência seja sobre parcela no campo "Denominação".
7986	RÚPIA	RUPIA INDIA		7) Se utilizada a média de cotações:
8089	Shekel	Shekel (Israel)		a) informar no campo "Denominação" as datas das cotações para média aritmética, ou;
8226	Florim	Florim (Hungria)		b) informar no campo "Denominação" as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.
8227	Zloty	Zloty (Polônia)		
8346	RIAL	RIAL ARABIA SAUDITA		
9233	Rand	Rand (África do Sul)		
10876	Dólar de Singapura - SGD	Dólar de Singapura - SGD		8) Limitador Inferior ou Superior , quando houver:
12367	Cólon costarriquenho	Cólon costarriquenho		a) deve ser indicado exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)",
				i. Caso o limitador informado no campo "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)" seja em valor, mencionar no campo "Denominação". Caso não seja feita nenhuma menção nesse sentido, será entendido que o limitador está na forma de fator arbitrado.
				b) informar no campo "Denominação" se o limitador é sobre:
				i. a variação cambial sobre juros e amortização
				ii. a variação cambial incidente sobre a amortização, somente
				iii. a variação cambial incidente sobre os juros, somente.
				c) Para operações com Cross Rate, caso o limitador incida sobre a paridade entre a moeda da curva e a moeda de passagem, informar no campo "Denominação". Se não for feita nenhuma menção nesse sentido, será entendido que o limitador incide sobre a paridade entre a moeda da curva e o real.

Taxas de Juros Nacionais

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

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

Taxas de Juros Internacionais

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

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

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
				ii. a variação cambial iii. a variação cambial incidente sobre a amortização, somente iv. a variação cambial incidente sobre o cupom, somente v. a taxa de juros mais o cupom vi. o PU da curva (que abrange juros, cupom e a variação cambial) 8) Incidência de juros a) informar caso a incidência seja sobre parcela no campo "Denominação".

Índices

Índices de Preço

[illegible]

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

Índices Nacionais

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

Índices Internacionais

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

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
9277	DAX Index	Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX		c) Informar o fixing para vencimento do ativo somente quando este for diferente do fixing da moeda em que o ativo é cotado no campo "Denominação".
10454	BNPID8UA Index	BNP PARIBAS MULTI-ASSET DIVERSIFIED VOL8 USD FX HE		5) No caso de cupom de juros, informar quando houver:
10595	UKX INDEX	FTSE 100 INDEX		a) cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" e; i. Caso o cupom de juros/spread não seja em % a.a., informar no campo "Denominação" a periodicidade (exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.). b) base de cálculo do cupom de juros/spread, exclusivamente no campo "Denominação", e; c) informar a metodologia de cálculo (exponencial ou linear) exclusivamente no campo "Denominação". 6) Limitadores: É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
10773	BNPI8DUF Index	BNP Paribas M. Diversified Vol 8 USD FX Hedged Future Index		
11021	DX Y Curncy	US Dollar Index (USDX)		
11041	VIX INDEX	CHICAGO B.O.E SPX VOLATILITY INDEX		
11582	CAC Index	CAC 40 Index		
12126	SPECFR6P	S&P Economic Cycle Factor Rotator Index		
12127	SP5LVI	S&P 500 Low Volatility Index		
12228	TPX Index	Tokyo Stock Exchange Tokyo Price Index TOPIX		
12567	NDX Index	NASDAQ 100 STOCK INDEX		
8166	SX7E Index	EURO STOXX Banks Price EUR		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
12949	SOLWGOAL Index	Solactive Sustainable Development Goals World MV Index		
12948	BNPIECFT Index	BNP Paribas Fd – Emerging Markets Corporate Debt Funds Index (EUR)		
12947	BNPIMAD5 Index	BNP Paribas Multi Asset Diversified 5 Index		
12927	BNPICASE Index	BNP Paribas Core Alternative Strategies Index		
12988	EFJPFU5E Index	J.P. Morgan Fund-Linked Efficiente 5 Index		
12987	EFJPFE5N Index	J.P. Morgan Fund- Linked Efficiente 5 Index (Net ER)		
13107	BNPIMOMA Index	BNP Paribas Momentum Multi Asset 5		
13189	ENHABDAP Index	BEDROCK – DECALIA SILVER GENERATION INDEX		
13211	CPURNSA Index	US CPI URBAN CONSUMERS NSA		
13108	VGT US Equity	VANGUARD INFO TECH ETF		
13109	JNK US Equity	SPDR Bloomberg Barclays High Yield Bond ETF		
13299	SPXT10UE Index	S&P 500 Daily Risk Control 10 USD ER Index		
13289	GSIS150B Index	GS Risk Premia Basket Series 150 BRL ER Strategy		
13329	MSDIUSP7 Index	Morningstar Ultimate Stock-Pickers Target Vol 7		
13709	JPUSFTRC Index	JP Morgan Global Total Return FT Index		
13749	ENHAEMD5 Index	Emerging Markets Debt Fund Linked 5 TR Index		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
13991	Futuro de DXY Index	US DOLLAR INDEX FUTURE		
14544	CSTREND Index	CS BALANCED TREND 5 INDEX		
14643	MJ US Equity	ETFMG ALTERNATIVE HARVEST ETF		
14804	CSEAGG20 Index	CS Global Video Gaming and eSports 20%		
15244	CIEQPU01 Index	CITI EQUITY PUT RATIO US SERIES 1 INDEX		
15245	CIEQDUV3 Index	CITI EQUITY DISPERSION BASKET VN US SERIES 3 INDEX		
15246	CIEQCUOI Index	CITI EQ US 3M EQUITY CONGESTION (D) INDEX		
15327	MSUSMPT6 Index	MS MAP TREND 6 VOL INDEX		
15328	MSFDVT12 Index	DIGITAL VT12		
15329	MSFDMSV9 Index	MSIM GLOBAL OPPORTUNITY VT9		
15330	MSFDMS11 Index	MSIM US GROWTH VT11		
15345	TLT US Equity	ISHARES 20 YEAR TREASURY BOND ETF		
15449	SPXESUP Index	S&P 500 ESG INDEX		

ETFs

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

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

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

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
8806	EWY US Equity	ISHARES MSCI SOUTH KOREA CAP		
9213	AAXJ UQ Equity	ISHARES MSCI ALL COUNTRY ASI		
9315	SX5EEX GY EQUITY	ISHARES EUROSTOXX50 UCITS D		
9396	STQ FP EQUITY	SPDR MSCI EUROPE INDUSTRIALS		
9478	QQQ US Equity	POWERSHARES QQQ TRUST SERIES		
9518	MCHI US Equity	ISHARES CHINA ETF		
9539	VGK UP Equity	VANGUARD FTSE EUROPE ETF		
9541	EWJ UP Equity	ISHARES MSCI JAPAN ETF		
9580	HYG US EQUITY	ISHARES IBOXX HIGH YIELD COR		
9589	IYT US EQUITY	ISHARES TRANSPORTATION AVERA		
9667	ACWI US Equity	ISHARES MSCI ACWI ETF		
9828	INDA UP Equity	ISHARES MSCI INDIA ETF		
9830	ISF LN Equity	ISHARES CORE FTSE 100 UCITS		
9868	ASHR US Equity	DEUTSCHE X-TRACKERS HARVEST		
9888	SJNK US EQUITY	SPDR BARCLAYS SHORT-TERM HIG		
10130	AAXJ UP Equity	ISHARES MSCI ALL COUNTRY ASI		
10191	XLE US Equity	ENERGY SELECT SECTOR SPDR		
10292	USO UP Equity	UNITED STATES OIL FUND LP		
10359	USO US Equity	UNITED STATES OIL FUND LP		
10455	FAZ US Equity	DIREXION DAILY FINANCIAL BEAR 3X SHARES		
10473	GLD UP Equity	SPDR GOLD SHARES		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
10577	LQD US Equity	ISHARE IBOXX INVESTMENT GRA		
10580	EWT US Equity	ISHARES MSCI TAIWAN ETF		
10693	JPXN US Equity	ISHARES JPX – NIKKEI 400 ETF		
10733	IWM US Equity	ISHARES RUSSEL 2000 ETF		
10753	VIXY US Equity	PROSHARES VIX SHORT - TERM FUT		
10493	IVV US Equity	iShares Core S&P 500 ETF		
10856	BRZU US Equity	DIREXION DAILY BRAZIL BULL 3		
10961	EWA US Equity	Ishares MSCI Australia ETF		
11141	XRT US Equity	SPDR S&P RETAIL ETF		
11562	EMB US Equity	iShares JP Morgan USD Emerging Markets Bond ETF		
11804	ECH US Equity	ISHARES MSCI CHILE CAPPED ET		
12085	VXX US Equity	IPATH S&P 500 VIX S/T FU ETN		
12327	EZU US Equity	ISHARES MSCI EUROZONE ETF		
12447	GLOBAL X MSCI ARGENTINA ETF	ARGT US Equity		
12767	QQQ UQ Equity	INVESCO QQQ TRUST SERIES 1		
13649	GXG US Equity	GLOBAL X MSCI COLOMBIA ETF		
13729	ACWX US Equity	ISHARES MSCI ACWI EX US ETF		
13769	SMIN US Equity	ISHARES MSCI INDIA SMALL-CAP		
14090	SQQQ US Equity	ProShares UltraPro Short QQQ		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
14130	SRTY US EQUITY	PROSHARES ULTRAPRO SHRT R2K		
14159	SPXU US EQUITY	PROSH ULTRAPRO SHORT S&P 500		
14190	QID US EQUITY	PROSHARES ULTRASHORT QQQ		
14250	GDX US EQUITY	VANECK GOLD MINERS ETF		
14312	IJR US Equity	ISHARES S&P SMALL-CAP E		
14391	IB5M11 BZ Equity	It Now ETF IMA-B5 Fundo de Índice		
14392	IRFM11 BZ Equity	It Now IRF-M P2 Fundo de Índice		
14393	IMAB11 BZ Equity	It Now ID ETF IMA-B Fundo de Índice		
14847	IYW UP Equity	ISHARES USTECHNOLOGY ETF		
14848	JJC US Equity	IPATH SERIES B BBG COPPER ETN		
14849	OESA GR Equity	WT BRENT CRUDE IOL 1MTH ETC		
14850	TUR US Equity	ISHARES MSCI TURKEY ETF		
14886	SLX US Equity	VANECK STEEL ETF		
14887	COPX US Equity	GLOBAL X COPPER MINERS ETF		
14904	CRAK US Equity	VANECK OIL REFINERS ETF		
14965	FEZ US Equity	SPDR EURO STOXX 50 ETF		
14968	IEF US Equity	ISHARES 7-10 YEAR TREASURY B		
14988	XOP US Equity	SPDR S&P OIL & GAS EXP & PR		
14990	GREK US Equity	GLOBAL X MSCI GREECE ETF		
14991	EWU US Equity	ISHARES MSCI UNITED KINGDOM		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
15004	EWUS US Equity	ISHARES MSCI UNITED KINGDOM		
15007	IVVB11 BZ Equity	ISHARES S&P 500 FIC FI IE		
15024	EWZ UP Equity	ISHARE MSCI BRAZIL ETF		
15044	XPH UP Equity	SPDR S&P PHARMACEUTICALS ETF		
15064	XLV UP Equity	HEALTH CARE SELECT SECTOR		
15065	IWM UP Equity	ISHARES RUSSEL 2000 ETF		
15066	BKLN US Equity	INVESCO SENIOR LOAN ETF		
15124	RSX US Equity	VANECK VECTORS RUSSIA ETF		
15127	SIL US Equity	GLOBAL X SILVER MINERS ETF		
15164	DBB US Equity	INVESCO DB BASE METALS FUND		
15185	ESGU US Equity	ISHARES TRUST ISHARES ESG MS		
15186	ESGE US Equity	ISHARES ESG MSCI EM ETF		
15187	ESGD US Equity	ISHARES ESG MSCI EAFE ETF		
15204	MCHI UP Equity	ISHARES MSCI CHINA ETF		
15224	URTH US Equity	ISHARES MSCI WORLD ETF		
15285	DSI UP Equity	ISHARES MSCI KLD 400 SOCIAL		
15324	GDXJ US Equity	VANECK JR GOLD MINERS		
15388	KWEB US Equity	KRANESHARES CSI CHINA INTERNET ETF		
15408	VNQ US Equity	VANGUARD REAL ESTATE ETF		
15417	ICLN US Equity	ISHARES GLOBAL CLEAN ENERGY ETF		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
15418	UUP UP Equity	INVESCO DB US DOLLAR INDEX BULLIS FUND		
15419	JJN US Equity	IPATH SERIES B BLOOMBERG NICKEL SUBINDEX		
15421	XHB US Equity	SPDR S&P HOMEBUILDERS ETF		
15423	DBA US Equity	INVESCO DB AGRICULTURE FUND		
15429	SHE US Equity	SPDR SSGA GENDER DIVERSITY ETF		
15430	QQQ UP Equity	INVESCO QQQ TRUST SERIES 1		
15431	MCHI UN Equity	ISHARES MSCI CHINA ETF		
15432	Ewt up equity	ISHARES MSCI TAIWAN ETF		
15492	SKYY UP Equity	FIRST TRUST CLOUD COMPUTING ETF		
15495	IXJ US Equity	ISHARES GLOBAL HEALTHCARE ETF		

Futuro de Índices

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

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5198	MES INDEX - mini MSCI Emg Mkt	mini MSCI Emerging Markets (EM) Index Future		
6259	FTSE 100 INDEX FUTURE	FTSE 100 INDEX FUTURE		
7421	EURO STOXX Banks Index Futures (FESB)	Futuro do Índice Euro Stoxx Banks		
9395	The SGX Nifty Index Future	The SGX Nifty Index Future		
9438	The FTSE/JSE Top 40 Index Future	The FTSE/JSE Top 40 Index Future		
9540	SPY UP Equity	SPDR S&P 500 ETF TRUST		
10898	Futuro Mini Russell 2000	Futuro Mini Russell 2000		

Outros Índices

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

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

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

Futuro de Taxas de Juros

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

Futuro de Moedas

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

Futuro de Mercadorias

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

10050	MINI FUTURO DE OURO	MINI FUTURO DE OURO
10636	FUTURO DE RUBBER	FUTURO DE RUBBER - BORRACHA
14310	FUTURO DE AÇUCAR	FUTURO DE AÇUCAR (SUGAR FUTURE)
14311	FUTURO DE ZINCO	FUTURO DE ZINCO (ZINC FUTURE)
14925	Futuro de Palladium	Futuro de Palladium
15006	Futuro de Platina	PLATINUM FUTURE
15428	Mini Futuro de Prata	E-MINI SILVER FUTURES

exclusivamente no campo “Denominação”. Indicar também o sinal “+” ou “-”.

d) Caso o spread seja sobre o preço inicial e final, informar exclusivamente no campo “Denominação”.

5) Se utilizada a média de cotações:

a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou

b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.

6) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.

a) Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.

Futuro de Ativos

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

Ações Nacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5035	BICB4		1) As ações devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.	1) Informação da ação e sua cotação inicial indicada exclusivamente no campo "Cupom Limpo". É possível indicar que o valor informado no campo "Cupom Limpo" é um percentual (%) da cotação de D0 da data de início do Swap. Caso não seja feita a menção no campo "Denominação", o preenchimento será assumido como valor.
5036	BRKM5			
5037	AMAR3			
5038	DAYC4			
5039	PINE4			
5040	BEEF3			
5041	SMT03			
5042	HYPE3	HYPER MARCAS		
5043	SANB11			
5045	BBDC4	BRADERCO PN		
5046	CSNA3	SID NACIONAL ON	2) Somente será permitida a utilização de ação com divulgação pública das negociações, possibilitando a aferição do contrato.	2) Indicação da fonte de informação; Cotação de fechamento, mínima, média, máxima ou Spot (cotação referente a um horário e fonte de informação específicos) que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual (%); Horário da Cotação; Data de cotação, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação"; e quando for o caso, Câmbio para conversão. 3) Informar, quando houver, cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" a) Na base 360; b) Na base 252; 4) Se utilizada a média de cotações: a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada. c) informar, se houver, limitadores inferior e/ou superior do preço composto pela média das cotações, podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial. 5) Tratamento de Proventos: O procedimento da Cetip para aferição dos contratos levará em consideração a possibilidade de ajustes em função do pagamento de proventos, tais como bonificação, subscrição, juros sobre capital próprio e dividendo. a) As partes deverão indicar os casos em que haja existência (ou não) de cláusulas de proteção contra proventos em dinheiro, e indicar se a proteção contra proventos dar-se-á sobre proventos pagos durante a operação, sobre proventos anunciados e não pagos durante a operação (proventos pagos ex), ou sobre os dois casos. b) Para os proventos em dinheiro, os ajustes serão efetuados pela incorporação dos valores pagos a curva corrigida pela variação da ação, por ocasião da conversão para ex direito na bolsa. O montante do provento a ser incorporado levará em consideração a quantidade de ações passíveis de serem adquiridas na
5047	GGBR4	GERDAU PN		
5048	PETR4	PETROBRAS PN		
5049	VALE5	VALE PNA		
5056	BVMF3	BMFBOVESPA ON		
5057	PDGR3	PDG REALT ON		
5058	VALE3	VALE ON		
5059	PETR3	PETROBRAS ON		
5060	USIM5	USIMINAS PNA		
5061	CYRE3	CYRELA REALT ON		
5062	MRVE3	MRV ON		
5063	GISA3	GAFISA ON		
5064	RSID3	ROSSI RESID OND		
5065	CIEL3	CIELO ON		
5066	AMBV4	AMBEV PN		
5067	MMXM3	MMX MINER ON		
5068	LREN3	LOJAS RENNER ON		
5069	BRFS3	BRF FOODS ON		
5070	TIMP3	TIM PART S/A ON		
5071	LAME4	LOJAS AMERIC PN		
5072	CMIG4	CEMIG PN		
5073	BRML3	BR MALLS PAR ON		
5074	NTCO3	NATURA ON		
5075	PCAR4	P.ACUCAR-CBD ON		
5076	MRFG3	MARFRIG ON		
5077	HGTX3	CIA HERING ON		
5078	GOAU4	GERDAU MET PN		
5079	BISA3	BROOKFIELD ON		
5080	JBSS3	JBS ON		
5081	CCRO3	CCR SA ON		
5082	VIVT4	TELEF BRASIL		
5083	GOLL4	GOL PN		
5088	TRPN3	TARPON INV ON		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5092	TPIS3	TRIUNFO PART ON		data de início do contrato através do valor base do mesmo ou da quantidade remanescente de ações, para o caso de médias asiáticas, bem como as alterações da quantidade inicial em função de bonificação ou qualquer evento que altere a referida quantidade.
5093	SUZB5	SUZANO PAPEL PNA		i. Informar o indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) nos casos em que a correção do provento em dinheiro seja por outro indicador diferente da valorização da própria ação; ii. Informar também os casos em que haja cláusula que a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento; iii. Informar a taxa utilizada de descapitalização do provento pago ex, se houver este tratamento. iv. Informar em valor o Limitador Inferior ou Superior para os proventos em dinheiro, quando houver. c) Os ajustes relativos à subscrição ou qualquer outro direito de preferência serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela incorporação do valor teórico do direito de subscrição, na curva corrigida pela variação da ação; i. Informar os casos em que não haja previsão de ajuste em função de subscrição ou qualquer outro direito de preferência; ii. Informar o indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) nos casos em que a correção do valor referente ao ajuste de subscrição incorporado à curva seja por outro indicador diferente da valorização da própria ação. d) Para bonificação ou qualquer evento que altere a quantidade de ações os ajustes serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela correção do preço de referência pelo fator de bonificação. 6) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)". 7) É permitido utilizar participações de alta e de baixa (em percentual) sobre as curvas. a) Na hipótese de cada curva ter apenas uma participação, esta deve ser informada exclusivamente no campo "Percentual" em "Curvas para Atualização". b) Caso houver participações de alta e de baixa diferentes sobre as curvas, estas devem ser informadas (em percentual) no campo "Denominação", e o campo "Percentual" em "Curvas para Atualização" deve ser
5095	PMAM3	PARANAPANEMA ON		
5096	CZZ US EQUITY	COSAN LTD		
5117	RADL3	RAIA DROGASIL S/A		
5715	BRIN3 BZ EQUITY	BRASIL INSURANCE PARTICIPACO		
6097	JHSF3	JHSF PARTICIPACOES S.A.		
6381	BBAS3	BRASIL ON		
6382	ELET3	ELETROBRÁS ON		
6383	NETC4	NET PN		
6399	DIRR3	DIRECIONAL ENGENHARIA SA		
6400	ARTR3	ARTERIS S.A.		
6540	MMXM11	MMX MINER TPR NM		
7241	TBLE3 BZ EQUITY	Tractebel Energia SA		
7343	BRAP4	BRADESPAR PN		
7344	USIM3	USIMINAS ON		
7463	ABCB4 BZ EQUITY	BANCO ABC BRASIL SA		
7464	GSHP3 BZ EQUITY	GENERAL SHOPPING BRASIL SA		
7465	EVEN3 BZ EQUITY	EVEN CONSTRUTORA E INCORPORADORA SA		
7466	BTOW3 BZ EQUITY	B2W CIA DIGITAL		
7483	UGPA3 BZ EQUITY	UTRAPAR PARTICIPACOES SA		
7484	ABEV3 BZ EQUITY	AMBEV SA		
7485	AEDU3 BZ EQUITY	ANHANGUERA EDUCACIONAL PARTICIPACOES SA		
7486	ALLL3 BZ EQUITY	ALL AMERICA LATINA LOGISTICA SA		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
7487	BBDC3 BZ EQUITY	BANCO BRADESCO SA	preenchido como "100".	
7488	BBSE3 BZ EQUITY	BB SEGURIDADES PARTICIPACOES SA		
7489	BRPR3 BZ EQUITY	BR PROPERTIES SA		
7490	OIBR4 BZ EQUITY	OI SA		
7491	CESP6 BZ EQUITY	CESP		
7492	CPFE3 BZ EQUITY	CPFL ENERGIA SA		
7493	CPLE6 BZ EQUITY	COPEL		
7494	CRUZ3 BZ EQUITY	SOUZA CRUZ SA		
7495	CSAN3 BZ EQUITY	COSAN AS INDÚSTRIA E COMERCIO		
7496	CTIP3 BZ EQUITY	CETIP SA		
7497	DASA3 BZ EQUITY	DIAGNOSTICOS DA AMERICA SA		
7498	DTEX3 BZ EQUITY	DURATEX SA		
7499	ECOR3 BZ EQUITY	ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA E LOGISTICA SA		
7500	ELET6 BZ EQUITY	ELETROBRAS SA		
7501	ELPL4 BZ EQUITY	ELETROPAULO METROPOLITANA SA		
7502	ESTC3 BZ EQUITY	ESTACIO PARTICIPACOES SA		
7503	EMBR3 BZ EQUITY	EMBRAER SA		
7504	ENBR3 BZ EQUITY	ENERGIAS DO BRASIL SA		
7505	FIBR3 BZ EQUITY	FIBRIA CELULOSE SA		
7506	ITSA4 BZ EQUITY	INVESTIMENTOS ITAU SA		
7507	KROT3 BZ EQUITY	KROTON EDUCACIONAL SA		
7508	LIGT3 BZ EQUITY	LIGHT SA		
7509	QUAL3 BZ EQUITY	QUALICORP SA		
7510	RENT3 BZ EQUITY	LOCALIZA RENT A CAR SA		
7511	ITUB4 BZ EQUITY	ITAU UNIBANCO HOLDING SA		
7512	SBSP3 BZ EQUITY	SABESP		
7563	KLBN11 BZ EQUITY	KLABIN S.A. UNITS		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
7743	ABRE11 BZ EQUITY	Abril Educação		
7744	QGEP3 BZ EQUITY	QGEP Participações SA		
7803	TCSA3 BZ EQUITY	TECNISA SA		
8646	ABRE3 BZ Equity	ABRIL EDUCAÇÃO SA		
8826	GGBR3 BZ Equity	GERDAU S.A.		
8828	RLOG3 BZ Equity	COSAN LOGISTICA SA		
9208	ANIM3 BZ Equity	GAEC EDUCACAO SA		
9335	SHOW3 BZ EQUITY	T4F ENTRETENIMENT O SA		
9588	EQTL3 BZ EQUITY	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD		
10352	RUMO3 BZ Equity	RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL		
10413	SLED4 BZ Equity	SARAIVA SA LIVREIROS - PREF		
10514	TUPY3 BZ Equity	TUPY SA		
11201	CSMG3 BZ Equity	CIA DE SANEAMENTO DE MINAS GERAIS - COPASA		
11642	ODPV3 BZ Equiy	ODONTOPREV S.A.		
11903	SAPR4 BZ Equity	CIA SANEAMENTO DO PARANA-PRF		
11923	SUZB3 BZ Equity	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA		
11943	SAPR11 BZ Equity	CIA DE SANAMENTO DO PA-UNIT		
12004	ITUB3	ITAU UNIBANCO HOLDINGS SA		
13047	SMLS3 BZ Equity	SMILES FIDELIDADE SA		
13250	HAPV3 BZ Equity	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE		
13251	POMO4 BZ Equity	MARCOPOLO AS-PREF		
13252	MGLU3 BZ Equity	MAGAZINE LUIZA AS		
13253	STBP3 BZ Equity	SANTOS BRASIL PARTICIPACOES		
13429	B3SA3 BZ Equity	B3 AS BRASIL BOLSA BALCAO		
13850	SLCE3 BZ Equity	SLC AGRICOLA SA		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
13851	BRDT3 BZ Equity	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA		
13890	IRBR3 BZ Equity	IRB BRASIL RESSEGUROS SA		
13912	EGIE3 BZ Equity	ENGIE BRASIL ENERGIA SA		
13913	GRND3 BZ Equity	GRENDENE SA		
13914	RAPT4 BZ Equity	RANDON PARTICIPACOES AS-PREF		
13932	ENAT3 BZ Equity	ENAUTA PARTICIPACOES SA		
14075	TAE11 BZ Equity	TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA		
14231	BIDI11 BZ Equity	BANCO INTER SA- UNITS		
14970	TOTS3 BZ Equity	TOTVS SA		
15025	YDUQ3 BZ Equity	YDUQS PART		
15026	COGN3 BZ Equity	COGNA EDUCACAO		
15050	MTRE3 BZ Equity	MITRE REALTY EMPREENHIMENT OS		
15144	VVAR 3 BZ Equity	VIA VAREJO SA		
15284	NEOE3 BZ Equity	NEOENERGIA SA.		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
15425	BIDI4 BZ Equity	BANCO INTER SA		
15493	IGTA3 BZ Equity	IGUATEMI EMPRESA DE SHOPPING CENTERS SA		

Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira)

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

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

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

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

Ações Internacionais

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
2476	NVS US Equity	NOVARTIS AG-SPONSORED ADR	1) As Ações devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento. 2) Somente é permitida a utilização de Ações com divulgação pública das negociações, possibilitando a aferição do contrato	Informações Necessárias 1) Informações do ativo subjacente: a) Informar o Código da Ação; Fonte de informação; Tipo de Cotação (fechamento, mínima, média, máxima ou Spot - cotação referente a um horário e fonte de informação específicos) – que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for informada em percentual (%) no campo “Denominação”. Caso haja variação cambial, especificar as mesmas informações para a moeda. Se houver cross rate, especificar as mesmas informações também para a moeda de passagem. b) No caso de tratar-se de opção sobre a ação, informar adicionalmente o código deste contrato no campo “Denominação”. 2) Tipos de Variação de preço: a) No caso de variação Quanto, informar “ausência de variação cambial” ou “variação quanto” no campo “Denominação”. b) Se a variação de preços for em reais, informar “variação em reais” no campo “Denominação”. i. Caso haja <i>cross rate</i> para verificação da variação em reais, informar que há <i>cross rate</i> na variação em reais e a respectiva moeda de passagem utilizada. c) Caso não seja informado nenhuma das situações acima, será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que a ação é cotada, com variação cambial no campo “Denominação”. 3) Cotação Inicial e fixing para vencimento: a) Informar a cotação inicial da ação exclusivamente no campo “Cupom Limpo”, de acordo com o tipo de variação de preço. É possível indicar que o valor informado no campo “Cupom Limpo” é um percentual (%) da cotação de D0 da data de início do Swap. Caso não seja feita a menção no campo “Denominação”, o preenchimento será assumido como valor i. Em caso de utilização de variação cambial, informar a cotação inicial da moeda no campo “Denominação”.
2515	CNV US EQUITY	CNOVA NV		
5096	CZZ US EQUITY	COSAN LTD		
5101	AAPL US EQUIT	APPLE INC		
5102	BOLSAA MM EQUITY	BOLSA MEXICANA DE VALORES SA		
5103	PEN NO EQUITY	PANORO ENERGY ASA		
5104	BSMX US EQUITY	GRUPO FIN SANTANDER-ADR B		
5105	AVP US EQUITY	AVON PRODUCTS INC		
5109	JCP US EQUITY	J.C. PENNEY CO INC		
5111	GM US EQUITY	GENERAL MOTORS CO		
5112	BUD US EQUITY	ANHEUSER - BUSCH INBEV SPN ADR		
5113	RIO US EQUITY	RIO TINTO PLC - SPON ADR		
5118	AHL US EQUITY	ASPEN INSURANCE HOLDINGS LTD		
5126	CO FP EQUITY	CASINO GUICHARD PERRACHON		
5131	LGO CN EQUITY	LARGO RESOURCES LTD		
5136	CPA US EQUITY	COPA HOLDINGS SA		
5138	TX US EQUITY	TERNIUM SA		
5139	EC US EQUITY	ECOPETROL SA		
5141	LFL USEQUITY	LATAM AIRLINES GROUP SA		
5142	NUE USEQUITY	NUCOR CORP		
5145	PAM US EQUITY	PAMPA ENERGIA SA		
5146	MEXCHEM* MM EQUITY	MEXICHEM SAB DE CV		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5147	WFC US EQUITY	WELLS FARGO & CO		ii. Caso haja <i>cross rate</i> para verificação da variação em reais, informar no campo “Denominação”: (1) a cotação inicial da paridade entre a moeda em que a ação é cotada e a moeda de <i>cross rate</i>, e (2) a cotação inicial da paridade entre a moeda de <i>cross rate</i> e o real. b) O fixing para vencimento da moeda deverá ser informado exclusivamente no campo “Data de Cotação”. ii. Caso haja <i>cross rate</i> para verificação da variação em reais, com fixings para vencimento distintos entre as moedas, ambos os fixings devem ser informadas no campo “Denominação” (fixing para vencimento da paridade entre a moeda em que a ação é cotada e a moeda de <i>cross rate</i>, e fixing para vencimento da paridade entre a moeda de <i>cross rate</i> e o real). c) Informar o fixing para vencimento da ação somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a ação é cotada no campo “Denominação”. 4) Sobre Cupom de Juros/Spread, informar, quando houver cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos “+/-” e “Juros (% a.a.)”. 5) Se utilizada a média de cotações: a) informar as datas das cotações para média aritmética simples no campo “Denominação”; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada no campo “Denominação”. c) informar, se houver, limitadores inferior e/ou superior do preço composto pela média das cotações, podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial no campo “Denominação”. 6) Limitadores: É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior devem ser indicados, na forma de fator arbitrado, exclusivamente nos campos “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”. 7) Metodologia de Cálculo: Caso metodologia de cálculo seja dada pela quantidade de contratos, indicar essa metodologia e a respectiva quantidade no campo “Denominação”.
5152	SIX US EQUITY	SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP		
5154	DUFN VX EQUITY	DUFRI AG		
5163	PTC PL EQUITY	PORTUGAL TELECOM SGPS S/A		
5164	FTE FP EQUITY	FRANCE TELECOM S/A		
5165	TEF SM EQUITY	TELEFONICA S/A		
5166	DTE GR EQUITY	DEUTSCHE TELEKOM AG		
5167	TIT IM EQUITY	TELECOM ITALIA SPA		
5176	PBR US EQUITY - Petróleo	PETRÓLEO BRASILEIRO S/A - ADR		
5178	CULTIBAB MM EQUITY	ORGANIZACION CULTIBA SAB CV		
5179	BP US EQUITY	BP PLC - SPONS ADR		
5180	VALE US EQUITY	VALE SA-SP ADR		
5181	GSANBOB1 MM EQUITY	GRUPO SANBORNS SA DE CV		
5184	PRE CN EQUITY	Pacific Rubiales Energy Corp		
5185	BKW US EQUITY	Burger King Worldwide Inc.		
5195	AMX US EQUITY	América Movil SAB de CV		
5196	DL NA EQUITY	DELTA LLOYD NV		
5197	TSCDY US EQUITY	TESCO PLC - SPONSORED ADR		
5202	TV US EQUITY	GRUPO TELEVISIA SA-SPON ADR		
5203	TSCO LN EQUITY	TESCO PLC		
5206	IENOV * MM	INFRAESTRUTURA ENERGETICA N		
5629	NIHD US EQUITY	NII HOLDINGS INC		
5609	RAL FP EQUITY	RALLYE SA		
5631	LAN CI EQUITY	LATAM AIRLINES GROUP S/A		
5672	MT US EQUITY	ARCELORMITTAL NY REGISTERED		
5693	FMX US EQUITY	Fomento Económico Mexicano SAB de CV		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
5694	WALMEXV MM EQUITY	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV		8) Tratamento de Proventos: O procedimento da Cetip para aferição dos contratos levará em consideração a possibilidade de ajustes em função do pagamento de proventos, tais como bonificação, subscrição, juros sobre capital próprio e dividendo. a) As partes deverão indicar os casos em que haja existência (ou não) de cláusulas de proteção contra proventos em dinheiro, e indicar se a proteção contra proventos dar-se-á sobre proventos pagos durante a operação, sobre proventos anunciados e não pagos durante a operação (proventos pagos ex), ou sobre os dois casos no campo “Denominação”. b) Para os proventos em dinheiro, os ajustes serão efetuados pela incorporação dos valores pagos a curva corrigida pela variação da ação, por ocasião da conversão para ex direito na bolsa. O montante do provento a ser incorporado levará em consideração a quantidade de ações passíveis de serem adquiridas na data de início do contrato através do valor base do mesmo ou da quantidade remanescente de ações, para o caso de médias asiáticas, bem como as alterações da quantidade inicial em função de bonificação ou qualquer evento que altere a referida quantidade. i. Informar o indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) nos casos em que a correção do provento em dinheiro seja por outro indicador diferente da valorização da própria ação no campo “Denominação”; ii. Informar também os casos em que haja cláusula que a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento no campo “Denominação”; iii. Informar a taxa utilizada de descapitalização do provento pago ex, se houver este tratamento no campo “Denominação”. iv. Informar em valor o Limitador Inferior ou Superior para os proventos em dinheiro, quando houver no campo “Denominação”. c) Os ajustes relativos à subscrição ou qualquer outro direito de preferência serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela incorporação do valor teórico do direito de subscrição, na curva corrigida pela variação da ação;
5695	KOF US EQUITY	Coca-Cola Femsa SAB de CV		
5696	GFNORTEO MM EQUITY	Grupo Financeiro Banorte SAB de CV		
5737	OHLMEX: MM Equity	OHL MEXICO SAB DE CV		
5777	UHR VX Equity	SWATCH GROUP AG/THE-BR		
5797	SORIANAB MM EQUITY	ORGANIZACION SORIANA SAB DE CV		
5798	COMERUBC MM EQUITY	CONTROLADORA COMERCIAL MEXICANA SAB DE CV		
5837	GOOG US EQUITY	GOOGLE INC		
5917	UHRN SW EQUITY	SWATCH GROUP AG/THE-REG		
5937	ABE SM EQUITY	ABERTIS INFRAESTRUCTU RAS SA		
5977	CEMEX SAB CPO MEXICO	Cemex SAB de CV MEXICO		
5997	FALAB CI EQUITY	SACI Falabella		
6017	AA US EQUITY	ALCOA INC		
6157	ORA FP EQUITY	ORANGE S/A		
6177	DO US EQUITY	DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC		
6217	GRAM US EQUITY	GRANA Y MONTERO SA		
6218	FSHOP13 MM EQUITY	FIBRA SHOP PORTAFOLIOS INMOBILIARIOS SAPI DE CV		
6257	VALE/P US EQUITY	VALE SA - SP PREF ADR		
6258	FBR US EQUITY	FIBRIA CELULOSE SA - SPON ADR		
6305	FMG AU EQUITY	Fortescue Metals Group Ltd		
6339	GGAL US EQUITY	Grupo Financeiro Galicia SA		
6340	IRS US EQUITY	IRSA Inversiones y Representaciones SA		
6341	MELI US EQUITY	MERCADOLIBRE INC		
6342	LIVEPOLC MM EQUITY	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
6343	BMA:US	Banco Macro SA		i. Informar os casos em que não haja previsão de ajuste em função de subscrição ou qualquer outro direito de preferência no campo “Denominação”; d) Para bonificação ou qualquer evento que altere a quantidade de ações os ajustes serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela correção do preço de referência pelo fator de bonificação no campo “Denominação”. 9-) É permitido utilizar participações de alta e de baixa (em percentual) sobre as curvas. a) Na hipótese de cada curva ter apenas uma participação, esta deve ser informada exclusivamente no campo “Percentual” em “Curvas para Atualização”. b) Caso houver participações de alta e de baixa diferentes sobre as curvas, estas devem ser informadas (em percentual) no campo “Denominação”, e o campo “Percentual” em “Curvas para Atualização” deve ser preenchido como “100”.
6344	TEO:US	Telecom Argentina SA (ADR)		
6345	YPF:US	YPF SA (ADR)		
6359	PHM:US	PulteGroup Inc.		
6439	ENI:US	Enersis SA (ADR)		
6479	ASR:SJ	Assore Ltd		
6480	ARI:SJ	African Rainbow Minerals Ltd		
6499	CCU US EQUITY	Cia Cervecerias Unidas SA		
6500	GGB:US	Gerdau AS (ADR)		
6580	HTZ:US	Hertz Global Holding Inc.		
6600	BRK/B US EQUITY	Berkshire Hathaway Inc.		
6620	PT US	Portugal Telecom SGPS SA		
6623	NKE US EQUITY	NIKE Inc.		
6641	EXX SJ EQUITY	EXXARO RESOURCES LTD		
6645	LALAB MM EQUITY	Grupo Lala S.A		
6660	CEMEX - CX US EQUITY	CEMEX SAB DE CV ADR EUA		
6721	GRUMAB MM EQUITY	Gruma SAB de CV		
6722	CHDRAUIB MM EQUITY	Grupo Comercial Chedraui SA de CV		
6761	CIB US EQUITY	BANCOLOMBIA SA - ADR		
6762	CL US EQUITY	COLGATE-PALMOLIVE CO		
6763	RBGLY US EQUITY	RECKITT BENCKISER GROUP PLC - ADR		
6821	TSLA US EQUITY	TESLA MOTORS INC		
6841	AXP US EQUITY	AMERICAN EXPRESS CO		
6901	CORPBANC CI EQUITY	Corpbanca SA		
6982	FORUS CI EQUITY	Forus SA		
7061	AVH US EQUITY	AVIANCA HOLDINGS SA - SPON ADR		
7141	NE US EQUITY	NOBLE CORP PLC		
7201	DIS US EQUITY	Walt Disney Co/The		
7261	BVC CB EQUITY	Bolsa de Valores de Colômbia		
7281	BAP PE Equity	CREDICORP LTD		
7282	PFDVVND CB Equity	BANCO DAVIVIENDA AS		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
7321	HABITAT CI EQUITY	Administradora de Fondos de Pensiones Habitat SA		
7342	GFI US Equity	GOLD FIELDS LTD ADR		
7361	BAP US Equity	CREDICORP LTD ADR		
7402	IBM US Equity	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP		
7523	KIMBERA MM EQUITY	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A		
7643	PFAVAL CB Equity	Grupo Aval Acciones - PF		
7644	MEGACPO MM Equity	Megacable Holding CPO		
7703	SDRL US EQUITY	SEADRILL LTD		
7783	SAB LN EQUITY	SABMILLER PLC		
7805	CIE SM Equity	CIE AUTOMOTIVE SA		
7823	DVR US EQUITY	CAL DIVE INTERNATIONAL INC		
7923	GOL US Equity	GOL LINHAS AEREAS INTEL-ADR		
7984	OMAB US Equity	GRUPO AEROPORTUARIO CEN-ADR		
8049	PGN US Equity	PARAGON OFFSHORE PLC		
8146	ASURB MM Equity	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B		
8147	EMBONOB CI Equity	COCA-COLA EMBONOR AS-B		
8148	SMSAAM CI Equity	SOCIEDAD MATRIZ SAAM SA		
8167	XLK US Equity	TECHNOLOGY SELECT SECT SPDR		
8266	BCH US Equity	BANCO DE CHILE - ADR		
8307	FIBRAMQ MM Equity	MACQUARIE MEXICO REAL STATE		
8311	LBTYA US Equity	LIBERTY GLOBAL PLC-A		
8367	ADM LN Equity	ADMIRAL GROUP PLC		
8386	RIG US Equity	TRANSOCEAN LTD		
8626	GAPB MM Equity	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B		

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
8627	AMXL MM Equity	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L		
8628	GMEXICOB MM Equity	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B		
8629	PREC CB Equity	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP		
8666	BSBR US Equity	BANCO SANTANDER BRASIL - ADS		
8708	BRK/A US Equity	Berkshire Hathaway Inc – CL A		
8709	ZTS US Equity	ZOETIS INC		
8766	IFS PE Equity	INTERCORP FINANCIAL SER INC		
8787	ESRX US Equity	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO		
8888	KO US Equity	COCA-COLA CO/THE		
8906	VRX US Equity	VALEANT PHARMACEUTICALS INTE		
8967	BSAN CI Equity	BANCO SANTANDER CHILE		
8968	SMCHILEB CI Equity	SM-CHILE SA-B		
8987	COLBUN CI Equity	COLBUN SA		
9007	GPC US Equity	GENUINE PARTS CO		
9027	SID US Equity	CIA SIDERURGICA NAACL-SP - ADR		
8247	AGUAS/A CI Equity	AGUAS ANDINAS SA-A		
9047	PBR/A US Equity	PETROLEO BRASIL-SP PREF ADR		
9067	ECL CI Equity	E.CL SA		
9087	VRSN US Equity	VERISIGN INC		
9127	FRES LN Equity	FRESNILLO PLC		
9168	TPX US Equity	TEMPUR SEALY INTERNATIONAL I		
9187	CME US Equity	CME GROUP INC		
9210	BCA US Equity	CORPBANCA SA-ADR		
9235	STX US Equity	Seagate Technology		
9255	FCFS US Equity	FIRST CASH FINL SVCS INC		

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

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

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

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

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

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

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

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

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

15414	GOLD UN Equity	BARRICK GOLD CORP
15415	AU UN Equity	ANGLOGOLD ASHANTI-SPONT ADR
15416	AEM UN Equity	AGNICO EAGLE MINES LTD
15420	BLMN US Equity	BLOOMIN' BRANDS INC
15422	NGD US Equity	NEW GOLD INC
15424	CCJ US Equity	CAMECO CORP
15468	GME US Equity	GAMESTOP CORP – CLASS A
15488	CLF US Equity	CLEVELAND- CLIFFS INC
15490	VRTX UW Equity	VERTEX PHARMACEUTICA LS INC
15491	DXCM UW Equity	DEXCOM INC
15497	EQX US Equity	EQUINOX GOLD CORP

Ativos

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

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

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

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

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

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

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

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou de Fator	Informações Necessárias
13509	BUENOS 7 78 06/15/27 Corp	PROVINCIA DE BUENOS AIRE (ISIN: XS1433314314)		
13490	BUENOS 4 05/15/35 Corp	PROVINCIA DE BUENOS AIRE (ISIN: XS0234084738)		
13489	ARGENT 2 12 12/31/38 Corp	REPUBLIC OF ARGENTINA (ISIN: US040114GK09)		
13589	PETBRA 7 14 03/17/44 Corp	PETROBRAS GLOBAL FINANCE (ISIN: US71647NAK54)		
13610	ITAU 6 18 PERP CORP	ITAU UNIBANCO HLDG SA/KY (ISIN: USP5R6DPAA84)		
13549	VALEBZ 5 78 06/10/21 Corp	VALE OVERSEAS LIMITED (ISIN: US91911TAN37)		
13530	MENDOZ 8 38 05/19/24 Cor	PROVINCIA DE MENDOZA (ISIN: USP6480JAG24)		
13809	PDCAR 7 1/8 06/10/21 CORP	PROVINCIA DE CORDOBA ISIN USP79171AD96		
13829	KLAB 5 3/4 04/03/29 CORP	KLABIN AUSTRIA GMBH ISIN USA35155AA77		
13930	BUENOS 9 58 04/18/28 CORP	PROVINCIA DE BUENOS AIRE ISIN XS0290125391		
13931	BUENOS 6 12 02/15/23 CORP	PROVINCIA DE BUENOS AIRE ISIN XS1566193295		
13972	UNIGEL 10 ½ 01/22/24 REGS – Corp	UNIGEL LUXEMBOURG AS ISIN USL9467UAA53		
13992	JSLGBZ 7 ¾ 07/26/24 REGS – CORP	JSL EUROP ISIN USL5800PAB87		
14110	USIM 5 7/8 07/18/26 REGS - CORP	USIMINAS INTERNACIONAL (ISI N: USL95806AA06)		
14351	BONSUC 9 ¼ 11/03/20 REGS-CORP	BANCO BONSUCESSO (ISIN: USP07041AA72)		
14444	MVFP SO 6.748 06/01/34 REGS – CORP	MV24 CAPITAL BV (ISIN: USN53766AA41)		

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

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

Estratégia

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

Paridade de Moedas

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

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

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

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

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

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

Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais

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

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

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

Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais

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

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo de PU ou Fator	Informações Necessárias
10380	AAA NA EQUITY	AP ALTERNATIVE ASSETS LP (ISIN GB00B15Y0C52)		
10581	ETW US EQUITY	EATON VANCE TAX MAN GLBL BR (FIGI: BBG000BQJOY1)		
10582	ETB US EQUITY	EATON VANCE T/M BUY – WR IN (ISIN:US27828X1000)		
10697	PCI US Equity	PIMCO DYNAMIC CREDIT AND M.I.FUND ISIN US722202D1063		
10698	DSL US Equity	DOUBLELINE INCOME SOLUTIONS (ISIN:US2586221093)		
10757	CIF US Equity	MFS INTERMEDIATE HIGH INCOME FUND (ISIN:US59318T1097)		
10755	EAD US Equity	WELLS FARGO INCOME OPPORTUNITIES (ISIN:US94987B1052)		
10754	VGI US Equity	VIRTUS GLOBAL MULTI-SECTOR (ISIN:US92829B1017)		
10901	RA US Equity	BROOKFIELD REAL ASSETS INCOME FUNDS INC (ISIN: US1128301041)		
11161	BTGINTB KY Equity	BTG PACTUAL INTERNATIONAL PORT FUND – CL B		
11744	FUNO11 MM Equity	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA ISIN MXCFFU 000001		
11743	PINEEHA ID Equity	PIMCO GIS-INCOME FUND-EEHA ISIN IE00B84J9L26		
11985	FIHO12 MM Equity	CONCENTRADORA FIBRA HOTELERA		
12247	HEJSA2J LX Equity	JAN HND HRZN JAP SM CM-A2JPY		

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

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

Código	Curva VCP	Descrição da Curva VCP	Critério de Cálculo PU ou Fator	Informações Necessárias
15448	MATRDHC ID Equity	MAN AHL TARGETRISK (ISIN:IE00BRJT7720)		
15496	GMATDEA ID Equity	MAN AHL TARGETRISK-DEUR (ISIN:IE00BRTJ7613)		

Commodity

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

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

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

Títulos Públicos Nacionais

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

Observações Gerais:

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

Bloqueio e Desbloqueio VCP

Visão Geral

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

Tela Filtro

Consulta Bloqueio/Desbloqueio VCP

Nome Simplificado

Conta

Código IF

Data do Evento -

Tela Consulta Desbloqueio VCP

Consulta Bloqueio/Desbloqueio VCP

Página 1 de 120 (Linhas 1 a 25 de 2976)

Data e Hora da Consulta: 18/11/2014 - 16:25:41

 **Critério de pesquisa**

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

Informações Adicionais

Código dos contratos

Sobre a codificação do contrato de Swap

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

Formato - 00A11111111

Onde:

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

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

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

11111111 – sequência numérica criada pelo sistema.

Prazos para Alteração

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

Agente Mercado = Participantes detentores de conta própria.

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

Contratos com Funcionalidades

➤ Swap com opção de arrependimento

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

Swaption a Termo

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

➤ Compound Swaption

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

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

➤ Knock In

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

➤ Knock Out

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

➤ Knock In-Out

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

➤ Swap com Knock In e com Opção de Arrependimento

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

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

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

➤ Swap com Knock Out com Opção de Arrependimento

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

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

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

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

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

Regra de Disparo do Trigger:

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

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

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

Regra de Disparo do Trigger:

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

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

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

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

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

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

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

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

Diária - Verifica diariamente se o trigger foi disparado.

Regra de Disparo do Trigger:

Se Valor máximo em (D-1, D-2 ou D-3) $\leq$ Trigger $\leq$ D0 $\rightarrow$ Dispara Trigger na Alta.

Se Valor mínimo em (D-1, D-2 ou D-3) $\geq$ Trigger $\geq$ D0 $\rightarrow$ Dispara Trigger na Baixa.

Final - Verifica apenas na data do vencimento do contrato, se o trigger foi disparado

Regra de Disparo do Trigger:

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

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

➤ **Swap com Limitador de Alta ou de Baixa**

Contrato em que as partes estabelecem patamar máximo e/ou mínimo para uma ou ambas as curvas.

➤ **Swap com Limitador por Terceira Curva**

Contrato em que as partes estabelecem uma terceira curva como patamar máximo ou mínimo para uma das curvas.

➤ **Swap com Prêmio**

Contrato que estabelece que uma das partes efetue o pagamento de prêmio na data de registro.

Observações: EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)

EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)

EURO-WMR = Paridade USD/EUR (WMR) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)

FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]

FRANCO SUÍÇO WMR = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (WMR) / Paridade USD/EUR (WMR)]

Pagamento de Rebate

Pagamento de Rebate			
Knock In	No vencimento do contrato de Swap. Independente da forma de verificação do trigger.		
Knock Out	Três possibilidades: 1 - Na data de disparo do trigger de Knock Out; 2 - No vencimento original do contrato; e 3 - Em n dias úteis após o disparo, limitado à data de vencimento. Independente da forma de verificação do trigger.		
Knock In-Out	Knock In	Knock Out	Data do Rebate
	Verificação dos Triggers	Verificação dos Triggers	Na data do Knock Out; No vencimento;
	Diária	Diária	Em n dias úteis após Knock Out, limitado à data de vencimento.
	Diária	Final	No vencimento.
	Final	Final	No vencimento.

Observação: O Pagamento de Rebate é realizado na modalidade de Liquidação Bilateral.

Registro de Funcionalidades Documentacional

As funcionalidades **Knock In**, **Knock Out**, **Knock In com Opção**, **Knock Out com Opção**, **Limitador por fator arbitrado (inferior ou superior)**, quando utilizadas com **indexador VCP** é de **registro documentacional**, ou seja, não há verificação de disparo do trigger ou de utilização dos limitadores, exceto para a funcionalidade **Knock Out com Arrependimento**, onde o Participante pode exercer a opção de arrependimento de acordo com a regra já estabelecida no Módulo de Swap.

O Registro Documentacional das funcionalidades **Knock In, Knock Out, Knock In com Opção, Knock Out com Opção, Limitador por Fator Arbitrado (inferior ou superior)**, esta disponível para uso em todos os VCPs.

Cruzamento de Funcionalidades x Operações

Operações e Funcionalidades	Knock In com/ sem opção	Knock Out com/sem opção	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio	Opção de Arrependimento
Registro em D com início em D-1 ou D-2	P	P	P	I	P	P	P
Antecipação	P	P	P	P	P	P	P
Antecipação entre clientes (em D-1).	P	P	P	P	P	P	P
Intermediação de Contrato	P	P	P	P	P	P	P
Opção de Arrependimento	I	I	I	I	I	I	N.A
Limite Fator Arbitrado	P	P	P	P	P	P	P
Limite 3ª Curva	P	P	P	P	P	P	P
Cessão de Contratos	P	P	P	P	P	P	P
Operação a Termo	I	I	I	P	I	P	P
Operação a Termo com Valor Base Corrigido	I	I	I	P	I	P	P
Início em dia não útil	I	I	I	I	I	I	I
Término em dia não útil	P	P	P	P	P	P	P
TR escolhida	P	P	P	P	P	P	P
Rebate de Prêmio	I	P	P	I	I	I	I
Knock In	N.A	I	I	I	I	I	P
Knock Out	P	N.A	I	I	I	I	P
Swaption a Termo	I	I	I	N.A	I	I	I
Compound Swaption	I	I	I	I	N.A	I	I
Swap com prêmio	I	I	I	I	I	N.A	I
Cupom Limpo	P	P	P	P	P	P	P

Legenda: P = Possível; I = Impossível e N.A. = Não se aplica.

Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 1

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Agenda de Prêmios	Reset	Limitador Fator	Limitador Terceira Curva	Termo
Agenda de Prêmios	N.A	S	S	S	S
Reset	S	N.A	N	N	S
Limitador Fator	S	N	N.A	N	S
Limitador Terceira Curva	S	N	N	N.A	S
Termo	S	S	S	S	N.A
DI	S	S	S	S	S
DI 360d	S	N	S	S*****	S
SELIC	S	N	S	S	S
PREFIXADO 252	S	S	N	S*****	S
PREFIXADO 360	S	S	N	N*****	S
DOLAR	S	S	S	S	S
DOLAR COMERCIAL EXPONENCIAL	S	N	S	S	S
EURO/COM.EUROPEIA	S	N	S	S	S
EURO-BCE	S	N	S	S*****	S
IENE	S	N	S	S	S
FRANCO SUIÇO	S	S	S	S	S
PESO MEXICANO	S	S	S	S	S
TR	S	N	S	S	S
TJLP	S	N	S	S	S
LIBOR	S	S	S**	S*****	S
TJMI	S	S	S**	S*****	S
IGPM	S	N	S	S	S
IGPDI	S	N	S	S	S
INPC	S	N	S	S	S
OURO	S	S	S	S	S
IBOVESPA Liquidação	S	N	S	S*****	S
IBOVESPA Liquidação Contínuo	S	N	N	N	N
VCP	S	S	S***	S*****	S

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Agenda de Prêmios	Reset	Limitador Fator	Limitador Terceira Curva	Termo
COMMODITY	S	N	S	S	S

Legenda: S = Sim; N = Não e N.A = Não se aplica.

* exceto no caso de variação cambial Outros

** somente o específico da curva

*** funcionamento do limitador fator documental

**** exceto nos contratos que envolvam contas de cliente 1

***** Nos casos de contratos com funcionalidade Terceira Curva há possibilidade de utilização desta curva somente como indexador do contrato.

Observações:

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

Contratos com limitador

Os contratos de swap permitem utilização de limitador superior e/ou inferior, dependendo do tipo de swap (pagamento final, fluxo constante ou não constante) e do indexador, conforme detalhado na tabela abaixo:

Categoria do indexador	Pagamento final	Fluxo Constante	Fluxo não Constante
Commodities	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior
Índices	Inferior ou Superior	N/A	N/A
Índices de Preços	Inferior ou Superior	N/A	N/A
Juros			
<i>DI</i>	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior e/ou Superior ¹
<i>DI 360D</i>	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior e/ou Superior ¹
<i>Prefixado 252D</i>	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior e/ou Superior ¹
<i>Prefixado 360D</i>	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior e/ou Superior ¹
<i>SELIC</i>	Inferior ou Superior	N/A	N/A
<i>TJLP</i>	Inferior ou Superior	N/A	N/A
<i>TR</i>	Inferior ou Superior	N/A	N/A
Juros Internacionais	Inferior e/ou Superior	Inferior e/ou Superior ²	Inferior e/ou Superior ¹
Taxas de Câmbio	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior
VCP	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior

¹ Permitido informar limitadores diferentes por fluxo.

² Os limitadores devem ser iguais para todos os fluxos.

Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Opção de Arrependimento	Knock In e/ou Knock Out	Knock In com Opção ou Knock Out com Opção	Swap com Prêmio	Swaption a Termo	Compound Swaption
Agenda de Prêmios	S	S	S	S	S	S
Reset	N	N	N	N	N	N
Limitador Fator	S	S	S	S	S	S
Limitador Terceira Curva	S	S	S	S	S	S
Termo	S	N	N	S	S	N
DI	S	S	S	S	S	S
DI 360d	S	N	N	S	S	S
SELIC	S	S	S	S	S	S
PREFIXADO 252	S	N	N	S	S	S
PREFIXADO 360	S	N	N	S	S	S
DOLAR	S	S	S	S	S	S
DOLAR COMERCIAL EXPONENCIAL	S	S	S	S	S	S
EURO/COM.EUROPEIA	S	S	S	S	S	S
EURO-BCE	S	S	S	S	S	S
IENE	S	S	S	S	S	S
FRANCO SUIÇO	S	S	S	S	S	S
PESO MEXICANO	S	S	S	S	S	S
TR	S	S	S	S	S	S
TJLP	S	S	S	S	S	S
LIBOR	N	N	N	S	N	N
TJMI	N	N	N	S	N	N
IGPM	S	S	S	S	S	S
IGPDI	S	S	S	S	S	S
INPC	S	S	S	S	S	S
OURO	S	S	S	S	S	S
IBOVESPA	S	S	S	S	S	S
Liquidação	S	S	S	S	S	S

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Opção de Arrependimento	Knock In e/ou Knock Out	Knock In com Opção ou Knock Out com Opção	Swap com Prêmio	Swaption a Termo	Compound Swaption
IBOVESPA						
Liquidação Contínuo	N	S	S	N	N	N
VCP	S	N*	N*	S	S	S
COMMODITY	S	S	S	S	S	S

Legenda: S = Sim e N = Não

* exceto no caso de Registro de Funcionalidades Documentacional

Observações:

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

Cancelamento referente aos prêmios e comissões

Cancelamento de contrato e a situação dos prêmios e comissões

Pagamento da COMISSÃO de intermediação de contrato na **DATA DE REGISTRO**.

Quando o cancelamento do contrato coincidir com a data de registro, seja à vista ou a termo:

- **Se o registro de contrato é entre clientes ou entre Participante e cliente próprio:** O sistema cancela automaticamente a comissão de intermediação.
- **Se o registro de contrato é do Participante:** O estorno da comissão de intermediação é obrigatório, se ainda não liquidada financeiramente.

Quando o cancelamento do contrato é posterior a data de registro, seja à vista ou a termo, e registro de contrato que envolva clientes, não há cancelamento da comissão de intermediação.

Pagamento do PRÊMIO da **OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO**.

Quando o cancelamento ocorrer:

- Na data de registro, o sistema estorna automaticamente o prêmio da opção de arrependimento, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.
 - Em data posterior à data de registro, o prêmio da opção de arrependimento gerado não será estornado.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN**.
(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK OUT**.
(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN-OUT**.
(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Cancelamento de contrato e a situação dos prêmios e comissões

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

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

Quando o cancelamento ocorrer:

- Em data posterior à data de registro, pagamento de Prêmio 1 tem curso normal e do Prêmio 2 é cancelado automaticamente.
 - Na data de registro, o sistema cancela automaticamente o pagamento do Prêmio 2 e do Prêmio 1, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.
-

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

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

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro, o sistema cancela automaticamente o pagamento do Prêmio 2 e do Prêmio 1, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **SWAP C/ PRÊMIO**.

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro e se o prêmio ainda não foi liquidado financeiramente o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio.

Registro Contrato com curva VCP

Nos registros de contratos com curva VCP os campos **Denominação**, do grupo de informações **Se Curva = VCP**, obedece ao seguinte critério de preenchimento:

Parte	Contraparte	Curva da Parte VCP	Curva da Contraparte VCP	Preenchimento Denominação Parte	Preenchimento Denominação Contraparte
Mercado	Mercado	X	X	X	X
Mercado	Mercado	X		X	
Mercado	Mercado		X		X
Mercado	Cliente 1	X	X	X ¹	
Mercado	Cliente 1	X		X	
Mercado	Cliente 1		X		X
Mercado	Cliente 2	X	X	X	X
Mercado	Cliente 2	X		X	
Mercado	Cliente 2		X		X
Cliente 1	Cliente 1	X	X	X ¹	
Cliente 1	Cliente 1	X		X	
Cliente 1	Cliente 1		X		X
Cliente 2	Cliente 2	X	X	X	X
Cliente 2	Cliente 2	X		X	
Cliente 2	Cliente 2		X		X

Observações:

- 1) O campo denominação da Parte deve ser preenchido com a descrição da curva VCP de ambas as Partes.
- 2) Agente Mercado = Participantes detentores de conta própria.

Regras de Negócios

Estão disponibilizados para download no site da Cetip (www.cetip.com.br), na seção Informação Técnica/Manuais de Normas.

Identificação dos membros envolvidos nas operações

Participante - Pessoa física, jurídica ou qualquer participante detentor de conta própria Cetip que deseja encontrar uma contraparte, que tenha uma expectativa contrária à sua, em relação à futura variação dos parâmetros para realizar o registro de um contrato de Swap.

Contraparte - Pessoa física, jurídica ou qualquer participante detentor de conta própria Cetip que tem expectativa contrária à do Participante, em relação à futura variação dos parâmetros, que deseja realizar o contrato de Swap.

Banco Liquidante - Instituições financeiras com conta reserva bancária compulsória, em espécie, no Banco Central do Brasil, detentoras de conta individualizadas junto à Cetip, habilitadas no sistema, indicadas pelas Partes para prestar serviços de liquidação financeira das operações registradas.

Identificação de entidades

Clientes 1 - São clientes próprios dos Participantes Titulares. Considerando-se como tal as pessoas físicas ou jurídicas, que operam somente através do próprio Membro de Mercado.

Clientes 2 - São clientes de terceiros. Considerando-se como tal as pessoas físicas ou jurídicas, que operam através de Titular da conta de cliente, porém com a interveniência de um Banco Liquidante.

O Participante pode registrar um contrato de Swap entre Contas Próprias, entre um Participante Titular e seu Cliente 1 ou 2, entre um Participante detentor de conta própria e o Cliente 2 de outros, entre Clientes 2 de distintos Participantes Titulares ou entre dois Clientes 1 de um mesmo Participante Titular, à vista ou a termo.

Somente os contratos entre um Participante Titular e seu Cliente 1 e entre dois Clientes 1 de um mesmo Participante Titular podem ser registrados com prazo decorrido.

Observação: O módulo não faz crítica quanto à natureza econômica da Contraparte das operações entre Contas Próprias e Contas de Clientes 2, cabendo ao Participante observar as restrições legais existentes.

Metodologia de Cálculo

Os cálculos aplicáveis aos Swaps estão disponibilizados para download no site da Cetip (www.cetip.com.br), na seção Informação Técnica/Caderno de Fórmulas.

Formação dos Códigos do Instrumento Financeiro Swap

Para Contratos de Swap - Swap

Exemplo: AAMXXXXXXXX

Onde:

AA = Ano de Emissão.

M = Sequência representativa do mês da emissão, onde A corresponde à Janeiro , B Fevereiro e assim por diante, até L que corresponde à Dezembro.

XXXXXXXX = Sequência alfanumérica.

Glossário

A

Antecipação: Operação através da qual parte ou a totalidade do Swap é encerrada pelos Participantes envolvidos, antes da Data de Vencimento.

C

CGD: Contrato Global de Derivativos. Elaborado a partir de um grupo de trabalho coordenado pela CAAR – Câmara para Administração de Assuntos de Risco com representantes da Cetip e de diversas associações do mercado financeiro, em conjunto com o Escritório Pinheiro Neto Advogados, tendo por objetivo o desenvolvimento de um modelo de contrato para operações de derivativos de balcão reconhecido pelo ISDA – International Swaps and Derivatives Association.

Compound Swaption: Operação através da qual uma das partes, mediante o pagamento de um prêmio à outra parte, adquire o direito de, em uma determinada data futura, rescindir um Swap.

CSA: Instrumento de Prestação de Garantias Elaborado a partir de um grupo de trabalho coordenado pela ANBIMA – Associação Brasileira das Entidades do Mercado Financeiro e de Capitais, composto por participantes do mercado financeiro, em conjunto com o Escritório Pinheiro Neto Advogados, tendo por objetivo o desenvolvimento de um modelo de contrato para operações de derivativos de balcão que tenham alocação de garantias. O modelo do contrato pode ser obtido no site da ANBIMA (www.anbima.com.br) ou no site da Anbid (www.anbid.com.br).

Custódia Eletrônica: Registro eletrônico de Swap no Sistema de Custódia Eletrônica.

D

Data de Pagamento: Data previamente estabelecida no Swap para liquidação financeira de Diferencial.

Data de Vencimento: Data estabelecida para vencimento do Swap.

Diferencial: Diferença apurada em Data de Pagamento ou, quando for o caso, na data de Antecipação, calculada com base nos dois Indicadores Econômicos e nas demais condições pactuadas no Swap.

Duplo Comando: Lançamentos efetuados no Sistema de Registro pelos dois Participantes envolvidos na operação, representando a inequívoca aceitação das condições nela constante.

I

Indicador Econômico: Taxa de juros, o índice de preços, a variação cambial ou outro parâmetro de remuneração ou atualização contratado em Swap.

K

Knock In: Operação através do qual uma das partes, mediante o pagamento de prêmio à outra parte, estabelece a(s) condição (ões) requerida(s) para que um Swap tenha validade.

Knock In–Out: Operação que contém as características das operações de Knock In e Knock Out.

Knock Out: Operação através do qual uma das partes, mediante o pagamento de prêmio à outra parte, estabelece em que condição (ões) um Swap será rescindido.

L

Lançamento: Registro efetuado por Participante em um Sistema, para efeito de inclusão de dados, ou manifestação sobre confirmação ou rejeição de liquidação financeira, entre outros.

LBTR: Liquidação Bruta em Tempo Real.

Limitador de Alta: Patamar máximo da curva do Swap, previamente estabelecido pelas partes, a ser utilizado no cálculo de Diferencial.

Limitador de Baixa: Patamar mínimo da curva do Swap, previamente estabelecido pelas partes, a ser utilizado no cálculo de Diferencial.

Liquidação Bilateral: Compensação bilateral entre Participantes.

R

Redutor de Risco de Crédito: O momento em que determinado contrato será avaliado e para qual deverá ser informado seu preço de mercado (MtM).

S

Swaption a Termo: Operação através da qual uma das partes, mediante o pagamento de um prêmio à outra parte, adquire o direito de, em uma determinada data futura, decidir se irá realizar um Swap.