

FUTURO DE FRANCO SUÍÇO POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA

1. Informações do Produto

Objeto	Futuro padronizado de taxa de câmbio de franco suíço (CHF) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (“B3”).
Código de Negociação	O código da mercadoria será SWI.
Tamanho do Contrato	USD 10.000,00.
Cotação	Valor expresso em franco suíço (CHF) por USD 1.000,00, com uma casa decimal.
Varição Mínima de Apregoação (Tick Size)	CHF 0,10 por USD 1.000,00.
Vencimento	Primeira sessão de negociação do mês de vencimento do contrato.
Data de Fixing	Sessão de negociação imediatamente anterior à data de Vencimento.
Último dia de Negociação	Sessão de negociação imediatamente anterior à data de Vencimento.
Meses de Vencimento	Todos os Meses.
Preço de Ajuste	Valor expresso em franco suíço (CHF) por USD 1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários.

IMPORTANTE: O lançamento deste produto está condicionado às respectivas aprovações dos órgãos reguladores.

Preço de Ajuste na Data de Fixing	Taxa de câmbio de franco suíço (CHF) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate.
--	---

2. Ajuste Diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no Preço de Ajuste (PA) do dia, com movimentação financeira no dia útil subsequente. O ajuste diário será calculado até a sessão de negociação imediatamente anterior ao Vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

a) Ajuste Diário realizado no dia da contratação da operação

$$AD_t = (PA_t - PO) \times \frac{TxC}{PC_t} \times \frac{TM}{1.000} \times n$$

b) Ajuste Diário das posições em aberto no dia anterior

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times \frac{TxC}{PC_t} \times \frac{TM}{1.000} \times n$$

Onde:

AD_t = valor do ajuste diário, em reais, referente à data “t”;

PA_t = conforme o caso, Preço de Ajuste ou Preço de Ajuste na Data de Fixing do contrato na data “t”, para o respectivo vencimento;

PO = preço da operação;

TxC = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 nos termos do Anexo III do Ofício Circular 058/2002-DG, de 19 de abril de 2002, conforme alterado;

PC_t = taxa de câmbio Spot das 16h00, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de franco suíço por dólar dos Estados Unidos da América na data “t”;

TM = tamanho do contrato;

n = número de contratos; e

IMPORTANTE: O lançamento deste produto está condicionado às respectivas aprovações dos órgãos reguladores.

PA_{t-1} = Preço de Ajuste do contrato na data “t-1” para o respectivo vencimento

O valor do ajuste diário (AD_t), calculado conforme demonstrado acima, se positivo, será creditado ao comprador e debitado ao vendedor. Caso o cálculo acima apresente valor negativo, será debitado ao comprador e creditado ao vendedor.

3. Condições de Liquidação no Vencimento

No Vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no Preço de Ajuste da Data de Fixing, seguindo as fórmulas apresentadas na cláusula 2 acima.

Os resultados financeiros da liquidação serão movimentados na própria data de Vencimento, creditado ao comprador e debitado ao vendedor ou debitado ao comprador e creditado ao vendedor, conforme o caso.