

MANUAL DE OPERAÇÕES

TERMO SEM CCP

Selecione o módulo desejado

**TERMO
MULTICLASSES**

**TERMO COM
FLUXO**

**TERMO DE
COMMODITIES**

Sumário

TERMO MULTICLASSES

Jornada Do Produto.....	3
1 Registro	4
1.1 Taxa De Câmbio.....	4
1.2 Commodities	17
2. Antecipação	25
3. Cessão.....	28
4. Alteração E Exclusão	31
5. Taxa De Avaliação.....	43
6. Ajuste De Taxa.....	47
7. Estorno	49
8. Intermediação	52
9.Consultas	54
9.1 Características Dos Contratos	55
9.2. Consulta De Operações	56
9.2 Consulta De Operações	57
10. Informações Adicionais	60
10.1 Ativos Disponíveis E Cadastro De Novos Ativos	60
10.2 Arquivos	60
10.3 Consulta De Arquivos E Relatórios	60
10.4 Prazos:	61
10.5 Serviços Complementares	63

TERMO COM FLUXO

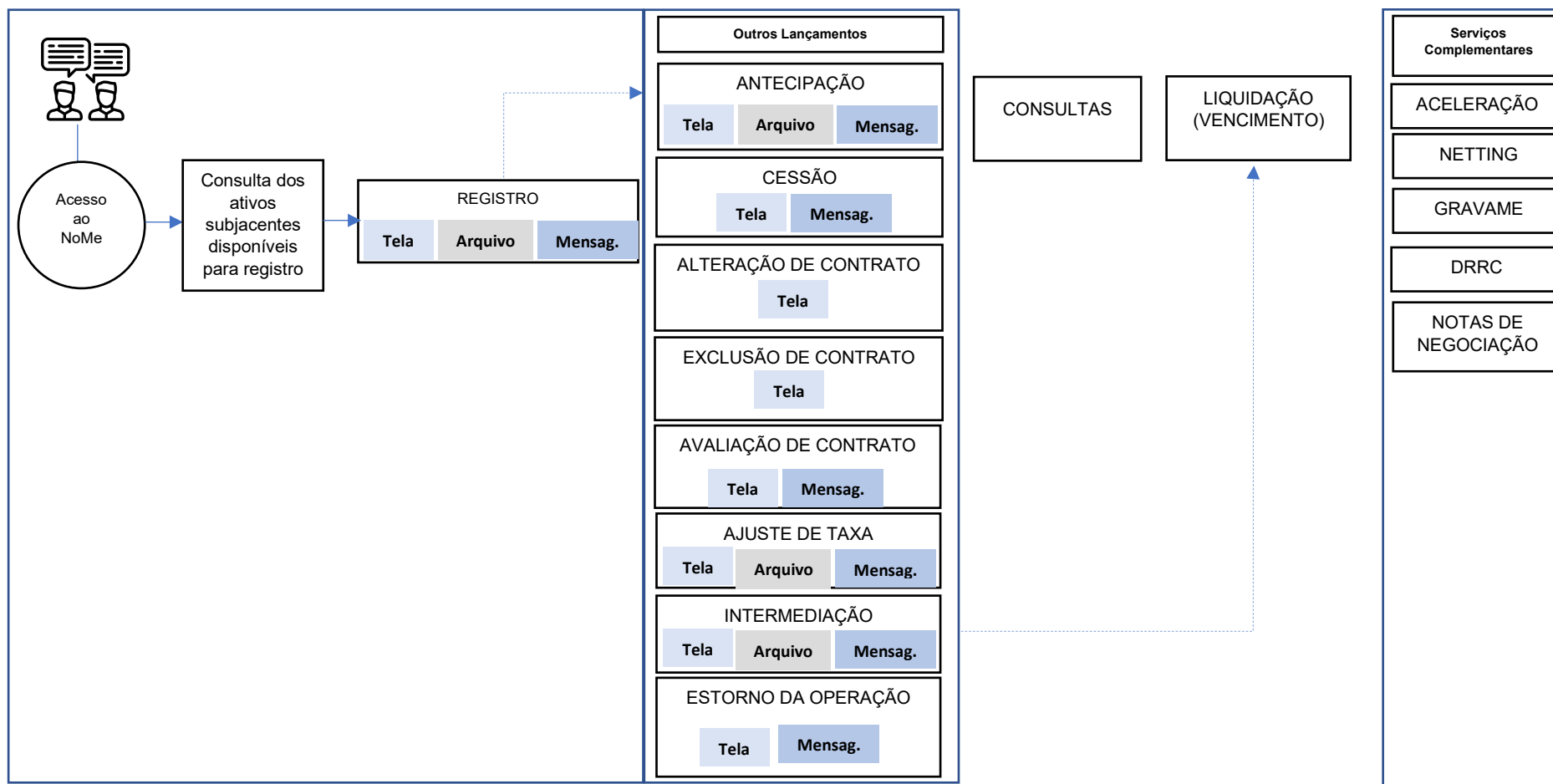
Jornada Do Produto.....	64
1. Registro	65
2. Intermediação	72
3. Cessão	74
4. Antecipação	76
5. Registro De Parâmetros	80
7. Lançamento De Taxa De Câmbio.....	86
8.Cancelamento	88

TERMO DE MERCADORIAS (COMMODITIES)

Jornada Do Produto.....	90
1. Antecipação	92
Atualização Da Versão	95

JORNADA DO PRODUTO

TERMO MULTICLASSES



1 REGISTRO

1.1 Taxa de Câmbio

Esta função permite efetuar o registro dos contratos de Termo

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo MultiClasses > Lançamentos > Contrato a Termo

Arquivo:

[Manual de Operações](#) > Enviar Arquivos

- 4.11.1 – Registro de Contrato do Participante

Mensageria:

- CTP9003 – TERMO – Registro de Contrato de Termo

FUNCIONALIDADES

- Média Asiática**
 - Simples; e
 - Ponderada
- Limitador**
 - Inferior;
 - Superior e/ou; e
 - Inferior e Superior
- Cross Rate;**
- Ajuste de Taxa:** Informar no momento do registro que o contrato prevê uma nova taxa

PRAZOS: Conta 00 x Conta 00 – O registro deve ser realizado em D0 da contratação
Conta 00 x Conta 10 ou 20 – É permitido o registro somente em D0 da contratação do derivativo

Tela de Filtro Pré Registro

> Termo > Termo Multiclasses > Lançamentos > Contrato a Termo

Registro de Contrato de Termo

Ação

Código IF

Classe do Ativo Subjacente

Tela de Registro

Contrato a Termo de Moedas				
Lançamento do Participante (Conta)		Posição do Participante	CPF/CNPJ Cliente Participante	
Contraparte(Conta)		Contrato Global	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	
Características				
Nº Controle Interno	Valor Base(Referência)	Data de Operação	Data de Vencimento	
Fonte de Informação	Moeda Base(Referência)	Moeda Cotada	Código da Paridade	
Cotação para o Vencimento	Data de Fixing da Paridade	Taxa a Termo		
Ajuste de Taxa				
Ajustar Taxa	Responsável pelo Ajuste de Taxa	Data Inicial para Ajuste de Taxa	Data Final para Ajuste de Taxa	
Média Asiática				
Taxa média para Termo Asiático	Quantidade de Datas de Verificação			
Fonte de Informação				
Cross Rate na Avaliação?	Código da Paridade Cross	Data de Fixing da Paridade Cross	Boletim	Fonte de Consulta
Tela ou Função de Consulta	Praça de Negociação	Horário de Consulta	Cotação - Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)	Cotação - Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)
Data de Avaliação				
Termo a termo				
Termo de Termo	Data de Fixação	Cotação para Fixing	Forma de Atualização	Valor/Percentual Negociado
Atualizar Valor Base?	Cotação Inicial			
Limite				
Limites	Superior (Paridade)	Inferior (Paridade)		
Prêmio				
Prêmio a ser pago pelo	Valor do Prêmio (R\$)	Data de Liquidação		
Modalidade de Liquidação				
Observação				
Observação				
Código Identificador				
Enviar Limpar Campos Desistir				

Descrição dos Campos da Tela de Registro Termo de Moedas Asiático

Contrato a Termo de Moedas		
Lançamento do Participante (Conta)	Posição do Participante	CPF/CNPJ Cliente Participante
Contraparte(Conta)	Contrato Global	CPF/CNPJ Cliente Contraparte

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Lançamento do Participante (Conta)	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Posição do participante	Indica a posição assumida pelo participante.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou comprador
CPF/CNPJ Cliente Participante		Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
Contraparte (Conta)	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Contrato Global	Indica se o contrato registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos ("CGD"), com as opções "Sim" e "Não"	Condicional	Obrigatório, quando disponível essa opção
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	-	Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)

Características			
Nº Controle Interno	Valor Base(Referência)	Data de Operação	Data de Vencimento
Fonte de Informação	Moeda Base(Referência)	Moeda Cotada	Código da Paridade
Cotação para o Vencimento	Data de Fixing da Paridade	Taxa a Termo	

Características			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento indicado pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.	Obrigatório	Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
Valor Base (Referência)/ Quantidade	Valor base ou quantidade do contrato expresso na moeda de referência.	Obrigatório	Tipo: Numérico (limite de 14 inteiros e 2 decimais). Quando casas decimais não preenchidas, o sistema preenche com zeros
Data de Operação	Data em que o participante contratou a operação. Data de início do contrato, se contrato registrado à vista.	Obrigatório	Pode ser informada em até D-2 útil anterior à data do sistema, quando a contraparte na operação é de um conta de seus clientes (tipo de conta 1). Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato.	Obrigatório	A data de vencimento do contrato pode ser indicada em feriados, porém não pode ser indicado um final de semana. Caso o ajuste caia em dia não útil, o sistema irá gerar o ajuste para o próximo dia útil conhecido. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Fonte de Informação	Indica a fonte a ser utilizada para a cotação de fixing para vencimento. Caixa de seleção com as opções: Sisbacen, Feeder, Spot, Sisbacen/Feeder, Bloomberg e Bloomberg/Sisbacen. A fonte de informação é utilizada nos eventos de Resgate (vencimento) do contrato, fixing dos contratos asiático e também quando indicado Termo a Termo. De acordo com a Modalidade do Contrato ou a Fonte de Informação a ser utilizado para a consulta de cotação, o módulo apresenta campos diferentes a ser preenchidos. A descrição dessas diferenças encontra-se no capítulo Introdução ao Termo de Moedas/Conhecendo o Produto ou no capítulo Informações Adicionais/Regras de Registro Conforme Fonte de Informação	Obrigatório	Regras específicas de acordo com a fonte de informação • Spot o A moeda de referência deve ser Moeda Base =USD (Dólar Americano) e Moeda Cotada = BRL (Real). o É permitida a indicação do Fixing em D0, informando Spot D0 no campo “Tela ou Função de Consulta Função de Consulta”. • Feeder o Caso a fonte de informação para formação da Taxa a Termo (Forward) seja o ECB/BCE (Banco Central Europeu), mas esta fonte seja diferente da que será utilizada para a formação do fixing para vencimento, a fonte BCE/ECB deve ser informada exclusivamente no campo “Observação”. o É permitida a indicação do Fixing em D0, informando Spot D0

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Características			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			no campo "Tela ou Função de Consulta Função de Consulta".
Moeda Base (Referência)	Indica a moeda objeto do contrato a termo.	Condicional	Obrigatório para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot. Quando utilizada as fontes Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central, o campo não deve ser preenchido e a moeda base e a moeda cotada serão definidas com base na paridade indicada no campo "Código da Paridade".
Moeda Cotada	Indica a moeda de referência em que a Moeda Base é cotada, para apuração da atualização do contrato	Condicional	Obrigatório para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot. Quando utilizada as fontes Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central, o campo não deve ser preenchido e a moeda base e a moeda cotada serão definidas com base na paridade indicada no campo "Código da Paridade".
Código da Paridade	Paridade que será utilizada no contrato, com o nome da moeda base da paridade utilizada. Para verificar a lista de paridades disponíveis e qual sua moeda cotada, verificar o arquivo público AAAAMMDD_Ativos_Subjacentes.txt que se encontra no módulo de Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.	Condicional	Obrigatório para as fontes Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central, e não pode ser informado para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot.
Cotação para o vencimento	Indica a data de cotação para o vencimento com as opções: D-0, D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.	Condicional	Obrigatório para as fontes Sisbacen e Sisbacen/Feeder. Campo não pode ser informado para as fontes Feeder, Spot, Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data de fixing da Paridade	Data para captura da cotação da paridade indicada no campo "Código da Paridade". Não será aplicado nenhum deslocamento nessa data para captura da cotação. Caso não haja cotação disponível nessa data, será utilizada a última cotação disponível.	Condicional	Obrigatório para as fontes Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central. Campo não pode ser informado para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot. A data deve ser maior ou igual a data de início e menor ou igual que a data de vencimento do contrato. Podem ser indicadas datas de feriados e não aceita finais de semana.

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Características			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Taxa a Termo	Valor da taxa contratada. Esta taxa é utilizada na apuração do resultado do contrato	Condicional	Tipo: Numérico (Informado com até 4 (quatro) inteiros e 6 (seis) decimais Obs.: No cálculo de média asiática de USD será utilizada 6 (seis) decimais.

Ajuste de Taxa

Ajustar Taxa

Responsável pelo Ajuste de Taxa

Data Inicial para Ajuste de Taxa

Data Final para Ajuste de Taxa

NAO

Ajuste de Taxa			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Ajustar Taxa	Indica se o contrato conta com Shift, ou seja, modificação da taxa forward. Em caso da opção ser SIM a função retornará os seguintes campos: Responsável pelo Ajuste de Taxa, Data Inicial para ajuste de taxa, Data Final para ajuste de taxa.	Obrigatório	Campo com as opções de seleção com “Sim” e “Não”
Responsável pelo Ajuste de Taxa	Indicar o responsável pelo ajuste de taxa, com as opções: Comprador, Vendedor ou Comprador e Vendedor. O Participante pode ou não ajustar a taxa no período contratado	Condicional	Obrigatório, quando houver.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data Inicial para Ajuste de Taxa	Indica o início do período estipulado para o ajuste de taxa pelo Participante responsável.	Condicional	Obrigatório, quando houver. Para lançamento do contrato com os campos “Ajustar Taxa” e “Termo de Termo” preenchidos com as Opções: SIM e SIM: A data inicial para ajuste de taxa deve ser igual ou superior a D+1 útil da data de fixação. SIM e NÃO: A data inicial para ajuste da taxa deve ser igual ou superior a D+1 útil do lançamento do contrato. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data Final para Ajuste de Taxa	Indica o final do período estipulado para o ajuste de taxa pelo Participante responsável.	Condicional	Obrigatório, quando houver. Deve estar entre D+1 da Data Inicial para ajuste de taxa e menor ou igual a D-1 da data de vencimento do contrato. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)

Média Asiática

Taxa média para Termo Asiático

Quantidade de Datas de Verificação

Média Asiática			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Taxa média para Termo Asiático	Indica o tipo de média para a taxa de câmbio para liquidação do contrato, com as opções: Aritmética simples, Aritmética ponderada e Aritmética Média x Média. Após a escolha da opção é apresentado o item Datas de Verificação para a inclusão dos dados complementares.	Obrigatório	Só preencher quando opção de contrato for à modalidade Termo Asiático. O sistema não trata Termo asiático com Cross Rate na Avaliação
Quantidade de Datas de Verificação	Quantidade de Datas de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada ou simples.	Condicional	Obrigatório, quando houver. Tipo: Numérico (limite de 3 (três) inteiros).

Fonte de Informação

Cross Rate na Avaliação?
[NÃO]

Tela ou Função de Consulta

Data de Avaliação

Código da Paridade Cross

Praça de Negociação

Data de Fixing da Paridade Cross

Horário de Consulta

Boletim

Cotação - Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)

Fonte de Consulta

Cotação - Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)

Fonte de Informação

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cross Rate na Avaliação?	-	Condicional	Obrigatório, quando o participante optar pela utilização desta opção. O uso desta opção não é permitido, quando moeda de referência ou cotada for Dólar dos EUA e quando a fonte de informação for Sisbacen e Sisbacen/Feeder. A utilização desse campo não é permitida quando o contrato for de média aritmética simples, ponderada ou média x média.
Boletim	Deverá ser informado qual o Boletim de fechamento de cotação da moeda.	Condicional	Obrigatório para as fontes Sisbacen ou Sisbacen/Feeder. Campo não pode ser informado para a fonte Feeder, Spot, Bloomberg ou Bloomberg/Sisbacen. Campo as opções: 18h00 - Fechamento.
Fonte de Consulta	Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda.	Condicional	Obrigatório para as fontes Sisbacen/Feeder, Feeder ou Spot. Não pode ser informado para a fonte Sisbacen, Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen ou Banco Central. Possui as opções: Spot, Reuters, Broadcast, Bloomberg, BCE e outros.
Tela ou Função de Consulta	Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que deve ser utilizada pelos Participantes para cotação. Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.	Opcional	Não pode ser preenchido para as fontes Sisbacen, Bloomberg e Bloomberg/Sisbacen. É possível informar Spot D0 quando a fonte de informação for Feeder ou Spot.
Praça de Negociação	Local de negociação da moeda de referência. Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo de Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.	Opcional	Não pode ser preenchido para as fontes Sisbacen, Bloomberg e Bloomberg/Sisbacen. É possível informar Spot D0 quando a fonte de informação for Feeder ou Spot.
Horário de Consulta	Horário de verificação da taxa de câmbio. Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo de Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.	Opcional	Não pode ser preenchido para as fontes Sisbacen, Bloomberg e Bloomberg/Sisbacen.
Cotação – Taxa de	A taxa de câmbio utilizada para avaliação do contrato.	Condicional	Obrigatório quando a fonte de informação para taxa de câmbio

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)			no contrato for “Feeder”, “Spot” ou “Sisbacen/Feeder”. Não pode ser preenchido para as fontes Sisbacen, Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen e Banco Central. Caixa de seleção com as opções: “VENDA”, “COMPRA” e “MÉDIA”.
Cotação – Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	A taxa de câmbio utilizada para avaliação do cross-rate.	Condicional	Obrigatória quando a fonte de informação para taxa de câmbio no contrato for “Feeder”, “Spot” ou “Sisbacen/Feeder”. Caso o contrato não possua Cross Rate na avaliação, o campo deve ser preenchido com a opção “NENHUM”. Caso o contrato possua Cross Rate na avaliação, o campo pode ser preenchido com uma das seguintes opções, de acordo com a “Fonte de Informação” indicada: • Para as fontes “Feeder” e “Spot”, podem ser indicadas as opções: “VENDA”, “COMPRA” ou “MÉDIA”. • Para a fonte “Sisbacen/Feeder”, podem ser indicadas as opções: “VENDA” ou “COMPRA”. Caixa de seleção com as opções: “NENHUM”, “VENDA”, “COMPRA” e “MÉDIA”.
Data de Avaliação	Data pactuada entre as partes para indicar a partir de quando será possível avaliar o contrato. A última data em que o contrato for avaliado apresentará a cotação utilizada para a liquidação financeira.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório para as fontes Spot, Sisbacen/Feeder e Feeder. Campo não pode ser informado para as fontes Sisbacen, Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen ou Banco Central. A data de avaliação deve ser maior que a data de início do contrato e até D-1 da data de vencimento do contrato. Quando for opção asiática deve coincidir com a primeira data de verificação. Quando for Spot D0 a data é a do vencimento do contrato.
Código da Paridade Cross	Paridade do Cross-rate que será utilizada no contrato. Para verificar a lista de paridades disponíveis e qual sua moeda cotada, verificar o arquivo público AAAAMMDD_Ativos_Subjacentes.txt que se encontra no módulo de	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório para a fonte Bloomberg/Sisbacen. Campo não pode ser informado para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder ou Spot. Não pode ser a mesma paridade

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.		informada no campo “Código da Paridade”
Data de fixing da Paridade Cross	Data para captura da cotação da paridade indicada no campo “Código da Paridade Cross”.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório para a fonte Bloomberg/Sisbacen. Campo não pode ser informado para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder ou Spot. A data deve ser maior ou igual a data de início e menor ou igual que a data de vencimento do contrato. Podem ser indicadas datas de feriados e não aceita finais de semana. Não será aplicado nenhum deslocamento nessa data para captura da cotação. Caso não haja cotação disponível nessa data, será utilizada a última cotação disponível.

Termo a termo

Termo de Termo

NAO

Data de Fixação

Cotação para Fixing

Forma de Atualização

Valor/Percentual Negociado

Atualizar Valor Base?

Cotação Inicial

Termo a Termo			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Termo de Termo	Informa se o contrato terá seu início em data futura.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: "Sim" ou "Não". A opção "Sim" aciona os campos: "Data de Fixação", "Valor/Percentual Negociado" e "Forma de Atualização" de preenchimento obrigatório.
Data de Fixação	Data em que o contrato terá sua Taxa a Termo formada, caso tenha sido informado o campo “Termo de Termo” = SIM	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório se Termo de Termo = "Sim" Para as Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central, indica a data de captura da cotação para cálculo da Taxa a Termo do contrato. Para as Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot, é utilizado o campo “Cotação para Fixing” para a definição da data da cotação da taxa a termo do contrato e a data de cotação para a atualização do valor base (para contratos com “Atualiza Valor Base?” = "Sim").

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA) Observação: É permitido que os titulares (Parte e Contraparte) do Contrato possam informar a Taxa de Fixação de Termo de Termo antes da data Informada na “Data de Fixação”. Isto é, durante o período de Termo, antes do início do contrato. O Contrato deve ter a Fonte de Informação Sisbacen/Feeder.
Cotação para Fixing	Deslocamento aplicado na Data de Fixação para apuração da cotação da moeda para formação da Taxa a Termo. Para contrato “Atualizar Valor Base?” = “Sim”, indica o deslocamento a ser aplicado na data informada no campo “Data de Fixação” para captura da cotação final para atualização do valor base.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando o campo “Termo de Termo” = “Sim” para as Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot. Para as Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central, o campo não pode ser preenchido, mesmo com o “Termo de Termo” = “Sim” Caixa com as opções: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5. Para o cálculo de IOF o sistema considera o campo “Data de Fixação” juntamente com o campo “Cotação para Fixação”. Por exemplo: Data de Fixação: 11/dez/15 e Cotação para Fixação: D-3. O IOF é considerado desde o dia 08/dez/15. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Forma de Atualização	Indica a forma de atualização da taxa inicial apurada na data início do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando o campo “Termo de Termo” = “Sim” Caixa de seleção com as opções: “Valor” ou “Percentual”.
Valor/Percentual Negociado	Informar o valor ou percentual negociado para ser aplicado para atualização da taxa inicial na data início do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Aceita números positivos e negativos, mas não pode ser preenchido com 0 (zero). Tipo: Numérico (até 4 inteiros e 8 decimais)
Atualizar Valor Base?	Indica se o valor base do contrato será atualizado no período a termo.	Opcional	Campo com as opções: “Sim” e Vazio. Só é possível indicar “Atualizar Valor Base?” = “Sim” quando o campo “Termo de Termo” = “Sim”. Quando o campo “Taxa média para Termo Asiático = Aritmética Ponderada ou Aritmética Média x Média”, o campo “Atualizar Valor Base?” deverá ficar vazio.

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Para mais informações sobre a metodologia de cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas do Termo.
Cotação Inicial	Campo destinado a informar a cotação inicial da paridade que será utilizada para a atualização do valor base no período a termo.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, se "Atualizar Valor Base" = "Sim".

Limite

Limites

Superior (Paridade)

Inferior (Paridade)

Limite			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limites	Informar se o contrato conta com limitador de variação de valorização do contrato.	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Superior, Inferior ou Superior/Inferior.
Superior (Paridade)	Paridade máxima aceita pelos participantes para correção do contrato. Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja maior que o valor definido no campo Superior, o sistema utilizará o valor preenchido neste campo para corrigir o contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo "Limites" for preenchido. Tipo: Numérico (até 6 inteiros e 8 decimais)
Inferior (Paridade)	Paridade mínima aceita pelos participantes para correção do contrato. Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja menor que o valor definido no campo Inferior, o sistema utilizará o valor preenchido neste campo para corrigir o contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo "Limites" for preenchido. Tipo: Numérico (até 6 inteiros e 8 decimais)

Prêmio

Prêmio a ser pago pelo

Valor do Prêmio (R\$)

Data de Liquidação

Modalidade de Liquidação

Prêmio			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Prêmio a ser pago pelo	Indicar a Parte que pagará o prêmio na data informada no campo Data de Liquidação, se houver	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.
Valor do Prêmio (R\$)	Informar o valor em reais (R\$) do prêmio total a ser pago na data informada no campo Data de Liquidação.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo "Prêmio a ser pago pelo" for preenchido. Tipo: Numérico (até 14 inteiros e 2 decimais)

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Modalidade de Liquidação	Indicar a modalidade de liquidação da operação de prêmio na data informada no campo Data de Liquidação. Operações Mercado x Cliente deverão ser obrigatoriamente na “Sem Modalidade”	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Prêmio a ser pago pelo” for preenchido. Caixa de seleção com as opções: Bilateral, Bruta ou Sem Modalidade.
Data de Liquidação	Indica a data de liquidação do prêmio.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Prêmio a ser pago pelo” for preenchido. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)

Observação

Observação

Código Identificador

Observação			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Observação	Campo disponível para preenchimento de alguma informação adicional necessária ao contrato.	Opcional	Tipo Alfanumérico (até 280 caracteres)
Código Identificador	Código de controle interno do participante.	Opcional	Tipo: Numérico (até 14 inteiros)

Datas de Verificação

Data Verificação

Valor Referência

Pesos (%)

Datas de Verificação			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data Verificação	Data(s) de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada, aritmética simples ou aritmética média x média. A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de ajustes, vencimento, antecipação informadas aplicando-se o deslocamento indicado.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Taxa Média para Termo Asiático” for preenchido. Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)

Valor Referência	Valor definido para data de referência, o qual é utilizado no cálculo da taxa média aritmética ponderada. O somatório destes valores deve ser igual ao Valor Base	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Taxa Média para Termo Asiático” for preenchido com = ARITMETICA PONDERADA Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
------------------	---	-------------	---

Ao clicar no botão **ENVIAR**, o sistema apresenta tela para confirmação.

Contrato a Termo de Moedas

Lançamento do Participante (Conta)
02666.00-2

Posição do Participante
VENDEDOR

CPF/CNPJ Cliente Participante

Contraparte(Conta)
02666.10-5

Contrato Global

CPF/CNPJ Cliente Contraparte
012.345.678-90

Características

Nº Controle Interno
1

Valor Base(Referência)
100,00

Data de Operação
28/11/2022

Data de Vencimento
28/11/2023

Fonte de Informação
SISBACEN

Moeda Base(Referência)
USD (220) - DOLAR DOS EUA

Moeda Cotada
BRL (790) - REAL

Código da Paridade

Cotação para o Vencimento
D-1

Data de Fixing da Paridade

Taxa a Termo
7,000000

Ajuste de Taxa

Ajustar Taxa
NÃO

Responsável pelo Ajuste de Taxa

Data Inicial para Ajuste de Taxa

Data Final para Ajuste de Taxa

Média Asiática

Taxa média para Termo Asiático

Quantidade de Datas de Verificação

Fonte de Informação

Cross Rate na Avaliação?
NÃO

Código da Paridade Cross

Data de Fixing da Paridade Cross

Boletim
PTAX800 de Fechamento

Fonte de Consulta

Tela ou Função de Consulta
Data de Avaliação

Praça de Negociação

Horário de Consulta

Cotação - Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)

Cotação - Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)

Termo a termo

Termo de Termo
NÃO

Data de Fixação

Cotação para Fixing

Forma de Atualização

Valor/Percentual Negociado

Atualizar Valor Base?

Cotação Inicial

Limite

Limites

Superior (Paridade)

Inferior (Paridade)

Prêmio

Prêmio a ser pago pelo

Valor do Prêmio (R\$)

Data de Liquidação

Modalidade de Liquidação

Observação

Observação

Código Identificador

Confirmar

Corrigir

Desistir

Ao clicar no botão **CONFIRMAR**, o sistema apresenta código do contrato registrado.



1.2 Commodities

As características para registro do contrato são semelhantes em suas maiorias, contudo algumas seções sofrem alterações quando os campos disponíveis para preenchimentos. Abaixo seguem as diferenças existentes.

Tela de Filtro Pré Registro

Termo > Termo Multiclasses > Lançamentos > Contrato a Termo

Registro de Contrato de Termo

Ação

INCLUIR

Código IF

Classe do Ativo Subjacente

COMMODITIES

Confirmar

Limpar Campos

Desistir

Tela de Registro

Contrato a Termo

Tipo Instrumento Financeiro

TER

Classe do Ativo Subjacente

COMMODITIES

Partes do Contrato

Lançamento do Participante (Conta)

Posição do Participante

CPF/CNPJ Cliente Parte

Contraparte(Conta)

Contrato Global

CPF/CNPJ Cliente Contraparte

Características

Fonte de Informação

BLOOMBERG/SISBACEN

Valor Base(Referência) / Quantidade

Data de Operação

12/6/2023

Data de Vencimento

Ativo Subjacente

Data de Fixing do Ativo Subjacente

Taxa a Termo

Data de Fixing da Moeda

Nº Controle Interno

Ajuste de Taxa

Ajustar Taxa

NAO

Responsável pelo Ajuste de Taxa

Data Inicial para Ajuste de Taxa

Data Final para Ajuste de Taxa

Média Asiática

Taxa média para Termo Asiático

Quantidade de Datas de Verificação

Fonte de Informação

Tipo de Cotação

MAXIMO

Termo a termo

Termo de Termo

NAO

Data de Fixação

Forma de Atualização

Valor/Percentual Negociado

Atualizar Valor Base?

Cotação Inicial

Limite

Limites

Superior (Paridade)

Inferior (Paridade)

Prêmio

Prêmio a ser pago pelo

Valor do Prêmio

Data de Liquidação

Modalidade de Liquidação

Observação

Observação

Código Identificador

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Características

Características

Fonte de Informação

Valor Base(Referência) / Quantidade

Data de Operação

Data de Vencimento

Ativo Subjacente

Data de Fixing do Ativo Subjacente

Taxa a Termo

Taxa a Termo em Reais?

Data de Fixing da Moeda

Nº Controle Interno

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento indicado pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.	Obrigatório	Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
Valor Base (Referência)/Quantidade	Valor base ou quantidade do contrato expresso na moeda de referência.	Obrigatório	Tipo: Numérico (limite de 14 inteiros e 2 decimais). Quando casas decimais não preenchidas, o sistema preenche com zeros
Data de Operação	Data em que o participante contratou a operação. Data de início do contrato, se contrato registrado à vista.	Obrigatório	Pode ser informada em até D-2 útil anterior à data do sistema, quando a contraparte na operação é de um conta de seus clientes (tipo de conta 1). Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato.	Obrigatório	A data de vencimento do contrato pode ser indicada em feriados, porém não pode ser indicado um final de semana. Caso o ajuste caia em dia não útil, o sistema irá gerar o ajuste para o próximo dia útil conhecido. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Fonte de Informação	Indica a fonte a ser utilizada para a cotação de fixing para vencimento. A fonte de informação é utilizada nos eventos de Resgate (vencimento) do contrato, fixing dos contratos	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Bloomberg, Bloomberg/SISBACEN, Banco Central. A lista atualizada de domínios pode ser consultada no arquivo público:

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	asiático e quando indicado Termo a Termo.		“AAAAMMDD_Dominios_Derivativos_COE”
Código do Ativo Subjacente	Ativo Subjacente que será utilizada no contrato.	Obrigatório	Para verificar a lista de paridades disponíveis e qual sua moeda cotada, verificar o arquivo público “AAAAMMDD_Ativos_Subjacentes.txt”.
Data de fixing do Ativo Subjacente	Data para captura da cotação do ativo subjacente indicado no campo “Código do Ativo Subjacente”.	Obrigatório	A data deve ser maior que a data de início e menor ou igual que a data de vencimento do contrato. OBS: se o ativo subjacente for commodity , deve ser indicada uma data menor que a data de vencimento do contrato. Podem ser indicadas datas de feriados e não aceita finais de semana. Não será aplicado nenhum deslocamento nessa data para captura da cotação. Caso não haja cotação disponível nessa data, será utilizada a última cotação disponível.
Data de fixing da Moeda	Data para captura da cotação da moeda do ativo subjacente indicado no campo “Código do Ativo Subjacente”, para ativos cotados em moeda diferente do real	Opcional	A data deve ser maior ou igual a data de início e menor ou igual que a data de vencimento do contrato. Podem ser indicadas datas de feriados e não aceita finais de semana. Não será aplicado nenhum deslocamento nessa data para captura da cotação. Caso não haja cotação disponível nessa data, será utilizada a última cotação disponível. Caso não seja informada a data, o sistema irá adotar a mesma data do campo “Data de Fixing do Ativo Subjacente”
Taxa a Termo	Valor da taxa a termo contratada.	Obrigatório	Tipo: Numérico (até 12 inteiros e 8 decimais)
Taxa a Termo em Reais	Indica que a Taxa a Termo informada no registro do contrato está expressa em reais*.	Opcional	Caixa de seleção com a opção: SIM.

Fonte de Informação

Fonte de Informação

Tipo de Cotação

AJUSTE

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Tipo de Cotação	Indica o tipo de cotação do Ativo Subjacente selecionado será utilizada para captura da cotação final do contrato, para cálculo do vencimento e do termo a termo.	Obrigatório	Campo com as opções: FECHAMENTO, MÍNIMO, MÁXIMO, MÉDIO ou AJUSTE.

Termo a Termo

Termo a termo

Termo de Termo

NAO

Data de Fixação

Forma de Atualização

Valor/Percentual Negociado

Atualizar Valor Base?

Cotação Inicial

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Termo de Termo	Informa se o contrato terá seu início em data futura.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: "Sim" ou "Não". A opção "Sim" aciona os campos: "Data de Fixação", "Valor/Percentual Negociado" e "Forma de Atualização" de preenchimento obrigatório.
Data de Fixação	Data em que o contrato terá sua Taxa a Termo formada e a data de captura da cotação para cálculo da Taxa a Termo do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório se Termo de Termo = SIM.
Forma de Atualização	Indica a forma de atualização da taxa inicial apurada na data início do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório se Termo de Termo = SIM. Caixa de seleção com as opções: "Valor" ou "Percentual".
Valor/Percentual Negociado	Informar o valor ou percentual negociado para ser aplicado para atualização da taxa inicial na data início do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Aceita números positivos e negativos, mas não pode ser preenchido com 0 (zero). Tipo: Numérico (até 4 inteiros e 8 decimais)
Atualizar Valor Base?	Indica se o valor base do contrato será atualizado no período a termo.	Opcional	Campo com as opções: "Sim" e Vazio. Só é possível indicar "Atualizar Valor Base?" = "Sim" quando o campo "Termo de Termo" = "Sim". Quando o campo "Taxa média para Termo Asiático = Aritmética Ponderada ou Aritmética Média x Média", o campo "Atualizar Valor Base?" deverá ficar vazio.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Para mais informações sobre a metodologia de cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas do Termo.
Cotação Inicial	Para contrato Termo a Termo com atualização do valor base. Campo destinado a informar a cotação inicial da paridade que será utilizada para a atualização do valor base no período a termo.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, se "Atualizar Valor Base" = "Sim".

Limite

Limites

Superior (Paridade)

Inferior (Paridade)

Limite			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limites	Informar se o contrato conta com limitador de variação de valorização do contrato.	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Superior, Inferior ou Superior/Inferior.
Superior (Paridade)	Paridade máxima aceita pelos participantes para correção do contrato. Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja maior que o valor definido no campo Superior, o sistema utilizará o valor preenchido neste campo para corrigir o contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo "Limites" for preenchido. Tipo: Numérico (até 6 inteiros e 8 decimais)
Inferior (Paridade)	Paridade mínima aceita pelos participantes para correção do contrato. Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja menor que o valor definido no campo Inferior, o sistema utilizará o valor preenchido neste campo para corrigir o contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo "Limites" for preenchido. Tipo: Numérico (até 6 inteiros e 8 decimais)

Prêmio

Prêmio a ser pago pelo

Valor do Prêmio

Data de Liquidação

Modalidade de Liquidação

Prêmio em Moeda Estrangeira

Data de Fixing da Moeda do Prêmio

Prêmio

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Prêmio a ser pago pelo	Indicar a Parte que pagará o prêmio na data informada no campo Data de Liquidação, se houver	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.
Prêmio em Moeda Estrangeira	Indicar se o Valor do Prêmio indicado está em BRL (vazio) ou na Moeda Cotada do Ativo Subjacente	Opcional	Caixa de seleção com a opção: SIM ou VAZIO
Valor do Prêmio	Informar o valor do prêmio total a ser pago na data informada no campo Data de Liquidação.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Prêmio a ser pago pelo” for preenchido. Tipo: Numérico (até 14 inteiros e 2 decimais)
Modalidade de Liquidação	Indicar a modalidade de liquidação da operação de prêmio na data informada no campo Data de Liquidação. Operações Mercado x Cliente deverão ser obrigatoriamente na “Sem Modalidade”	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Prêmio a ser pago pelo” for preenchido. Caixa de seleção com as opções: Bilateral, Bruta ou Sem Modalidade.
Data de Fixing da Moeda do Prêmio	Indicar a data de fixing da Moeda do Prêmio caso ele seja indicado em Moeda Estrangeira	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Prêmio em Moeda Estrangeira” for preenchido. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data de Liquidação	Indica a data de liquidação do prêmio.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Prêmio a ser pago pelo” for preenchido. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)

Observação

Observação

Código Identificador

Observação			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Observação	Campo disponível para preenchimento de alguma informação adicional necessária ao contrato.	Opcional	Tipo Alfanumérico (até 280 caracteres)
Código Identificador	Código de controle interno do participante.	Opcional	Tipo: Numérico (até 14 inteiros)

Datas de Verificação

Data Verificação

Data de Verificação da Moeda

Valor Referência

Pesos (%)

Datas de Verificação			
Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data Verificação	Data(s) de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada, aritmética simples ou aritmética média x média. A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de ajustes, vencimento, antecipação Informadas.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Taxa Média para Termo Asiático” for preenchido. Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data Verificação da Moeda	Data(s) de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada, aritmética simples ou aritmética média x média. A data efetiva considerada para a captura da cotação da Moeda do cotada do Ativo Subjacente, caso tenha “Taxa a Termo em Reais” = SIM.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Taxa Média para Termo Asiático” for preenchido. Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Valor Referência	Valor definido para data de referência, o qual é utilizado no cálculo da taxa média aritmética ponderada. O somatório destes valores deve ser igual ao Valor Base	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Taxa Média para Termo Asiático” for preenchido com = ARITMETICA PONDERADA Tipo: Numérico (até 10 inteiros)

Ao clicar no botão **ENVIAR**, o sistema apresenta tela para confirmação.

Contrato a Termo			
Tipo Instrumento Financeiro TER		Classe do Ativo Subjacente COMMODITIES	
Partes do Contrato			
Lançamento do Participante (Conta) 06000.00-5		Posição do Participante COMPRADOR	CPF/CNPJ Cliente Parte 012.345.678-90
Contraparte(Conta) 06000.10-5		Contrato Global	CPF/CNPJ Cliente Contraparte 012.345.678-90
Características			
Fonte de Informação BLOOMBERG	Valor Base/Referência / Quantidade 5.000.00	Data de Operação 11/08/2023	Data de Vencimento 28/08/2023
Ativo Subjacente ALUMINIO	Data de Fixing do Ativo Subjacente 25/08/2023	Taxa a Termo 100.00000000	Taxa a Termo em Reais? SIM
Data de Fixing da Moeda 25/08/2023	Nº Controle Interno 23232		
Ajuste de Taxa			
Ajustar Taxa NÃO	Responsável pelo Ajuste de Taxa	Data Inicial para Ajuste de Taxa	Data Final para Ajuste de Taxa
Média Asiática			
Taxa média para Termo Asiático		Quantidade de Datas de Verificação	
Fonte de Informação			
Tipo de Cotação AJUSTE			
Termo a termo			
Termo de Termo NÃO	Data de Fixação	Forma de Atualização	Valor/Percentual Negociado
Cotação Inicial			Atualizar Valor Base?
Limite			
Limite	Superior (Paridade)	Inferior (Paridade)	
Prêmio			
Prêmio a ser pago pelo Modalidade de Liquidação	Valor do Prêmio Prêmio em Moeda Estrangeira	Data de Liquidação Data de Fixing da Moeda do Prêmio	
Observação			
Observação Codigo Identificador			



Ao clicar no botão **CONFIRMAR**, o sistema apresenta código do contrato registrado.



Contrato 23H00045201 registrado sob o No. CETIP 2023081110319404

REGISTRO

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E
EXCLUSÃO

TAXA DE
AVALIAÇÃO

AJUSTE
DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIAÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

2. ANTECIPAÇÃO

Visão Geral

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

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

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo MultiClasses > Lançamento > Antecipação

Arquivo:

- 4.11.3. ANTECIPACAOTER – Antecipação TER

Mensageria:

- CTP9014 –TERMO – Antecipação de Resgate de Contrato de Derivativo

PRAZOS: A partir de D+1 da data do registro até D-1 do vencimento do contrato.

Tela Detalhe de Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato

Lançamento do Participante (Conta)

Contraparte(Conta)

Nº Controle Interno

Contrato 21F00001277

Valor Base a Antecipar

Data Antecipação 29/9/2021

Data Liquidação 29/9/2021

Taxa a Termo

Taxa de Juros (%)

Liquidante (Conta)

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Descrição dos Campos da Tela Detalhe Antecipação de Contrato

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Lançamento do Participante (Conta)	Código da conta do membro envolvido na operação.	Obrigatório	
Contraparte (Conta)	Código da conta que identifica o membro com quem foi efetuado o contrato.	Obrigatório	
Número Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.	Obrigatório	Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
Contrato	Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro.	Obrigatório	
Valor Base a Antecipar	É valor que se deseja antecipar. Pode representar parte ou a totalidade do valor base registrado no contrato ou do saldo remanescente.		Observações: Quando contrato Asiático com média ponderada este campo deve ser preenchido com valor igual à soma dos valores a antecipar informado em cada data de verificação (dados complementares). Tipo: Numérico (até 14 inteiros e 2 decimais)
Data Antecipação	Este campo deve ser preenchido quando se deseja efetuar uma Antecipação Retroativa com conta de cliente 1. Deve ser preenchido em no máximo D-2 útil anterior à data do sistema.	Condicional	Obrigatório, quando existir.
Data Liquidação	Este campo permite indicar no momento do lançamento da antecipação parcial ou total, que a liquidação do financeiro da antecipação será em D+1. Caso não seja preenchido, a liquidação ocorrerá em D0	Opcional	
Valor Financeiro	Valor Financeiro da Antecipação. Este campo é apresentado na tela de confirmação do lançamento da antecipação e corresponde ao resultado	Obrigatório	Tipo: Numérico (até 12 inteiros e 2 decimais)
Taxa a Termo	Valor da taxa contratada entre comprador e vendedor para realização da antecipação.	Condicional	Obrigatório, quando existir. Tipo: Numérico (até 4 inteiros e 8 decimais)
Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada)	A taxa de câmbio utilizada para cálculo da antecipação, caso o ativo tenha moeda cotada diferente de BRL (790) - Real	Obrigatório	Disponível apenas quando o campo "Taxa Cotada" for

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			preenchido com moeda diferente de BRL (790) – REAL
Taxa de Juros %	A função permite a antecipação de contrato de Termo onde a taxa de juros indicada pode assumir valor positivo, negativo ou nulo. Expressa em % ao ano, para 252 dias úteis com tratamento exponencial.	Condicional	Obrigatório, quando existir. Tipo: Numérico (até 2 inteiros e 8 decimais)
Liquidante (Conta)	Código da conta do Banco Liquidante que fará a liquidação financeira da operação. Caso o campo não seja preenchido, o sistema assumirá o Banco Liquidante Principal.	Condicional	Obrigatório, quando existir.

Antecipação de Contrato

Lançamento do Participante (Conta) 05000.00-5
Contraparte(Conta) 10020.00-1
Nº Controle Interno 5278
Contrato 21F00001277
Valor Base a Antecipar 1.000.000,00
Data Antecipação 29/09/2021
Valor Financeiro 3.909.428,00
Data Liquidação 29/09/2021
Taxa a Termo 5,13000000
Taxa de Juros (%) 0,75000000
Liquidante (Conta)

Após a confirmação do lançamento da antecipação, o sistema envia mensagem informando:

- O número da operação realizada, o código do contrato e o valor financeiro calculado a receber, quando efetuado o lançamento da antecipação.

Conforme mensagem a seguir:



3. CESSÃO

Visão Geral

Funcionalidade disponível para realizar a transferência de titularidade de uma das partes do derivativo a um terceiro, desde que com anuência da contraparte e mediante pagamento de financeiro.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo MultiClasses > Lançamentos > Cessão de Contrato

Arquivo

- Não disponível

Mensageria:

- CTP9020 – Operação de Cessão de Contrato de Derivativo

Regras:

- 1) Contrato entre contas 00 e 10 do mesmo participante, ao ceder a ponta da conta 10 para uma conta 20 de outro ou mesmo participante, é necessário efetuar a confirmação do anuente.
- 2) Caso o Anuente não confirme a cessão, até o encerramento do horário estabelecido para a grade sem liquidação no STR (Sem modalidade), ela não é processada, permanecendo o contrato com suas condições originais.
- 3) Não é permitida a cessão de contrato de Termo de Moedas com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.
- 4) O sistema deve impedir a realização de uma nova cessão caso já exista uma Cessão com status diferente de “Finalizada” e “Cancelada”.

PRAZOS: A partir de D0 da data do registro até D-1 da data de fixação do contrato.

Tela Detalhe de Cessão de Contra

Cessão de Contrato

Lançamento do Participante (Conta)

Posição do Participante

Contraparte (Conta)

CPF/CNPJ (Cedente)

CPF/CNPJ (Adquirente)

Nº Controle Interno

Contrato

Valor do Prêmio

Titular do Prêmio

Enviar

Limpar Campos

Desistir

Descrição dos Campos da Tela

Campo	Tipo de Preenchimento	Descrição
Lançamento do Participante (Conta)	Obrigatório	Código da conta do Participante que está efetuando o lançamento: Cedente ou Adquirente.
Posição do participante	Obrigatório	Campo com as opções: Cedente ou Adquirente. Identifica o participante que está efetuando o lançamento.
Contraparte (Conta)	Obrigatório	Código da conta do outro participante envolvido na operação: Cedente ou Adquirente.
CPF/CNPJ (Cedente)	Condicional	Campo Obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.
CPF/CNPJ (Adquirente)	Condicional	Campo Obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.
Nº Controle Interno	Obrigatório	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
Contrato	Obrigatório	Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro do mesmo.
Valor do Prêmio	Condicional	Obrigatório, quando houver. Valor do prêmio a ser pago. Não é necessário que o valor do prêmio seja o mesmo pago na operação original. Caso o campo não seja preenchido as partes não se obrigam, ou seja, apenas realizam a cessão do contrato. Tipo: Numérico (até 14 inteiros e 2 decimais)
Titular do Prêmio	Condicional	Obrigatório se for preenchido o campo "Valor do Prêmio". Indica a ponta que deve receber o prêmio, se houver

Após a confirmação do lançamento, o sistema envia tela de mensagem informando:

- O número da operação e o número do contrato, quando as duas partes envolvidas na operação efetuaram o lançamento.

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIAÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Cessão de Contrato

Lançamento do Participante (Conta) 02666.00-2

Posição do Participante ADQUIRENTE

Contraparte (Conta) 05000.10-8

CPF/CNPJ (Cedente) 012.345.678-90

CPF/CNPJ (Adquirente)

Nº Controle Interno 152131

Contrato 23E00051209

Valor do Prêmio 120,00

Titular do Prêmio CEDENTE

Confirmar

Corrigir

Desistir

4. ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

Esta função permite ao participante com perfil de SUPERVISOR ou DIGITADOR, alterar ou excluir os contratos realizados entre Participantes distintos, nos prazos especificados.

Tela: FORMAS DE LANÇAMENTO

Termo > Termo MultiClasses > Lançamentos > Alteração e Exclusão de Contrato

- Arquivo e Mensageria:
- Não disponível

As operações de **alteração** e **exclusão** de contratos de **clientes**, a partir de **D+4**, podem ser realizadas até **D-5** da data de vencimento do contrato mediante a devida justificativa. Após esse prazo, o participante deverá entrar em contato com a área de atendimento operacional de Derivativos de Balcão para realizar qualquer alteração

	Prazo para Alteração	
Tipo de Contrato	D0 até D+3	A partir de D+4 até D-5 do vencimento
Mercado x Cliente (00x10, 10x10, 00x20 própria)	Sim	Sim*
Mercado x Mercado (00x00, 00x20 mercado)	Sim	Não**

*: A alteração de contratos a cliente, a partir de D+4 do registro, segue o fluxo descrito abaixo: “Alteração com aprovação B3”

** : Para solicitar alterações fora do prazo atualmente permitido pelo sistema, contatar a área de atendimento operacional de Derivativos de Balcão.

Tela de Correção de Contrato

Alteração e Exclusão de Contrato

Código IF
22G00084006

Lançamento do Participante (Conta)

05000

00

5

Posição do Participante

COMPRADOR

CPF/CNPJ Cliente Participante

Contraparte(Conta)

02666

00

2

Contrato Global

NÃO

CPF/CNPJ Cliente Contraparte

Características

Nº Controle Interno

Valor Base(Referência)

1800000

Data de Operação

29

7

2022

Data de Vencimento

4

8

2022

Moeda Base(Referência)

USD (220) - DOLAR DOS EUA

Moeda Cotada

BRL (790) - REAL

Taxa a Termo

6

.

Ajuste de Taxa

Ajustar Taxa

NÃO

Responsável pelo Ajuste de Taxa

Data Inicial para Ajuste de Taxa

Data Final para Ajuste de Taxa

Média Asiática

Taxa média para Termo Asiático

Quantidade de Datas de Verificação

Fonte de Informação

Cross Rate na Avaliação?

NÃO

Fonte de Informação

SISBACEN

Cotação para o Vencimento

D-1

Boletim

PTAX800 de Fechamento

Fonte de Consulta

Tela ou Função de Consulta

Praga de Negociação

Horário de Consulta

Cotação - Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)

Cotação - Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)

Data de Avaliação

Código da Paridade

Data de Fixing da Paridade

Código da Paridade Cross

Data de Fixing da Paridade Cross

Termo a termo

Termo de Termo

NÃO

Data de Fixação

Cotação para Fixing

Forma de Atualização

Valor/Percentual Negociado

Atualizar Valor Base?

Cotação Inicial

Limite

Limites

Superior (Paridade)

Inferior (Paridade)

Prêmio

Prêmio a ser pago pelo

COMPRADOR

Valor do Prêmio (R\$)

500

Data de Liquidação

10

11

2022

Modalidade de Liquidação

SEM MODALIDADE

Observação

Motivo da Alteração

Código Identificador

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Regras gerais para Alteração e Exclusão de Contrato:

- Os contratos não podendo estar nas situações: VENCIDO ou CEDIDO.
- A **ALTERAÇÃO** e **EXCLUSÃO** do contrato somente poderá ser feita até **D-5** do vencimento do contrato em nosso sistema, perante a justificativa para tal ação. Fora deste prazo, o participante somente poderá **ALTERAR** ou realizar a **EXCLUSÃO** contatando a área de atendimento operacional de Derivativos de Balcão.
- Quando operação efetuada entre contas de clientes 1 do participante ou entre o participante e seu cliente 1, é necessário apenas o lançamento do participante. No caso de contrato entre Participantes ou entre o Participante e seu cliente 2, o duplo lançamento é obrigatório.
- A alteração/exclusão do contrato deve obedecer a Grade Sem Liquidação STR - CTP11 e não pode ocorrer na data do vencimento do contrato.
- O contrato pode ser alterado mais de uma vez no mesmo dia desde que a alteração anterior esteja confirmada/aprovada ou cancelada.
- Para alterações realizadas pelo participante em até D+3 do registro, é gerada a operação **99 – ALTERAÇÃO DE CONTRATO**.
- Para alterações realizadas pela B3 (mediante solicitação do Participante), é gerada a operação **98 – ALTERAÇÃO DE CONTRATO P/ CETIP**.
- Alterações e exclusões não envolvem financeiro.
- Na consulta Contratos é exibida a informação atualizada, no campo que sofreu a alteração.
- Disponibilização ao participante do relatório RALTERAÇÕES, através do Nome/Transferência de Arquivos/Arquivo/Receber Relatórios, em formato.pdf. A Emissão desse relatório é no dia seguinte ao da retificação do contrato e no próprio são exibidos os detalhes do contrato, antes e depois da alteração. No relatório RMAPAMOVTERMOPDF também são exibidas as operações de alterações realizadas.

Regras gerais para Alteração de Contrato a partir de D+4 da data de registro:

- As alterações realizadas a partir de D+4 passam pelo fluxo de aprovação B3 para que seja efetivada a alteração.
- No momento da Alteração, deve ser informado no campo **Motivo** a justificativa da alteração.
- O prazo para aprovação/rejeição da Alteração pela B3 é de até 3 dias úteis.
- Após o lançamento da alteração, o contrato passa para o status de: “**PENDENTE APROVAÇÃO B3**”, que indica que a alteração será analisada pela B3.
- Enquanto o contrato está nesse status (máximo de 3 dias), os lançamentos abaixo **não poderão ser realizados**:
 - Antecipação
 - Aceleração
 - 2ª Alteração

- Cessão de Contrato
- Exclusão de Contrato
- Taxa de Câmbio para Avaliação
- Ajustar a Taxa

- Caso seja necessário realizar alguma operação descrita acima, enquanto o contrato estiver “**PENDENTE APROVAÇÃO B3**”, a alteração deve ser cancelada pelo Participante.
- É gerada a operação **96 – ALTERAÇÃO COM APROVAÇÃO B3**
- Não é permitido o lançamento de Alteração que passe pela aprovação da B3 quando houver um Agendamento de Antecipação no contrato (para mais informações, consultar: [Antecipação de Contrato](#))

Contratos de Termos de Moeda com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.

A alteração de contrato de Termos de Moeda que afete Redutor de Risco de Crédito não gera alteração de Agenda de Redutor de Risco de Crédito, tais alterações devem ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos - MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

Tela Filtro de Alteração e Exclusão de Contrato

Termo > Termo Multiclasses > Lançamentos > Alteração e Exclusão de Contrato

Alteração e Exclusão de Contrato

Código IF

Posição do Participante

Ação

CORRECAO

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Após o preenchimento do nº do contrato que se deseja alterar, clique no botão **Confirmar**, o módulo apresenta tela com os dados preenchidos conforme no registro do contrato.

Descrição dos Campos da Tela Filtro de Alteração e Exclusão de Contrato

Campo	Descrição
Posição do Participante	Caixa de seleção com as opções: COMPRADOR e VENDEDOR.
Ação	Caixa de seleção com as opções: CORREÇÃO, ADITAMENTO e EXCLUSÃO.

Descrição dos Campos da Tela de Correção de Contrato

Alteração e Exclusão do Contrato

Alteração e Exclusão de Contrato		
Código IF 23E00429403		
Lançamento do Participante (Conta) 02666 00 2	Posição do Participante COMPRADOR	CPF/CNPJ Cliente Participante _____
Contraparte(Conta) 02666 10 5	Contrato Global ▼	CPF/CNPJ Cliente Contraparte 012.345.678-90

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento indicado pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.	Obrigatório	Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
Valor Base (Referência)/ Quantidade	Valor base ou quantidade do contrato expresso na moeda de referência. Quando casas decimais não preenchidas, o sistema preenche com zeros	Obrigatório	Tipo: Numérico (limite de 14 inteiros e 2 decimais)
Data de Operação	Data em que o participante contratou a operação. Data de início do contrato, se contrato registrado à vista.	Obrigatório	Pode ser informada em até D-2 útil anterior à data do sistema, quando a contraparte na operação é de um conta de seus clientes (tipo de conta 1). Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato.	Obrigatório	A data de vencimento do contrato pode ser indicada em feriados, porém não pode ser indicado um final de semana. Caso o ajuste caia em dia não útil, o sistema irá gerar o ajuste para o próximo dia útil conhecido. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Moeda Base (Referência)	Indica a moeda objeto do contrato a termo.	Condicional	Obrigatório para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot. Quando utilizada as fontes Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central, o campo não deve ser preenchido e a moeda base e a moeda cotada serão definidas com base na paridade indicada no campo "Código da Paridade".
Moeda Cotada	Indica a moeda de referência em que a Moeda Base é cotada, para	Condicional	Obrigatório para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	apuração da atualização do contrato		Quando utilizada as fontes Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central, o campo não deve ser preenchido e a moeda base e a moeda cotada serão definidas com base na paridade indicada no campo "Código da Paridade".
Moeda Base (Referência)	Indica a moeda objeto do contrato a termo.	Condicional	Obrigatório para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot. Quando utilizada as fontes Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central, o campo não deve ser preenchido e a moeda base e a moeda cotada serão definidas com base na paridade indicada no campo "Código da Paridade".
Taxa a Termo	Valor da taxa de câmbio contratada entre comprador e vendedor. É utilizada na apuração do resultado.	Condicional	Informado com até 4 (quatro) inteiros e 6 (seis) decimais, quando Moeda Base (Referência) escolhida for USD – Dólar dos EUA e 8 (oito) decimais para outras moedas.
Ajustar Taxa	Indica se o contrato conta com Shift, ou seja, modificação da taxa forward, por meio das opções "Sim" e "Não". Em caso da opção ser SIM a função retornará os seguintes campos: Responsável pelo Ajuste de Taxa, Data Inicial para ajuste de taxa, Data Final para ajuste de taxa.	Obrigatório	-
Responsável pelo Ajuste de Taxa	Indicar o responsável pelo ajuste de taxa, com as opções: Comprador, Vendedor ou Comprador e Vendedor. O Participante pode ou não ajustar a taxa no período contratado	Condicional	Obrigatório, quando houver.
Data Inicial para Ajuste de Taxa	Indica o início do período estipulado para o ajuste de taxa pelo Participante responsável.	Condicional	Obrigatório, quando houver. Para lançamento do contrato com os campos "Ajustar Taxa" e "Termo de Termo" preenchidos com as Opções: SIM e SIM: A data inicial para ajuste de taxa deve ser igual ou superior a D+1 útil da data de fixação. SIM e NÃO: A data inicial para ajuste da taxa deve ser igual ou superior a D+1 útil do lançamento do contrato. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data Final para Ajuste de Taxa	Indica o final do período estipulado para o ajuste de taxa pelo Participante responsável.	Condicional	Obrigatório, quando houver. Deve estar entre D+1 da Data Inicial para ajuste de taxa e menor ou igual a D-1 da data de vencimento do contrato. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Taxa média para Termo Asiático	Indica o tipo de média para a taxa de câmbio para liquidação do contrato, com as opções: Aritmética simples, Aritmética ponderada e Aritmética média x média. Após a escolha da opção é apresentado o item Datas de Verificação para a inclusão dos dados complementares.	Obrigatório	Só preencher quando opção de contrato for à modalidade Termo Asiático.
Quantidade de Datas de Verificação	Quantidade de Datas de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada, simples ou aritmética média x média.	Condicional	Obrigatório, quando houver. Tipo: Numérico (limite de 3 (três) inteiros).
Cross Rate na Avaliação?	-	Condicional	Obrigatório, quando o participante optar pela utilização desta opção. O uso desta opção não é permitido, quando moeda de referência ou cotada for Dólar dos EUA e quando a fonte de informação for Sisbacen.
Fonte de Informação	A fonte de informação é utilizada nos eventos de Resgate (vencimento) do contrato, <i>fixing</i> dos contratos asiático e também quando indicado Termo a Termo. De acordo com a Modalidade do Contrato ou a Fonte de Informação a ser utilizado para a consulta de cotação, o módulo apresenta campos diferentes a serem preenchidos. A descrição dessas diferenças encontra-se no capítulo Introdução ao Termo de Moedas/Conhecendo o Produto ou no capítulo Informações Adicionais/Regras de Registro Conforme Fonte de Informação.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Sisbacen, Feeder, Spot, Sisbacen/Feeder, Bloomberg e Bloomberg/SISBACEN. Indica a fonte a ser utilizada para a cotação de fixing para vencimento. Regras específicas de acordo com a fonte de informação = • SPOT ○ A moeda de referência deve ser Moeda Base = USD (Dólar Americano) e Moeda Cotada = BRL (Real). ○ É permitida a indicação do Fixing em D0, informando Spot D0 no campo "Tela ou Função de Consulta Função de Consulta". • FEEDER

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			○ Caso a fonte de informação para formação da Taxa a Termo (Forward) seja o ECB/BCE (Banco Central Europeu), mas esta fonte seja diferente da que será utilizada para a formação do fixing para vencimento, a fonte BCE/ECB deve ser informada exclusivamente no campo "Observação". ○ É permitida a indicação do Fixing em D0, informando Spot D0 no campo "Tela ou Função de Consulta Função de Consulta".
Cotação para o vencimento	Indica a data de cotação para o vencimento.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório para as fontes SISBACEN ou SISBACEN/FEEDER. Campo não pode ser informado para as fontes FEEDER, SPOT, BLOOMBERG, BLOOMBERG/SISBACEN ou BANCO CENTRAL. Caixa de seleção com as opções: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.
Boletim	Deverá ser informado qual o Boletim de fechamento de cotação da moeda. Campo as opções: 18h00 - Fechamento.	Condicional	Obrigatório para as fontes Sisbacen ou Sisbacen/Feeder. Campo não pode ser informado para a fonte Feeder, Spot, Bloomberg ou Bloomberg/Sisbacen
Fonte de Consulta	Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da cotação da moeda.	Condicional	Obrigatório para as fontes Sisbacen/Feeder, Feeder ou Spot. Não pode ser informado para a fonte Sisbacen, Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen ou Banco Central. Possui as opções: Spot, Reuters, Broadcast, Bloomberg, BCE e outros.

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Tela ou Função de Consulta	Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que deve ser utilizada pelos Participantes para cotação. Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.	Opcional	Não pode ser preenchido para as fontes Sisbacen, Bloomberg e Bloomberg/Sisbacen. É possível informar Spot D0 quando a fonte de informação for Feeder ou Spot.
Praça de Negociação	Local de negociação da moeda de referência. Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo de Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.	Opcional	Não pode ser preenchido para as fontes Sisbacen, Bloomberg e Bloomberg/Sisbacen. É possível informar Spot D0 quando a fonte de informação for Feeder ou Spot.
Horário de Consulta	Horário de verificação da taxa de câmbio. Para verificar os domínios disponíveis, consultar o arquivo AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios.txt que se encontra no módulo de Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.	Opcional	Não pode ser preenchido para as fontes Sisbacen, Bloomberg e Bloomberg/Sisbacen.
Cotação – Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD)	A taxa de câmbio utilizada para avaliação do contrato.	Condicional	Obrigatório quando a fonte de informação para taxa de câmbio no contrato for “Feeder”, “Spot” ou “Sisbacen/Feeder”. Não pode ser preenchido para as fontes Sisbacen, Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen e Banco Central. Caixa de seleção com as opções: “VENDA”, “COMPRA” e “MÉDIA”.
Cotação – Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda)	A taxa de câmbio utilizada para avaliação do cross-rate.	Condicional	Obrigatória quando a fonte de informação para taxa de câmbio no contrato for “Feeder”, “Spot” ou “Sisbacen/Feeder”. Caso o contrato não possua Cross Rate na avaliação, o campo deve ser preenchido com a opção “NENHUM”. Caso o contrato possua Cross Rate na avaliação, o campo pode ser preenchido com uma das seguintes opções, de acordo com a “Fonte de Informação” indicada: • Para as fontes “Feeder” e “Spot”, podem ser indicadas as opções: “VENDA”, “COMPRA” ou “MÉDIA”. • Para a fonte “Sisbacen/Feeder”, podem ser indicadas as opções: “VENDA” ou “COMPRA”.

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Caixa de seleção com as opções: "NENHUM", "VENDA", "COMPRA" e "MÉDIA".
Data de Avaliação	Data pactuada entre as partes para indicar a partir de quando será possível avaliar o contrato. A última data em que o contrato for avaliado apresentará a cotação utilizada para a liquidação financeira.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório para as fontes Spot, Sisbacen/Feeder e Feeder. Campo não pode ser informado para as fontes Sisbacen, Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen ou Banco Central. A data de avaliação deve ser maior que a data de início do contrato e até D-1 da data de vencimento do contrato. Quando for opção asiática deve coincidir com a primeira data de verificação. Quando for Spot D0 a data é a do vencimento do contrato.
Código da Paridade Cross	Paridade do Cross-rate que será utilizada no contrato. Para verificar a lista de paridades disponíveis e qual sua moeda cotada, verificar o arquivo público AAAAMMDD_Ativos_Subjacentes.txt que se encontra no módulo de Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório para a fonte Bloomberg/Sisbacen. Campo não pode ser informado para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder ou Spot. Não pode ser a mesma paridade informada no campo "Código da Paridade"
Data de fixing da Paridade Cross	Data para captura da cotação da paridade indicada no campo "Código da Paridade Cross".	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório para a fonte Bloomberg/Sisbacen. Campo não pode ser informado para as fontes Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder ou Spot. A data deve ser maior ou igual a data de início e menor ou igual que a data de vencimento do contrato. Podem ser indicadas datas de feriados e não aceita finais de semana. Não será aplicado nenhum deslocamento nessa data para captura da cotação. Caso não haja cotação disponível nessa data, será utilizada a última cotação disponível.
Termo de Termo	Informa se o contrato terá seu início em data futura.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: "Sim" ou "Não". A opção "Sim" aciona os campos: "Data de Fixação", "Valor/Percentual Negociado" e "Forma de Atualização" de preenchimento obrigatório.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data de Fixação	Data em que o contrato terá sua Taxa a Termo formada, caso tenha sido informado o campo "Termo de Termo" = SIM	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório se Termo de Termo = "Sim" Para as Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central, indica a data de captura da cotação para cálculo da Taxa a Termo do contrato. Para as Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot, é utilizado o campo "Cotação para Fixing" para a definição da data da cotação da taxa a termo do contrato e a data de cotação para a atualização do valor base (para contratos com "Atualiza Valor Base?" = "Sim"). Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA) Observação: É permitido que os titulares (Parte e Contraparte) do Contrato possam informar a Taxa de Fixação de Termo de Termo antes da data Informada na "Data de Fixação". Isto é, durante o período de Termo, antes do início do contrato. O Contrato deve ter a Fonte de Informação Sisbacen/Feeder.
Cotação para Fixing	Deslocamento aplicado na Data de Fixação para apuração da cotação da moeda para formação da Taxa a Termo. Para contrato "Atualizar Valor Base?" = "Sim", indica o deslocamento a ser aplicado na data informada no campo "Data de Fixação" para captura da cotação final para atualização do valor base.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório quando o campo "Termo de Termo" = "Sim" para as Sisbacen, Sisbacen/Feeder, Feeder, Spot. Para as Bloomberg, Bloomberg/Sisbacen, Banco Central, o campo não pode ser preenchido, mesmo com o "Termo de Termo" = "Sim" Caixa com as opções: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5. Para o cálculo de IOF o sistema considera o campo "Data de Fixação" juntamente com o campo "Cotação para Fixação". Por exemplo: Data de Fixação: 11/dez/15 e Cotação para Fixação: D-3. O IOF é considerado desde o dia 08/dez/15. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Forma de Atualização	Indica a forma de atualização da taxa inicial apurada na data início do contrato.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: "Valor" ou "Percentual".

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Valor/Percentual Negociado	Informar o valor ou percentual negociado para ser aplicado para atualização da taxa inicial na data início do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Aceita números positivos e negativos, mas não pode ser preenchido com 0 (zero). Tipo: Numérico (até 4 inteiros e 8 decimais)
Atualizar Valor Base?	Indica se o valor base do contrato será atualizado no período a termo.	Opcional	Campo com as opções: "Sim" e Vazio. Só é possível indicar "Atualizar Valor Base?" = "Sim" quando o campo "Termo de Termo" = "Sim". Quando o campo "Taxa média para Termo Asiático = Aritmética Ponderada ou Aritmética Média x Média", o campo "Atualizar Valor Base?" deverá ficar vazio. Para mais informações sobre a metodologia de cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas do Termo.
Cotação Inicial	Campo destinado a informar a cotação inicial da paridade que será utilizada para a atualização do valor base no período a termo.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, se "Atualizar Valor Base" = "Sim".
Limites	Informar se o contrato conta com limitador de variação de valorização do contrato.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Superior, Inferior ou Superior/Inferior.
Superior (Paridade)	Paridade máxima aceita pelos participantes para correção do contrato. Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja maior que o valor definido no campo Superior, o sistema utilizará o valor preenchido neste campo para corrigir o contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Tipo: Numérico (até 6 inteiros e 8 decimais)
Inferior (Paridade)	Paridade mínima aceita pelos participantes para correção do contrato. Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja menor que o valor definido no campo Inferior, o sistema utilizará o valor preenchido neste campo para corrigir o contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Tipo: Numérico (até 6 inteiros e 8 decimais)
Prêmio a ser pago pelo	Indicar a Parte que pagará o prêmio na data informada no campo Data de Liquidação, se houver	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.
Valor do Prêmio (R\$)	Informar o valor em reais (R\$) do prêmio total a ser pago na data informada no campo Data de Liquidação.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo "Prêmio a ser pago pelo" for preenchido. Tipo: Numérico (até 14 inteiros e 2 decimais)
Modalidade de Liquidação	Indicar a modalidade de liquidação da operação de prêmio na data	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO

TAXA DE AVALIAÇÃO

AJUSTE DE TAXA

ESTORNO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	informada no campo Data de Liquidação. Operações Mercado x Cliente deverão ser obrigatoriamente na “Sem Modalidade”		“Prêmio a ser pago pelo” for preenchido. Caixa de seleção com as opções: Bilateral, Bruta ou Sem Modalidade.
Data de Liquidação	Indica a data de liquidação do prêmio.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Prêmio a ser pago pelo” for preenchido. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Observação	Campo disponível para preenchimento de alguma informação adicional necessária ao contrato.	Opcional	Tipo Alfanumérico (até 280 caracteres)
Código Identificador	Código de controle interno do participante.	Opcional	Tipo: Numérico (até 14 inteiros)
Data Verificação	Data(s) de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada, aritmética simples ou aritmética média x média. A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de ajustes, vencimento, antecipação informadas aplicando-se o deslocamento indicado.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Taxa Média para Termo Asiático” for preenchido. Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Valor Referência	Valor definido para data de referência, o qual é utilizado no cálculo da taxa média aritmética ponderada. O somatório destes valores deve ser igual ao Valor Base	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Taxa Média para Termo Asiático” for preenchido com = ARITMETICA PONDERADA Tipo: Numérico (até 10 inteiros)

Ao clicar no botão **CONFIRMAR**, o sistema apresenta mensagem abaixo:

Contrato 15J00000908 alterado sob o No. CETIP 2015101413105347

5. TAXA DE AVALIAÇÃO

Esta função é exclusiva para os contratos registrados cuja fonte de informação de taxa de câmbio seja um Feeder, Spot ou Sisbacen/Feeder, independente da moeda

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo MultiClasses > Lançamentos > Taxa de Câmbio para Avaliação

Arquivo:

- Não disponível

Mensageria:

- CTP9015 – Lançamento de PU/FATOR de Contrato de Derivativo

PRAZOS:

- Feeder ou Spot: A partir do registro até vencimento, inclusive
- Sisbacen/Feeder: A partir da data de avaliação (informada no registro) até o vencimento, inclusive.

Caso o contrato seja avaliado até o dia útil anterior ao vencimento, o contrato deve amanhecer resgatado, caso contrário, o sistema gera operação de pendência de taxa de câmbio, sendo permitida a avaliação nesta data.

Caso a taxa de câmbio não seja informada, inclusive no dia do vencimento, até final da grade SEM MODALIDADE (ou até o final da BRUTA, no caso de contratos com mercado), o resgate não será gerado.

Neste caso, o contrato ficará com status VENCIDO NÃO RESGATADO. Para confirmar a atualização é necessária a digitação de ambas as partes envolvidas, exceto quando contrato realizado com cliente próprio, tipo de conta de cliente 1 ou entre contas de cliente 1 de uma mesma instituição, casos em que a digitação deve ser realizada apenas pelo Membro de Mercado titular.

Tela de Filtro de Taxa de Câmbio para Avaliação

Taxa de Câmbio para Avaliação

Nº do Contrato

Pesquisar
Limpar Campos
Desistir

Tela de Detalhe de Taxa de Câmbio para Avaliação

Taxa de Câmbio para Avaliação

Lançamento do Participante (Conta)
Contraparte (Conta)
Nº Controle Interno
Nº do Contrato 23E00430401
Paridade (Moeda Base(Referência)/Moeda Cotada)
Paridade (R\$/Moeda Cotada)

Enviar
Limpar Campos
Voltar
Desistir

Após inserir as cotações das moedas, clique no botão Enviar. Serão exibidos: o **Saldo** (valor a liquidar) e a **Taxa de Câmbio utilizada na avaliação**:

Taxa de Câmbio para Avaliação

Lançamento do Participante (Conta)
Contraparte (Conta)
Nº Controle Interno
Nº do Contrato
Paridade (Moeda Base(Referência)/Moeda Cotada)
Paridade (R\$/Moeda Cotada)

Saldo
Taxa de Câmbio Utilizada na Avaliação

Confirmar
Corrigir
Voltar
Desistir

Observações:

Esta função pode ser utilizada quando a fonte de informação da taxa de câmbio for Sisbacen, no caso em que ocorra a não divulgação tempestiva das taxas de câmbio ou ausência de procedimentos determinados pelo BACEN.

1) As taxas de câmbio que façam referência a cotação de D-1 ou D-2 da data de vencimento do contrato podem ser informadas pelas partes durante a grade de registro de operações para modalidade bilateral.

2) Uma vez informada a taxa de câmbio pelas partes, mesmo que o sistema apure a informação junto a fonte oficial de divulgação prevalecerá a informação registrada. Por outro lado, caso a partir das 11h15m as partes não informem a taxa de câmbio ou apenas uma delas o tenha feito e o sistema apure a mesma junto à fonte oficial, esta é utilizada para atualização do evento.

3) Para contratos registrados sem Cross Rate são solicitadas duas cotações para realizar a avaliação: Moeda Cotada/Moeda Base (Referência) e R\$/Moeda Cotada.

4) Para contratos registrados com Cross Rate é solicitado três cotações para realizar a avaliação: Moeda Cotada/USD ou USD/Moeda Cotada, Moeda Base (Referência) /USD ou USD/Moeda Base (Referência) e R\$/USD.

Informação sobre cálculo da taxa de câmbio para avaliação acesse o Caderno de Fórmulas no site da B3.

Após a confirmação do lançamento, o sistema envia uma mensagem com o número da operação efetuada.

De acordo com a Modalidade do Contrato ou a Fonte de Informação a ser utilizado para a consulta de cotação, o módulo apresenta campos diferentes a serem preenchidos. A descrição dessas diferenças encontra-se no capítulo Introdução ao Termo de Moedas/Conhecendo o Produto ou no capítulo Informações Adicionais/Regras de Registro Conforme Fonte de Informação.

Observação:

Nos casos em que seja necessária confirmação da Contraparte, esta poderá ser feita pelo módulo: Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes.

Todos os lançamentos são obrigatórios quando houver.

Descrição dos Campos da Tela de Detalhe de Taxa de Câmbio para Avaliação

Campo	Descrição	Regras
Lançamento do Participante (Conta)	Código da conta do membro envolvido na operação.	-
Contraparte (Conta)	Código da conta que identifica o membro com quem foi efetuado o contrato.	-

Campo	Descrição	Regras
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.	Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
Nº do Contrato	Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro.	-
Taxa Dólar para Cross Rate	Taxa de câmbio em dólar utilizada para converter as moedas de referência para o Real.	Preencher quando tipo de contrato tiver sido registrado com Cross Rate
Se contrato não possui média asiática		
Se o contrato exibe o campo: - Taxa de câmbio (R\$/Moeda); ou - Paridade (Moeda Base (Referência) /Moeda Cotada); ou - Paridade (USD/Moeda Base (Referência) ou Moeda Base (Referência) /USD)	A taxa de câmbio utilizada para avaliação. Informar quando a fonte de informação para taxa de câmbio no contrato for Feeder ou Spot.	Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais.
Se o contrato exibe o campo: - Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda); ou - Paridade (R\$/Moeda Cotada); ou - Paridade (USD/Moeda Cotada ou Moeda Cotada/USD).	A taxa de câmbio utilizada para avaliação.	Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais.
Se contrato possui média asiática		
Se o contrato com paridade, asiático e com/sem Cross Rate	Os valores para paridade devem ser lançados nos campos complementares em Datas de Verificação.	Este campo não é para ser preenchido.
Se o contrato exibe o campo: - Paridade (USD/Moeda Cotada ou Moeda Cotada/USD); ou - Paridade (R\$/Moeda Cotada).	A taxa de câmbio utilizada para avaliação.	Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais.
Datas de verificação - Dados complementares para contrato com modalidade Termo Asiático		
Data Verificação	Data(s) de referência para apuração da atualização da taxa média aritmética ponderada, aritmética simples ou aritmética média x média.	-
Paridade Informada	Última Taxa informada para avaliação na data de referência.	-

Campo	Descrição	Regras
Paridade (Moeda Base (Referência) /Moeda Cotada)	Taxa utilizada para avaliação na data de referência.	-

6. AJUSTE DE TAXA

Essa função permite ao Participante informar nova taxa do contrato, porém só é possível o Ajuste de Taxa por um Participante ou pai do serviço de digitação deste, se na função “Contrato a Termo de Moedas” ele tenha a indicação de Responsável pelo Ajuste de Taxa.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo MultiClasses > Lançamentos > Ajustar Taxa

Arquivo:

- Não disponível

Mensageria:

- CTP9003 – TERMO – Registro de Contrato de Termo

PRAZOS:

- Entre as datas de ajustes estabelecidas no registro do contrato

O Participante só poderá ajustar a taxa uma única vez. O estorno da operação é permitido somente no dia do lançamento da operação de Ajuste de Taxa.

Os campos da Tela Ajustar Taxa são de preenchimento obrigatório. Após a confirmação da nova taxa a função deve alterar a taxa a termo do contrato.

Tela de Filtro Ajustar Taxa

Ajustar Taxa

Nº do Contrato

Tela de Ajustar Taxa

Ajustar Taxa

Nº do Contrato 21100034412

Comprador (Conta) 05000.00-5

Vendedor (Conta) 05000.10-8

Data de Operação 30/09/2021

Data de Vencimento 07/10/2021

Moeda Base(Referência) USD (220) - DOLAR DOS EUA

Moeda Cotada BRL (790) - REAL

NomeAtributo_Termo21: ValorBase? 100,00

Valor Total Antecipado

Taxa a Termo Atual 5,000000

Taxa a Termo ,

Nº Controle Interno

INFORMAÇÕES ADICIONAIS	CONSULTAS						REGISTRO			
	INTERMEDIAÇÃO	ESTORNO	AJUSTE DE TAXA	TAXA DE AVALIAÇÃO	ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO	CESSÃO	ANTECIPAÇÃO			

7. ESTORNO

O estorno faz com que o contrato volte a situação que tinha anteriormente e ocorre com respectiva digitação de ambas as partes envolvidas na operação.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo MultiClasses > Lançamentos > Estorno

Arquivo:

- Não disponível

Mensageria:

- CTP0100 – TERMO – Cancelamento ou Estorno de Operação

PRAZOS:

- D0 da operação a ser estornada

A interface 'Estorno de Contrato' apresenta um formulário com os seguintes campos:

- Parte (Conta):** Campo de entrada com máscara de três dígitos.
- Contraparte(Conta):** Campo de entrada com máscara de três dígitos.
- Contrato:** Campo de entrada para o número do contrato.
- Posição do Participante:** Menu suspenso para seleção da posição.
- Nº Controle Interno:** Campo de entrada para o número de controle interno.

Na parte inferior direita, há três botões: **Enviar**, **Limpar Campos** e **Desistir**.

Quando a operação é efetuada entre clientes 1 do participante é necessário apenas o lançamento do Membro de Mercado.

O estorno pode ser realizado para as seguintes operações:

Antecipação: O contrato continua a existir, sem a antecipação. Só pode ser efetuada a operação no próprio dia de registro da antecipação, e somente após a atualização do sistema.

Intermediação de contrato: No caso de intermediação o estorno é permitido desde que no mesmo dia do registro; e se o contrato original previr pagamento de prêmio na data, desde que o mesmo não tenha sido ainda liquidado; ou se contrato original registrado entre Participante titular e sua conta de cliente 1 e 2 próprios encontrar-se com status “FINALIZADA”.

Registro de Contrato: Desde que no mesmo dia do registro.

Registro de Contrato com opção de Prêmio: Desde que no mesmo dia do registro. Ao cancelar o registro de contrato a operação de prêmio é automaticamente cancelada. A operação de estorno é permitida se operação de prêmio se encontrar com status: “PENDENTE LIQ. FINANCEIRA”; ou “FINALIZADA”, exclusivamente para contratos registrados entre Participante titular e sua conta de cliente 1 e 2.

Cessão de contrato: Pode ser estornada desde que no mesmo dia do lançamento da Cessão. No caso em que a operação de cessão esteja confirmada por todos os participantes, o estorno deve ser efetuado pela sequência lógica de lançamento dos participantes: 1º Cedente 2º Adquirente e 3º Anuente.

Taxa de câmbio para avaliação: O estorno pode ser comandado no mesmo dia que a taxa de câmbio para avaliação, desde que esta tenha sido registrada no próprio dia do vencimento. As avaliações feitas antes do vencimento podem ser substituídas por outras avaliações sem necessidade de estorno.

Todos os campos são de preenchimento obrigatórios

Campo	Descrição	Regras
Parte (Conta)	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	-
Contraparte (Conta)	Código da conta que identifica o membro que efetuou o contrato.	-
Contrato	Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro do mesmo.	-
Posição do Participante	Indica a posição assumida pelo participante.	Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou Comprador.
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.	Tipo: Numérico (até 10 inteiros)

--	--	--

Após o preenchimento dos dados da tela, o participante deve clicar no botão **Confirmar**, o sistema envia mensagens referente ao lançamento efetuado.

8. INTERMEDIAÇÃO

A intermediação de um contrato é registrada pela digitação de ambas as partes envolvidas, o Intermediador, que promove o encontro das partes interessadas em realizar determinado contrato e, conseqüentemente, recebe o percentual de comissão acordada; e o Participante, quem paga a comissão.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo MultiClasses > Lançamentos > Intermediação do Contrato

Arquivo e Mensageria:

- Não disponível

PRAZOS:

- D0 do registro do contrato

A comissão incide sobre o valor base e o participante pode visualizar o valor a pagar ou a receber na consulta Operações.

Observação: Informação sobre cálculo da comissão de Intermediação acesse o Caderno de Fórmulas no site da B3.

Tela de Intermediação de Contrato

Intermediação de Contrato	
Lançamento do Participante (Conta)	- -
Posição do Participante	
Contraparte(Conta)	- -
Nº Controle Interno	
Contrato	
Comissão(%)	,
Momento do Pagamento	
Liquidante (Conta)	- -
Modalidade de Liquidação	
Enviar Limpar Campos Desistir	

Após a confirmação do lançamento, o sistema envia tela de mensagem informando:

- O número da operação e o número do contrato, quando as duas partes envolvidas na operação efetuaram o lançamento.

Todas as informações da tabela abaixo são de preenchimento obrigatório.

Campo	Descrição
Lançamento do Participante (Conta)	Código da conta do Participante que está efetuando o lançamento da intermediação
Posição do Participante	Indica o papel assumido pelo membro que está efetuando o lançamento da intermediação. Campo com as opções: Intermediador ou Intermediado
Contraparte (Conta)	Código da conta do outro membro envolvido na operação
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Tipo: Numérico (Até 10 inteiros)
Contrato	Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro.
Comissão (%)	Valor percentual que deve ser aplicado sobre o Valor Base Inicial ou Valor Base Final da operação, a ser paga ao intermediador. Tipo: Numérico (Até 2 inteiros e 4 decimais)
Momento do Pagamento	Indica que a comissão deve ser paga no início do contrato. Não é permitido registros de intermediação com liquidação do valor da comissão na data do vencimento do contrato. O pagamento da comissão de intermediação deve ser na data de registro do contrato.
Liquidante (Conta)	Código da conta do Banco Liquidante que deve efetuar a liquidação financeira da operação. Caso o campo não seja preenchido, o sistema assume o Banco Liquidante principal.
Modalidade de Liquidação	Forma de liquidação financeira da operação.

9. CONSULTAS

Exibe os contratos efetuados pelo participante, com as operações geradas e respectivas datas de vencimento e de registro.

FORMAS DE CONSULTAS

Tela:

Características dos Contratos:

- Termo > Termo MultiClasses > Consulta

Tela de Consulta de Contrato

Consulta Contratos	
Comprador (Nome Simplificado)	
Comprador (Razão Social)	
Tipo de Conta Comprador	v
Comprador (Conta)	
Vendedor (Nome Simplificado)	
Vendedor (Razão Social)	
Tipo de Conta Vendedor	v
Vendedor (Conta)	
Situação	v
Fonte de Informação	v
Contrato	
Contrato(Original)	
Tipo Instrumento Financeiro	v
Tipo	v
Data de Operação	
Data de Registro	
Data de Vencimento	

9.1 Características dos Contratos

Na tabela abaixo se encontram os campos e descrição onde pelo menos um deles necessita de preenchimento.

Campo	Descrição
Comprador (Nome simplificado)	Nome simplificado que identifica, no ambiente da B3, o participante envolvido na operação.
Comprador (Razão Social)	Razão Social do participante envolvido na operação.
Comprador (Conta)	Número da conta do Comprador na B3.
Vendedor (Nome simplificado)	Nome simplificado que identifica o outro membro envolvido na operação no ambiente da B3.
Vendedor (Razão Social)	Razão Social do outro membro envolvido na operação.
Vendedor (Conta)	Número da conta do Vendedor na B3.
Contrato	Número atribuído ao contrato quando efetuado o registro dele.
Contrato (Original)	Número atribuído ao contrato quando efetuado uma operação de cessão.
Data de Operação	Data em que o participante contratou a operação.
Data de Registro	Data da efetivação do contrato.
Data de Vencimento	Data na qual o contrato vence.

Ao clicar no botão PESQUISAR, é apresentada tela de relação.

Na tela seguinte, a primeira coluna (Contrato) identifica o número do contrato. Ao ser selecionado, exibe as características do contrato.

Os números dos contratos são exibidos com *link* que, quando acionado, exibe tela de detalhe com as principais características do contrato.

Seguem abaixo a descrição das informações que podem ser consultadas:

Observação:

Quando a Taxa Forward de um contrato é alterada (através da função Ajustar Taxa), o campo **taxa ajustada em**, apresenta data em que a taxa foi ajustada.

9.2. Consulta de Operações

Exibe os contratos efetuados pelo participante, com as operações geradas e respectivas datas de vencimento e de registro.

FORMAS DE CONSULTAS

Tela:

Operações:

- Operações > Consultas > Operações

Tela de Consulta de Operações

Participante (Nome Simplificado):	
Participante (Razão Social):	
Participante (Conta):	- -
Tipo de Conta Participante:	
Contraparte (Nome Simplificado):	
Contraparte (Razão Social):	
Contraparte (Conta):	- -
Tipo de Conta Contraparte:	
Tipo Operação:	
Tipo de Título:	
Instr. Financeiro:	
Código IF Anterior:	
Sistema:	
Modalidade de Liquidação:	
Situação da Operação:	
Data de Liquidação:	/ /
Data de Origem:	/ /
Número Operação:	
Número de Controle Operação:	
Liquidante Participante (Nome Simplificado):	
Liquidante Participante (Razão Social):	
NuOp :	
Liquidante Contraparte (Nome Simplificado):	
Liquidante Contraparte (Razão Social):	
Operações da Grade Bruta Flexibilizada:	
Horário Inicial:	-
Horário Final:	-
Formato do Arquivo:	
Pesquisar Limpar Campos	

9.2 Consulta de Operações

Ao clicar no botão PESQUISAR, é apresentada tela de relação.

Na tela seguinte, a primeira coluna (Contrato) identifica o número do contrato. Ao ser selecionado, exibe as características do contrato

Seguem abaixo a descrição das informações que podem ser consultadas:

Código da Operação	Nome da Operação	Situação do Contrato (Status da Operação)	Descrição
1	REGISTRO	CONFIRMADO	MxC: Quando é realizado o registro de forma completa MxM: Quando uma das pontas realiza a operação, aguarda o lançamento da Contraparte
		PENDENTE DE LANÇAMENTO: CONTRAPARTE	MxM: Aguardando o Lançamento da operação da Contraparte (ou a Confirmação)
		PENDENTE TAXA	Quando um contrato a termo é registro, fica aguardando a cotação ser inputada
14	ANTECIPACAO	ANTECIPAÇÃO TOTAL	O contrato foi antecipado totalmente à D0, encerrando assim o contrato
		ANTECIPAÇÃO PARCIAL	Parte do Contrato foi antecipado à D0, e uma parte do seu Valor Base ainda continua ativo, porém reduzido
15	ATUALIZACAO_TAXA	CONFIRMADO	Após ter a taxa atualizada, o status de contrato passa a ser CONFIRMADO
16	PENDENTE_CAMBIO	PENDENTE DE CÂMBIO	Quando o contrato possui como Fonte de Informação Feeder, Spot ou Sisbacen/Feeder, o contrato permanece nessa Situação até que seja inputada um valor de Câmbio
20	CESSAO CONTRATO	CONFIRMADO	
21	CONFIRMACAO CESSAO CONTRATO	CEDIDO	Após a cessão, o contrato permanece com a situação de confirmado
69	PAGAMENTO DE PRÊMIO	CONFIRMADO	Após o pagamento do prêmio, o contrato passa a estar confirmado
81	INTERMEDIACAO_CONTRATO	CONFIRMADO	MxM: Se ambas as partes já realizam o lançamento do contrato no sistema
96	ALTERACAO COM APROVAÇÃO B3	ALTERADO	Contrato alterado com aprovação da B3

98	ALTERACAO DE CONTRATO P/ CETIP	PENDENTE APROVAÇÃO B3	Quando o contrato é alterado após D+4 do registro, o contrato permanece nesse status até 3 dias úteis (período de aprovação/rejeição da B3)
99	ALTERACAO DE CONTRATO	ALTERADO	Contrato alterado pelo Participantes em até D+3 do Registro
114	ESTORNO_ANTECIPACAO	FINALIZADO	Estorno foi realizado com sucesso
115	ESTORNO ATUALIZACAO TAXA	FINALIZADO	Estorno foi realizado com sucesso
120	CANC. CESSAO CONTRATO	CONFIRMADO	
121	CANC. CONFIRMADO CESSAO	CONFIRMADO	
181	ESTORNO_INTERMEDIACAO_CONTRATO	CONFIRMADO	
467	INCLUSÃO RESP. ACELERAÇÃO DE CONTRATO	CONFIRMADO	
469	ALTERAÇÃO RESP. ACELERAÇÃO DO CONTRATO	CONFIRMADO	
470	CONF. ALTERÇÃO RESP. ACELERAÇÃO CONTRATO	CONFIRMADO	
472	CONF. EXCLUSÃO RESP. ACELERAÇÃO DO CONTRATO	CONFIRMADO	
497	CONF. INC. REDUTOR RISCO CRÉDITO EXTRAORDINÁRIO	CONFIRMADO	
498	ALTERAÇÃO DATA REDUTOR RISCO CRÉDITO	CONFIRMADO	
702	AJUSTE DE TAXA	CONFIRMADO	
869	PAGAMENTO DE PRÊMIO - CESSAO DE CONTRATO	CEDIDO	A operação de prêmio somente é gerada após lançamento da operação de confirmação da cessão pelo Anuente.
903	REGISTRO NAO PAGAMENTO DE EVENTO	CONFIRMADO	
1461	CANC. INCLUSÃO AGENTE CÁLCULO	CONFIRMADO	
1462	CANC. CONF. INCLUSÃO AGENTE CÁLCULO	CONFIRMADO	
1465	CANC. EXCLUSÃO AGENTE CÁLCULO	CONFIRMADO	A alteração ou a exclusão do Agente de Cálculo e/ou das Cláusulas de Aceleração tem efeito somente no dia útil seguinte ao da solicitação
1468	CANC. CONF. INCLUSÃO RESP. ACELERAÇÃO CONTRATO	CONFIRMADO	A alteração ou a exclusão do Participante Responsável pela Aceleração tem efeito

			somente no dia útil seguinte ao da solicitação.
1470	CANC. CONF. ALTERAÇÃO RESP. ACELERAÇÃO CONTRATO	CONFIRMADO	A alteração ou a exclusão do Participante Responsável pela Aceleração tem efeito somente no dia útil seguinte ao da solicitação.
1505	CANC. ALTERACAO PARAMETROS REDUTOR RISCO CREDITO	CONFIRMADO	
1869	CANC. PAG. PRÊMIO - CESSAO DE CONTRATO	CONFIRMADO	
6114	ESTORNO AGENDAMENTO DA ANTECIPAÇÃO	CONFIRMADO	

REGISTRO
ANTECIPAÇÃO
CESSÃO
ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO
TAXA DE AVALIAÇÃO
AJUSTE DE TAXA
ESTORNO
INTERMEDIAÇÃO
CONSULTAS
INFORMAÇÕES ADICIONAIS

10. Informações Adicionais

10.1 Ativos disponíveis e cadastro de novos ativos

Os ativos disponíveis para utilização nos módulos de Termo de Moedas sem Contraparte Central Garantidora podem ser consultados no arquivo público AAAAMMDD_Indexadores_Termo, disponível em:

1) <ftp://ftp.cetip.com.br/Public> ou:

2) Sistema NoMe > Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos

Solicitações para inclusão de novos indexadores podem ser feitas através do e-mail: op.derivativos@b3.com.br

10.2 Arquivos

É possível consultar o layout dos arquivos no seguinte caminho:

- b3.com.br > Regulação > Estrutura normativa > Manuais de Operações > Manuais Operacionais - Balcão B3 > Enviar Arquivos
- b3.com.br > Regulação > Estrutura normativa > Manuais de Operações > Manuais Operacionais - Balcão B3 > Receber Arquivos

10.3 Consulta de Arquivos e Relatórios

Para baixar os arquivos e relatórios, o Participante deve seguir o caminho abaixo:

Transf.de Arquivo > Arquivo > Receber Relatórios

Ao preencher o número do malote e clicar em pesquisar, o Participante de Registro poderá encontrar os seguintes relatórios e arquivos:

Notas:

As notas demonstram com detalhes os parâmetros das operações realizadas nos contratos. Elas são disponibilizadas em D+1 do lançamento/liquidação da respectiva operação lançada pelos participantes. Os tipos de notas disponíveis atualmente são:

- Nota de Registro;
- Nota de Antecipação;
- Nota de Vencimento.

Todas as notas são geradas no formato PDF e agrupadas pelo cliente final do participante. Dessa forma, será disponibilizado um arquivo diferente para cada cliente do Participante e para as operações próprias.

O nome do arquivo PDF é composto pela seguinte estrutura (MALOTE_DATA_CNPJ_TIPO DA NOTA_NOME DO PARTICIPANTE_TER).

10.4 Prazos:

Código da Operação	Nome da Operação	Prazo
1	REGISTRO	• D0 para Operações Conta 00 x Conta 00 • D0 para operações Conta 00 x Conta 10 ou 20
14	ANTECIPACAO	A partir de D+1 da data do registro até D-1 do vencimento
15	ATUALIZACAO_TAXA	A partir da data acordada no registro até D-1 do Vencimento
16	PENDENTE_CAMBIO	D0 do Vencimento
69	PAGAMENTO DE PRÊMIO	D0 do registro até Vencimento (inclusive)
81	INTERMEDIACAO_CONTRATO	D0 do Registro
96	ALTERACAO COM APROVAÇÃO B3	D+4 do Registro
98	ALTERACAO DE CONTRATO P/ CETIP	D+4 do Registro

99	ALTERACAO DE CONTRATO	MxC: D0 até D+3, a partir de D+4 passa por aprovação da B3 MxM: D0 até D+3, a partir de D+4 não é permitido, somente por meio do atendimento operacional de Derivativos de Balcão
114	ESTORNO_ANTECIPACAO	D0 da antecipação
115	ESTORNO ATUALIZACAO TAXA	D0 da atualização da taxa
XXX	ESTORNO AJUSTE DE TAXA	D0 da alteração da taxa
120	CANC. CESSAO CONTRATO	D0 da operação
181	ESTORNO_INTERMEDIACAO_CONTRATO	D0 da Intermediação do Contrato
467	INCLUSÃO RESP. ACELERAÇÃO DE CONTRATO	D0 do registro até D-1 do Vencimento
469	ALTERAÇÃO RESP. ACELERAÇÃO DO CONTRATO	""D0 da alteração até D-2 do Vencimento""
470	CONF. ALTERÇÃO RESP. ACELERAÇÃO CONTRATO	D0 do registro até D-1du do vencimento
472	CONF. EXCLUSÃO RESP. ACELERAÇÃO DO CONTRATO	D0 do registro até D-1du do vencimento
497	CONF. INC. REDUTOR RISCO CRÉDITO EXTRAORDINÁRIO	D0 do registro
498	ALTERAÇÃO DATA REDUTOR RISCO CRÉDITO	D0 do registro até D-1 do Vencimento
702	AJUSTE DE TAXA	Se contrato a termo: D+1 da data de fixação; Se não contrato Termo: D+1 do registro
869	PAGAMENTO DE PRÊMIO - CESSAO DE CONTRATO	D0 da Cessão
903	REGISTRO NAO PAGAMENTO DE EVENTO	
1461	CANC. INCLUSÃO AGENTE CÁLCULO	D0 da operação
1462	CANC. CONF. INCLUSÃO AGENTE CÁLCULO	D0 da operação
1465	CANC. EXCLUSÃO AGENTE CÁLCULO	D0 da operação
1468	CANC. CONF. INCLUSÃO RESP. ACELERAÇÃO CONTRATO	D0 da operação
1470	CANC. CONF. ALTERAÇÃO RESP. ACELERAÇÃO CONTRATO	D0 da operação
1505	CANC. ALTERACAO PARAMETROS REDUTOR RISCO CRÉDITO	D0 da operação

1869	CANC. PAG. PRÊMIO - CESSAO DE CONTRATO	D0 da operação
6114	ESTORNO AGENDAMENTO DA ANTECIPAÇÃO	D0 do agendamento da antecipação

10.5 Serviços Complementares

É possível consultar os manuais no seguinte caminho:

Netting

- b3.com.br > Regulação > Estrutura normativa > Manuais de Operações > Manuais Operacionais - Balcão B3 > Contrato de Netting

DRRC

- b3.com.br > Produtos e Serviços > Registro > Mitigadores de Risco > Mitigadores de Risco de Crédito

CONTATOS:

Produtos:

Telefone: (11) 2565 - 5966/5950/5936/4861/6078/6389

Email: derivativos@b3.com.br

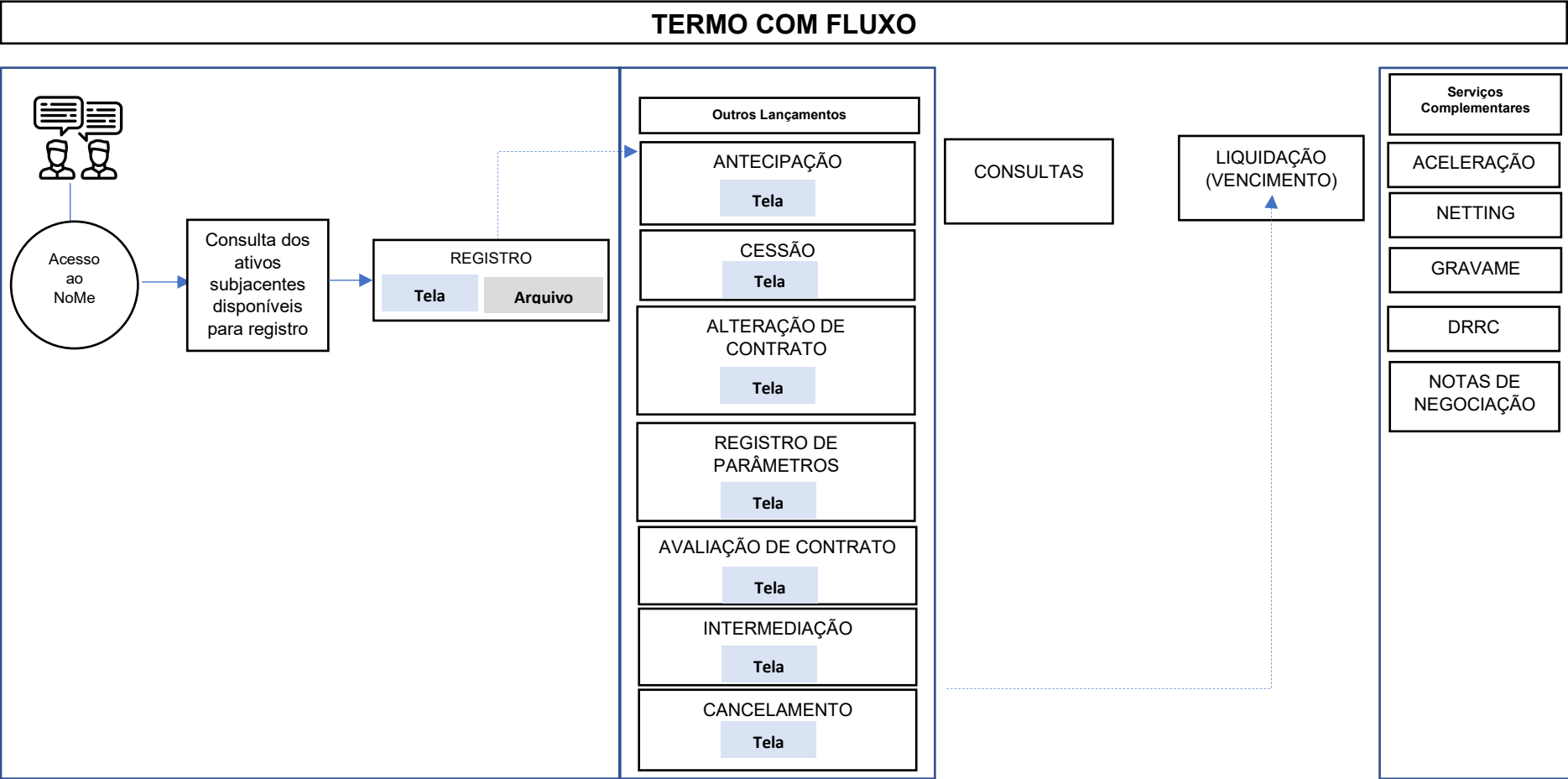
Operações:

Telefone: (11) 2565 - 5044

Certificação: homologacaobalcao@b3.com.br

Produção: op.derivativosbalcao@b3.com.br

JORNADA DO PRODUTO



1. REGISTRO

Esta função permite o registro de Termo com Fluxo e possibilita a limitação dos ajustes positivos e negativos pelo comprador ou vendedor bem como a inclusão de alavancagem variáveis nos diversos fluxos.

O TARF é composto por uma série de vencimentos inter-relacionados e à medida que esses vencimentos vão ocorrendo, caso a soma dos ajustes pagos exceda determinado nível (CAP) os vencimentos remanescentes deixam de existir, ou seja, implicará na extinção automática do Contrato a Termo.

Descrição dos Campos da Tela de Registro

Registro de Termo de Moedas com Fluxo

Parte (Conta)	05000 00 5	Boletim	PTAX800 de Fechamento
Posição do Participante	COMPRADOR	Taxa a Termo	ÚNICO
CPF/CNPJ Cliente Participante		Pagamento de Prêmio	
Contraparte(Conta)	05000 10 8	Prêmio a ser pago pelo	
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	012.345.678-90	Tipo de CAP	
Adesão ao Contrato	SEM ADESAO	CAP Global Vendedor	
Nº Controle Interno	413	CAP Global Comprador	
Valor Base (Referência)	2000000	Alavancagem	
Data de Início	30 9 2021	Limites	
Data de Vencimento	19 10 2021	Quantidade de Eventos	2
Moeda Base(Referência)	USD (220) - DOLAR DOS EUA	Fonte de Informação	SISBACEN
Moeda Cotada	BRL (790) - REAL	Observação	

Enviar Limpar Campos Desistir

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo com Fluxo > Lançamentos > Registro de Termo de Moedas com Fluxo

Arquivo:

Manual de Operações > Enviar Arquivos

- 4.11.5 – Registro de Contrato / Parâmetro / Fluxo
- 4.11.6 – Registro de Contrato

FUNCIONALIDADES

• Limitador

- Inferior;
- Superior; e/ou
- Inferior e Superior

• CAP Gloal

PRAZOS: Conta 00 x Conta 00 – O registro deve ser realizado em D0 da contratação

Conta 00 x Conta 10 ou 20 – É permitido o registro somente em D0 da contratação do derivativo

A liquidação financeira do contrato será realizada na modalidade Bilateral e nos casos em que esta não esteja mais disponível, será na modalidade Bruta. As operações realizadas entre o Participante e contas de seus Clientes (1 ou 2), ou aquelas com financeiro igual a zero, são geradas na modalidade Sem Modalidade.

Obs.: Deve ser entendido como um TARF, o registro que possuir qualquer um dos campos abaixo preenchidos:

- CAP Global Comprador,
- CAP Global Vendedor,

Caso contrário os contratos deverão ser considerados como Termos com Fluxos.

Descrição dos Campos da Tela de Registro

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Lançamento do Participante (Conta)	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Posição do participante	Indica a posição assumida pelo participante.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou comprador
CPF/CNPJ Cliente Participante		Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
Contraparte (Conta)	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Adesão ao Contrato	Indica se o contrato registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos ("CGD"), com as opções "Sim" e "Não"	Condicional	Obrigatório, quando disponível essa opção
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	-	Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)

Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento indicado pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.	Obrigatório	Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
Valor Base (Referência)	Valor base ou quantidade do contrato expresso na moeda de referência. Quando casas decimais não preenchidas, o sistema preenche com zeros	Obrigatório	Tipo: Numérico (limite de 14 inteiros e 2 decimais)
Data de Início	Data de início do contrato, se contrato registrado à vista. Indica a data de início do fluxo de termos	Obrigatório	Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato.	Obrigatório	A data de vencimento do contrato pode ser indicada em feriados, porém não pode ser indicado um final de semana. Caso o ajuste caia em dia não útil, o sistema irá gerar o ajuste para o próximo dia útil conhecido. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Fonte de Informação	Indica a fonte a ser utilizada para a cotação de fixing para vencimento. A fonte de informação é utilizada nos eventos de Resgate (vencimento) do contrato e também quando indicado Termo a Termo.	Obrigatório	Caixa com a opção "SISBACEN"
Moeda Base (Referência)	Indica a moeda objeto do contrato a termo.	Obrigatório	
Moeda Cotada	Indica a moeda de referência em que a Moeda Base é cotada, para apuração da atualização do contrato	Condicional	No Termo com Fluxo deverá ser obrigatoriamente BRL (Real).
Boletim	Deverá ser informado qual o Boletim de fechamento de cotação da moeda.	Obrigatório	Campo as opções: 18h00 - Fechamento.

Taxa a Termo

Taxa a Termo	Informa se o contrato terá seu início em data futura.	Opcional	Caixa com as opções "ÚNICO" e "VARIÁVEL"
---------------------	---	----------	--

Prêmio			
Prêmio a ser pago pelo	Indicar a Parte que pagará o prêmio na data informada no campo Data de Liquidação, se houver	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.
Pagamento de Prêmio	Informar o valor em reais (R\$) do prêmio total a ser pago no campo Data de Liquidação, se houver.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo "Prêmio a ser pago pelo" for preenchido. Tipo: Numérico (até 10 inteiros e 2 decimais)
Tipo de CAP	indica o somatório de créditos que o vendedor ou comprador receberá	Opcional	Caixa com as opções "EXATO" e "INCLUSIVE". A opção "Exato" indica o somatório de créditos que o vendedor ou comprador receberá deverá ser igual ao valor indicado no campo "CAP Global". A opção "INCLUSIVE" indica o somatório de créditos que o vendedor ou comprador receberá poderá ser inclusive o último evento de crédito a disparar o TARNOUT.
CAP Global Vendedor	Indica o valor Máximo (exclusive) de créditos que o Vendedor receberá sem disparar o TARNOUT	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver e o valor será expresso em reais. Tipo: Numérico (limite de 14 inteiros e 2 decimais)
CAP Global Comprador	Indica o valor Máximo (exclusive) de créditos que o comprador receberá sem disparar o TARNOUT.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver e o valor será expresso em reais. Tipo: Numérico (limite de 14 inteiros e 2 decimais)
Alavancagem		Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa com as opções "ÚNICO" e "VARIÁVEL"
Limites	Esta taxa é utilizada na apuração do resultado do contrato	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa com as opções "ÚNICO" e "VARIÁVEL"
Quantidade de Eventos	Indica as quantidades de eventos do Termo	Obrigatório	Tipo: Numérico (limite de 3 inteiros)

Após clicar no botão **Enviar**, o sistema apresenta a tela para confirmar os dados.

Registro de Termo de Moedas com Fluxo	
Parte (Conta) 05000.00-5	Boletim PTAX800 de Fechamento
Posição do Participante COMPRADOR	Taxa a Termo ÚNICO
CPF/CNPJ Cliente Participante	Pagamento de Prêmio
Contraparte(Conta) 05000.10-8	Prêmio a ser pago pelo
CPF/CNPJ Cliente Contraparte 012.345.678-90	Tipo de CAP
Adesão ao Contrato SEM ADESAO	CAP Global Vendedor
Nº Controle Interno 413	CAP Global Comprador
Valor Base (Referência) 2.000.000,00	Alavancagem
Data de Início 30/09/2021	Limites
Data de Vencimento 19/10/2021	Quantidade de Eventos 2
Moeda Base(Referência) USD (220) - DOLAR DOS EUA	Fonte de Informação SISBACEN
Moeda Cotada BRL (790) - REAL	Observação
Confirmar Corrigir Desistir	

Após clicar o botão **Confirmar**, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Registro de Termo de Moedas com Fluxo	
Contrato 21100034421 registrado sob o No. CETIP 2021093010233043	
Clique em 'PROSSEGUIR' para informar os fluxos de eventos	
Prosseguir Desistir	

Após clicar no botão **Prosseguir**, o sistema apresenta a tela para Registro da Agenda de Eventos.

Registro da Agenda de Eventos											
Conta											
Lançamento do Participante (Conta)						CPF/CNPJ Cliente Contraparte					
05000.00-5						012.345.678-90					
Contraparte(Conta)											
05000.10-8											
Código IF											
21100034416											
Valor Base (Referência)						Data de Início					
1.000.000,00						30/09/2021					
Data de Vencimento						Posição do Participante					
19/10/2021						COMPRADOR					
Meu Número						Meu Número (Oper Original)					
5379						9877					
Dados do Evento											
Data	Data de Cotação	Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior	Limite Superior	Amortização	Fator Alavancagem Comprador	Fator Alavancagem Vendedor				
07/10/2021	06/10/2021	5,10	4,90	5,20	30	1,5	1,0				
19/10/2021	18/10/2021	5,12	4,92	5,22	70	1,0	1,5				
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir											

Descrição dos campos da tela de Registro da Agenda de Eventos

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu número	Número de identificação do lançamento indicado pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.	Obrigatório	Tipo: Numérico (10 inteiros)
Valor da Taxa a Termo	Valor da taxa contratada. Esta taxa é utilizada na apuração do resultado do contrato	Condicional	Obrigatório caso preenchido campo "Taxa a Termo" Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.
Data	Indica data do evento. É a data em que ocorrerá a liquidação financeira de valor de referência ou redução do valor base.	Obrigatório	Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data de Cotação	Data da cotação que será utilizada para liquidação do evento.	Obrigatório	Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Limite Inferior	Paridade máxima aceita pelos participantes para correção do contrato. Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja maior que o valor definido no campo Superior, o sistema utilizará o valor preenchido neste campo para corrigir o contrato.	Condicional	Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.
Limite Superior	Paridade mínima aceita pelos participantes para correção do contrato. Caso a Paridade apurada entre as moedas informadas seja menor que o valor definido no campo Inferior, o sistema utilizará o valor preenchido neste campo para corrigir o contrato.	Condicional	Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.
Fator Alavancagem Comprador		Condicional	Obrigatório caso tenha preenchido o campo "Alavancagem" Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais.
Fator Alavancagem Vendedor		Condicional	Obrigatório caso tenha preenchido o campo "Alavancagem" Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais.
Amortização		Obrigatório	Informado com até 3 (três) inteiros e 5 (cinco) decimais.

Após clicar no botão **Enviar**, o sistema apresenta a tela para confirmar os dados.

Registro da Agenda de Eventos

Conta

Lançamento do Participante (Conta)
05000.00-5

Contraparte(Conta)
05000.10-8

Código IF
21100034416

Valor Base (Referência)
1.000.000,00

Data de Vencimento
19/10/2021

Meu Número
5379

CPF/CNPJ Cliente Contraparte
012.345.678-90

Data de Início
30/09/2021

Posição do Participante
COMPRADOR

Meu Número (Oper Original)
9877

Dados do Evento

Data	Data de Cotação	Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior	Limite Superior	Amortização	Fator Alavancagem Comprador	Fator Alavancagem Vendedor
07/10/2021	06/10/2021	5,10000000	4,90000000	5,20000000	30,00000	1,50000000	1,00000000
Data	Data de Cotação	Valor da Taxa a Termo	Limite Inferior	Limite Superior	Amortização	Fator Alavancagem Comprador	Fator Alavancagem Vendedor
19/10/2021	18/10/2021	5,12000000	4,92000000	5,22000000	70,00000	1,00000000	1,50000000

Confirmar

Corrigir

Voltar

Desistir

Após clicar o botão **Confirmar**, o sistema apresenta a mensagem abaixo.



2. INTERMEDIAÇÃO

Esta função permite a intermediação de um contrato de Termo com Fluxo, em que o intermediador promove o encontro de da comissão acordado.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo com Fluxo > Lançamentos > Intermediação do Contrato

Arquivo e Mensageria

- Não disponível

PRAZOS:

- D0 do registro do contrato

Obs: Clientes 1 e 2 não podem ser intermediadores de contrato.

Tela Intermediação de Contrato

Intermediação de Contrato			
Parte (Conta)	. .	Posição do Participante	
Contraparte(Conta)	. .	Nº Controle Interno	
Contrato		Comissão(%)	,
Momento do Pagamento		Liquidante (Conta)	. .
Modalidade de Liquidação BRUTA			
Confirmar		Limpar Campos	Desistir

Descrição dos Campos da Tela Intermediação de Contrato

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte Conta	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Posição do Participante	Indica a posição assumida pelo participante.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou comprador
Código IF	Código do Instrumento Financeiro	Obrigatório	Exemplo: AAMXXXXXXXXX
Contraparte (Conta)	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Número Controle Interno	Número de identificação do lançamento indicado pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.	Obrigatório	Tipo: Numérico (10 inteiros)
Contrato	Código do Instrumento Financeiro	Obrigatório	Exemplo: AAMXXXXXXXXX
Comissão (%)	Valor a ser pago ao intermediador.	Obrigatório	Informado com até 2 (dois) inteiros e 4 (quatro) decimais.
Momento do Pagamento	A comissão do valor deve ser paga sempre no início do contrato.	Obrigatório	Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Liquidante (Conta)	Código da conta do Banco Liquidante que deve efetuar a liquidação financeira da operação.	Condicional	Caso o campo não seja preenchido, o sistema assume o Banco Liquidante principal.

INTERMEDIÇÃO

CESSÃO

ANTECIPAÇÃO

REGISTRO DE PARÂMETROS

ALTERAÇÃO

LANÇAMENTO DE TAXA DE CâMBIO

CANCELAMENTO

3. CESSÃO

Funcionalidade disponível para realizar a transferência de titularidade de uma das partes do derivativo a um terceiro, desde que com anuência da contraparte e mediante pagamento de financeiro.

A cessão poderá ocorrer entre a data de registro até a data anterior ao vencimento do contrato, sempre pelo valor total.

A cessão de contrato pode ser entre conta Participante e cliente 1 para conta cliente 2 do mesmo participante, que possuam o mesmo CPF ou CNPJ.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo com Fluxo > Lançamentos > Cessão do Contrato

Arquivo e Mensageria

- Não disponível

PRAZOS:

- D0 do registro do contrato até D-1 do vencimento

Tela Cessão de Contrato

A interface de usuário para a Cessão de Contrato é exibida no navegador. No topo, há uma barra de navegação com o caminho: > Termo > Termo com Fluxo > Cessão de Contrato. Abaixo, o formulário é dividido em duas colunas. A primeira coluna contém os campos: 'Parte (Conta)' (com máscara de CPF/CNPJ), 'Contraparte(Conta)' (com máscara de CPF/CNPJ), 'Nº Controle Interno' e 'Valor do Prêmio' (com máscara de valor monetário). A segunda coluna contém: 'Posição do Participante' (menu suspenso), 'CPF/CNPJ (Adquirente)' (campo de texto), 'Contrato' (campo de texto) e 'Titular do Prêmio' (menu suspenso). Na base do formulário, há três botões: 'Enviar', 'Limpar Campos' e 'Desistir'.

Descrição dos Campos da Tela Cessão de Contrato

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte Conta	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Posição do Participante	Indica a posição assumida pelo participante.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou comprador
Código IF	Código do Instrumento Financeiro	Obrigatório	Exemplo: AAMXXXXXXXXX
Contraparte (Conta)	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
CPF/CNPJ (Adquirente)	O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes.
Número Controle Interno	Número de identificação do lançamento indicado pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.	Obrigatório	Tipo: Numérico (10 inteiros)
Contrato	Código do Contrato envolvido na operação	Obrigatório	Exemplo: AAMXXXXXXXXX
Valor do Prêmio	Valor do prêmio a ser pago, não necessitando ser o mesmo valor pago na operação original.	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 10 (dez) inteiros e 2 (dois) decimais.
Titular do Prêmio	Indica quem pagará o prêmio.	Obrigatório	Preenchimento obrigatório caso haja o pagamento do prêmio.

INTERMEDIÇÃO

CESSÃO

ANTECIPAÇÃO

REGISTRO DE PARÂMETROS

ALTERAÇÃO

LANÇAMENTO DE TAXA DE CÂMBIO

CANCELAMENTO

4. ANTECIPAÇÃO

Para o TARF será solicitado o Valor Financeiro da Antecipação e no caso do Termo com Fluxo será solicitado a Taxa a Termo e Taxa de Juros. No caso de TARF o contrato será reduzido com base no Valor Base a Antecipar informado em relação ao Valor base Remanescente do contrato.

Para Termo com Fluxo a antecipação é calculada pela diferença financeira entre o valor da paridade utilizada para a reversão e a paridade a termo pactuada no registro do contrato, descontada pela taxa de juros de descapitalização.

Tela:

- Termo > Termo com Fluxo > Lançamentos > Antecipação de Contrato

Arquivo

- 4.11.3. ANTECIPACAO TERFLUXO – Antecipação de Notional de Termo de Moedas com Fluxo

Mensageria:

- Não disponível

PRAZOS:

- D0 do registro do contrato até D-1 do vencimento

Tela Antecipação de Contrato de Termo com Fluxo e TARF

Antecipação de Contrato

Parte (Conta)

Posição do Participante

Código IF

Descrição dos Campos da Tela Antecipação de Contrato de Termo com Fluxo e TARF

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte (Conta)	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Posição do Participante	Indica a posição assumida pelo participante.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou comprador
Código IF	Código do Instrumento Financeiro	Obrigatório	Exemplo: AAMXXXXXXXXX

Tela Detalhe

Antecipação de Contrato

Código IF 21100034416

N° Controle Interno 4267

Valor Base a Antecipar 100000,00

Data Antecipação 21/07/2021

Liquidante (Conta) 05790,00-7

Confirmar Limpar Campos Voltar Desistir

Descrição dos Campos da Tela Detalhe de Antecipação de Contrato

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Número Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.	Obrigatório	Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
Valor Base a Antecipar	É valor que se deseja antecipar. Pode representar parte ou a totalidade do valor base registrado no contrato ou do saldo remanescente.	Obrigatório	Observações: Quando contrato Asiático com média ponderada este campo deve ser preenchido com valor igual à soma dos valores a antecipar informado em cada data de verificação Tipo: Numérico (até 14 inteiros e 2 decimais)
Data Antecipação	Este campo deve ser preenchido quando se deseja efetuar uma	Condicional	Obrigatório, quando existir.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	Antecipação Retroativa com conta de cliente 1..		Deve ser preenchido em no máximo D-2 útil anterior à data do sistema
Liquidante (Conta)	Código da conta do Banco Liquidante que deve efetuar a liquidação financeira da operação.	Opcional	Caso o campo não seja preenchido, o sistema assume o Banco Liquidante principal.

Após Confirmar, o sistema apresenta a tela abaixo.

Antecipação Termo com Fluxo

Data 07/10/2021	Valor a Antecipar	50000	,		Paridade Antecipação	5	,	20	Taxa de Juros (%)	0	,	44
Data 19/10/2021	Valor a Antecipar	50000	,		Paridade Antecipação	5	,	30	Taxa de Juros (%)	0	,	31

Confirmar
Limpar Campos
Voltar
Desistir

Na antecipação do termo com fluxo, o sistema permite a definição do valor base antecipado para cada fluxo de forma independente, além de permitir também o informe da taxa forward e da taxa de juros.

Descrição dos Campos da Tela Adicional Detalhe de Antecipação de Contrato

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Valor a Antecipar	É valor que se deseja antecipar. Pode representar parte ou a totalidade do valor base registrado no contrato ou do saldo remanescente.	Condicional	Observações: Quando contrato Asiático com média ponderada este campo deve ser preenchido com valor igual à soma dos valores a antecipar informado em cada data de verificação (dados complementares). Tipo: Numérico (até 12 inteiros e 8 decimais)
Paridade Antecipação	A taxa de câmbio utilizada para cálculo da antecipação, caso o ativo tenha moeda cotada diferente de BRL (790) - Real	Condicional	Obrigatório, quando existir. Informado com até 5 (cinco) inteiros e 8 (oito) decimais.
Taxa de Juros	A função permite a antecipação de contrato de Termo onde a taxa de juros indicada pode assumir valor positivo, negativo ou nulo. Expressa em % ao ano, para 252 dias úteis com tratamento exponencial.	Condicional	Informado com até 3 (três) inteiros e 4 (quatro) decimais.

Após Confirmar, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Contrato 14G00001091 antecipado sob o No. CETIP 2014071114299434

Tela exemplo antecipação de TARF

Antecipação TARF

Valor Financeiro da Antecipação

,

Credor da Antecipação

▼

Confirmar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Descrição dos Campos da Tela exemplo antecipação de TARF

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Valor Financeiro da Antecipação	Este campo corresponde ao resultado.	Obrigatório	Informado com até 12 (doze) inteiros e 2 (dois) decimais.
Credor da Antecipação	Código da conta que identifica o membro com quem foi efetuada a operação	Obrigatório	

Após Confirmar, o sistema apresenta a mensagem abaixo.

Contrato 14G00001094 antecipado sob o No. CETIP 2014071114299449

5. REGISTRO DE PARÂMETROS

Nesta função, é possível registrar os parâmetros do Termo com Fluxo após a realização do Registro do Contrato.

Tela:

- Termo > Termo com Fluxo > Lançamentos > Registro de Parâmetros

Arquivo

- 4.11.8 – Registro de Parâmetro / Fluxo

Mensageria:

- Não disponível

PRAZOS:

- D0 do registro do contrato

Tela Registro de Parâmetros

Registro de Parâmetros

Parte (Conta)

-

-

Contraparte(Conta)

-

-

Posição do Participante

Código IF

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Descrição dos Campos da Tela Registro de Parâmetros

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte Conta	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Posição do Participante	Indica a posição assumida pelo participante.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou comprador
Contraparte (Conta)	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Código IF	Código do Instrumento Financeiro	Obrigatório	Exemplo: AAMXXXXXXXXX

Após preenchimento de todos os dados e avançar para a próxima tela, será aberta a possibilidade do preenchimento da quantidade de eventos informada no contrato de Termo com Fluxo na tela de Registro de Agenda de Eventos. Em nosso exemplo, há cinco datas de Fluxo.

Tela Registro de Agenda de Eventos

Registro da Agenda de Eventos

Conta

Lançamento do Participante (Conta)
05000.00-5
Contraparte(Conta)
05000.10-8
Código IF
21L00000806
Valor Base (Referência)
1.000.000,00
Data de Vencimento
17/12/2021
Meu Número

CPF/CNPJ Cliente Contraparte
012.345.678-90
Data de Início
03/12/2021
Posição do Participante
COMPRADOR
Meu Número (Oper Original)
527

Parâmetros

Valor da Taxa a Termo
 ,
Limite Inferior Limite Superior Fator Alavancagem Comprador Fator Alavancagem Vendedor

Dados do Evento

Data
/ /
Data
/ /
Data
/ /
Data
/ /

Data de Cotação
/ /
Data de Cotação
/ /
Data de Cotação
/ /
Data de Cotação
/ /

Amortização
 ,
Amortização
 ,
Amortização
 ,
Amortização
 ,

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Descrição dos campos da tela de Registro da Agenda de Eventos

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu número	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.	Obrigatório	Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
Taxa a Termo	Valor da taxa contratada entre comprador e vendedor para realização da amortização.	Obrigatório	Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.
Data	Indica data do evento. É a data em que ocorrerá a liquidação financeira de valor de referência ou redução do valor base.	Obrigatório	Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data de Cotação	Data da cotação que será utilizada para liquidação do evento.	Obrigatório	Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Amortização	É valor que se deseja amortizar.	Obrigatório	Informado com até 3 (três) inteiros e 5 (cinco) decimais.

Após clicar no botão **Enviar**, o sistema apresenta a tela para confirmar os dados.

6. ALTERAÇÃO

Função disponível para que o Comprador ou Vendedor possa alterar o contrato.

Tela:

- Termo > Termo com Fluxo > Lançamentos > Alteração de Contrato

Arquivo e Mensageria

- Não disponível

PRAZOS: D0 do registro do contrato

Tela Filtro de Alteração de Contrato

Alteração de Contrato

Código IF

21L00000727

Posição do Participante

COMPRADOR ▼

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Tela de Alteração de Contrato de Termo com Fluxo e TARF

Alteração de Termo de Moedas com Fluxo

Código IF

21L00000727

Parte (Conta)

05000.00-5

Boletim

PTAX800 de Fechamento ▼

Posição do Participante

COMPRADOR

Taxa a Termo

ÚNICO ▼

CPF/CNPJ Cliente Participante

Contraparte(Conta)

05000.10-8

Pagamento de Prêmio

Prêmio a ser pago pelo

CPF/CNPJ Cliente Contraparte

012.345.678-90

Tipo de CAP

EXATO

Adesão ao Contrato

SEM ADESAO

CAP Global Vendedor

198000000

Nº Controle Interno

CAP Global Comprador

Valor Base (Referência)

1000000

Alavancagem

ÚNICO ▼

Data de Início

2

12

2021

Limites

▼

Data de Vencimento

9

12

2021

Quantidade de Eventos

1

Moeda Base(Referência)

USD (220) - DOLAR DOS EUA ▼

Fonte de Informação

SISBACEN ▼

Moeda Cotada

BRL (790) - REAL ▼

Observação

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Descrição dos campos da tela de Alteração de Contrato de Termo com Fluxo e TARF

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cotação para o vencimento	Indica a data de cotação para o Vencimento.	Obrigatório	Lista pré-definida: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5
Boletim	Deverá ser informado qual o Boletim de fechamento de cotação da moeda.	Obrigatório	Campo a opção: 18h00 - Fechamento.
Taxa a Termo	Informa se o contrato terá seu início em data futura.	Obrigatório	Caixa com as opções "ÚNICO" e "VARIÁVEL"
Número controle interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.	Obrigatório	Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
CAP Global Vendedor	Indica o valor Máximo (exclusive) de créditos que o Vendedor receberá sem disparar o TARNOUT	Obrigatório	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Tipo: Numérico (limite de 14 inteiros e 2 decimais)
Valor Base (Referência)	Valor base do contrato expresso em quantidades da moeda de referência.	Obrigatório	Informado com até 12 (doze) inteiros e 2 (dois) decimais.
Alavancagem		Obrigatório	Caixa com as opções "ÚNICO" e "VARIÁVEL"
Limites	Esta taxa é utilizada na apuração do resultado do contrato	Obrigatório	Caixa com as opções: "Único" e "Variável"
Data início	Indica a data de início do fluxo de termos	Obrigatório	Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data vencimento	Data de vencimento do contrato. Livmente pactuada entre os participantes.	Obrigatório	Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Moeda base referência	Indica a moeda objeto do contrato a termo.	Obrigatório	
Moeda cotada	Indica a moeda de referência para apuração da atualização do contrato.	Obrigatório	
Fonte de informação	Indica a fonte utilizada para cotação da moeda.	Obrigatório	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Observação	Campo destinado ao complemento da descrição do contrato.	Obrigatório	Campo com possibilidade de alteração. Texto livre com até 280 caracteres.

7. LANÇAMENTO DE TAXA DE CÂMBIO

Esta função possibilita informar a cotação para os casos em que a Fonte de Informação não divulgar a cotação necessária para o cálculo do Ajuste. Na data no evento, caso a fonte de informação não divulgar a cotação, o evento deverá ficar pendente de lançamento de taxa de câmbio até que o participante efetue o lançamento da mesma.

Tela:

- Termo > Termo com Fluxo > Lançamento de Taxa de Câmbio para Ajuste

Arquivo e Mensageria

- Não disponível

PRAZOS:

- D0 da data de evento

Tela de Lançamento de Taxa de Câmbio para Ajuste

Lançamento de Taxa de Câmbio

Parte (Conta)

Contraparte(Conta)

Posição do Participante

▼

Código IF

Nº Controle Interno

Taxa de Câmbio

,

Enviar

Limpar Campos

Desistir

Descrição dos campos da Tela de Lançamento de Taxa de Câmbio para Ajuste

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte Conta	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Campo com possibilidade de alteração. Campo com possibilidade de alteração. Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Posição do Participante	Indica a posição assumida pelo participante.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou comprador
Contraparte (Conta)	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Campo com possibilidade de alteração. Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Código IF	Código do Instrumento Financeiro	Obrigatório	Campo com possibilidade de alteração. Exemplo: AAMXXXXXXXX
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.	Obrigatório	Campo com possibilidade de alteração. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Informado com até 10 (dez) inteiros.
Taxa de Câmbio	Taxa de câmbio utilizada.	Obrigatório	Campo com possibilidade de alteração. Informado com até 10 (dez) inteiros e 8 (oito) decimais.

8.CANCELAMENTO

Esta função possibilita o cancelamento de Contrato de Termo com Fluxo.

Tela:

- Termo > Termo com Fluxo > Cancelamento de Contrato

Arquivo e Mensageria

- Não disponível

PRAZOS:

- D0 do registro

Tela de Lançamento de Cancelamento de Contrato

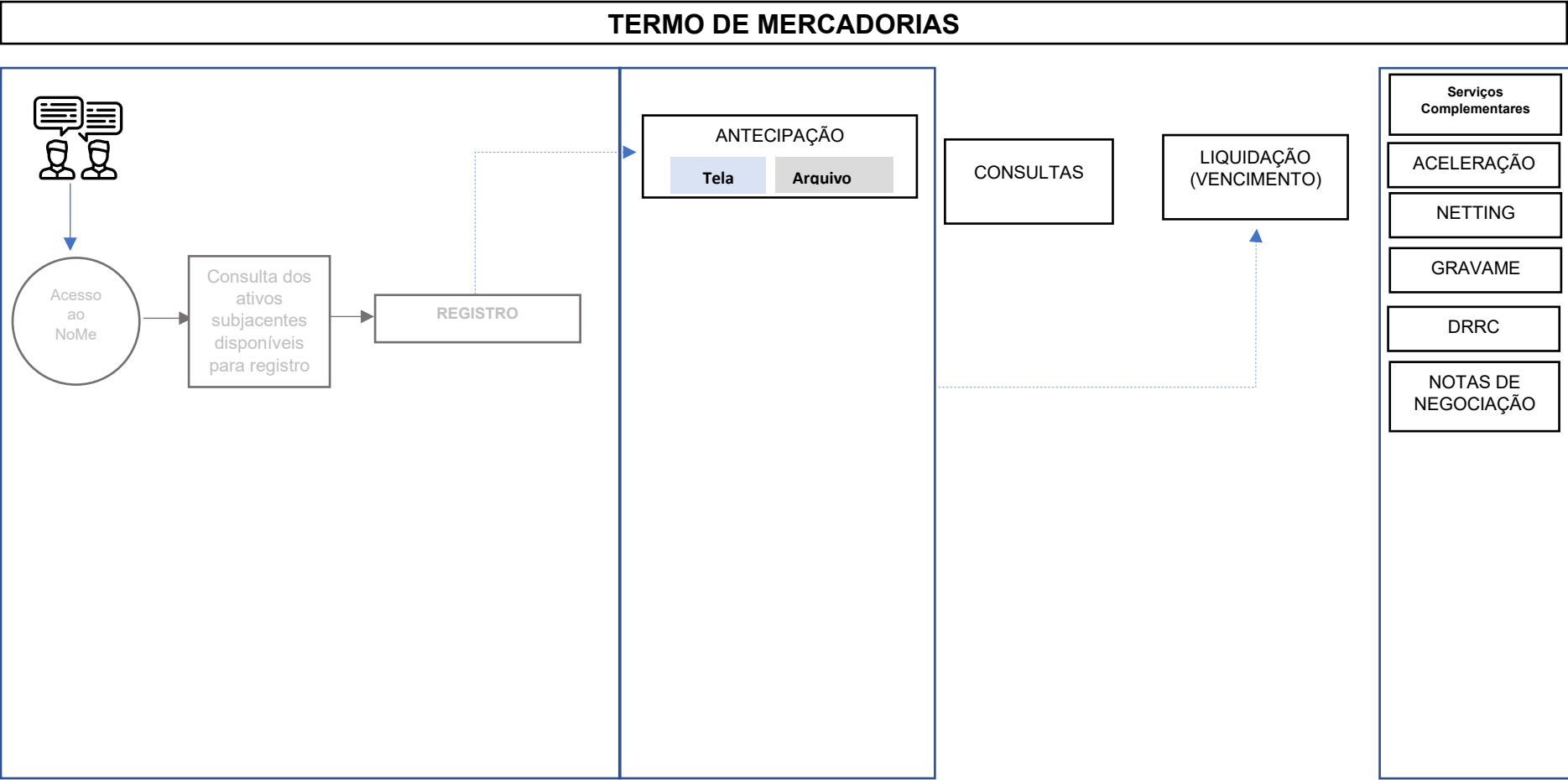
A interface de cancelamento de contrato apresenta uma barra de navegação superior com o caminho: > Termo > Termo com Fluxo > Cancelamento de Contrato. Abaixo, há um formulário com o título "Cancelamento de Contrato". O formulário contém os seguintes campos: "Parte (Conta)" com uma máscara de entrada de três dígitos separados por pontos; "Contraparte(Conta)" com uma máscara de entrada de três dígitos separados por pontos; "Posição do Participante" com uma lista suspensa; "Código IF" com um campo de texto; e "Nº Controle Interno" com um campo de texto. Na base do formulário, há três botões: "Enviar", "Limpar Campos" e "Desistir".

Descrição dos Campos da Tela Cancelamento de Contrato

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte Conta	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Campo com possibilidade de alteração. Campo com possibilidade de alteração. Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Posição do Participante	Indica a posição assumida pelo participante.	Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: Vendedor ou comprador
Contraparte (Conta)	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Campo com possibilidade de alteração. Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Código IF	Código do Instrumento Financeiro	Obrigatório	Campo com possibilidade de alteração. Exemplo: AAMXXXXXXXX
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.	Obrigatório	Campo com possibilidade de alteração. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Informado com até 10 (dez) inteiros.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se confirmado o cancelamento, retorna à tela da área de serviços, informando que a operação de cancelamento foi realizada.

JORNADA DO PRODUTO



INFORMAÇÕES ADICIONAIS	CONSULTAS	ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO DO CONTRATO	ALTERAÇÃO E EXCLUSÃO DE LANÇAMENTO	CONFIRMAÇÃO DE CESSÃO DE CONTRATO	CESSÃO	INTERMEDIAÇÃO	ANTECIPAÇÃO	ESTORNO	REGISTRO
---------------------------	-----------	--	--	--------------------------------------	--------	---------------	-------------	---------	----------

1. ANTECIPAÇÃO

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

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

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

- Termo > Termo de Mercadoria > Lançamentos > Antecipação de Contrato

Arquivo:

[Manual de Operações](#) > Enviar Arquivos

- 4.10.2 – Termo de Mercadorias – Antecipação

Mensageria

- Não disponível

PRAZOS:

- A partir de D+1 da data do registro até D-1 do vencimento do contrato.

Obs: Esta 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 B3.

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 B3.

Tela de Filtro de Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato

Nº do Contrato:

Confirmar

Limpar Campos

Tela Detalhe de Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato

Lançamento do Participante (Conta):

Contraparte (Conta):

Cesta Garantia Comprador :

Cesta Garantia Vendedor :

Nº Controle Interno:

Contrato:

F21H29368

Quantidade:

Data Antecipação:

29

/

09

/

2021

Preço de Antecipação:

Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada):

Fator de Desconto:

Liquidante (Conta):

Confirmar

Limpar Campos

Nos contratos que envolvam clientes é permitido o lançamento somente se o contrato tiver sido previamente identificado.

Quando a antecipação for para um contrato de modalidade Asiático com média ponderada é permitida a antecipação não linear, onde o participante determina quanto deve ser antecipado de cada valor de referência.

Em casos de antecipação de contrato com limitadores, as cotações informadas pelos Participantes serão utilizadas como base para apuração do valor financeiro da operação, sem realizar o corte da paridade.

Não é permitida antecipação de contrato caso tenha sido realizada avaliação em data igual ou posterior a data de avaliação prevista no registro de contrato.

Observação: A liquidação financeira da antecipação de um contrato é gerada na modalidade BILATERAL e, nos casos em que esta não esteja mais disponível, na modalidade BRUTA. As operações realizadas entre o Participante e seus Clientes 1 ou 2, ou aquelas com financeiro igual a zero, são exclusivamente geradas na modalidade SEM MODALIDADE.

Observação: Informação sobre cálculo da liquidação antecipada acesse o **Caderno de Fórmulas** no *site* da B3.

Após informação do nº do contrato que se deseja antecipar é apresentada Tela de Detalhe.

De acordo com a modalidade do contrato e a Fonte de Informação utilizada para a consulta de cotação, o módulo apresenta campos diferentes a serem preenchidos.

Contratos de Termos de Moeda com Agenda de Redutor de Risco de Crédito

1) O registro de antecipação total de contrato gera antecipação de agenda de redutor de risco de crédito com liquidação financeira do saldo pela mesma modalidade de liquidação da operação do contrato original.

2) As antecipações parciais não gerarão operações de antecipação de agenda de redutor de risco de crédito, as antecipações parciais ocorridas no contrato original deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

Campos da Tela Detalhe de Antecipação de Contrato

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Lançamento do Participante (Conta)	Código da conta do membro envolvido na operação.	Obrigatório	-
Contraparte (Conta)	Código da conta que identifica o membro com quem foi efetuado o contrato.	Obrigatório	-
Cesta Garantia Comprador	Informa o código da cesta de garantia indicada pelo comprador.	Obrigatório (quando houver)	-
Cesta Garantia Vendedor	Informa o código da cesta de garantia indicada pelo vendedor.	Obrigatório (quando houver)	-

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Número Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos.	Obrigatório	Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.
Contrato	Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro	Obrigatório	
Quantidade	Quantidade a ser antecipada	Obrigatório	Tipo: Numérico (até 16 inteiros)
Data Antecipação	Este campo deve ser preenchido quando se deseja efetuar uma Antecipação Retroativa com cliente (conta 10 ou 20).	Obrigatório	Pode ser preenchido em no máximo D-2 útil anterior a data do sistema.
Preço de Antecipação	Preço de ajuste da mercadoria, por unidade de negociação do contrato, informado pelo participante.	Obrigatório	Tipo: numérico (até 16 caracteres, da forma que desejar)
Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada)	Indica a cotação da moeda utilizada para o cálculo da antecipação.	Obrigatório	Tipo: Numérico (4 inteiros e 8 decimais)
Fator de Desconto	Deverá ser informado o fator de juros utilizado para o cálculo do valor financeiro da antecipação*. *Para mais informações sobre a metodologia de cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas do Termo de Mercadoria.	Obrigatório	Tipo: numérico (até 3 inteiros e 8 decimais)
Liquidante (Conta)	Código da conta do Banco Liquidante que fará a liquidação financeira da operação.	Opcional	Caso o campo não seja preenchido, o sistema assumirá o Banco Liquidante Principal.
Datas de verificação - Dados complementares para contrato com modalidade Termo Asiático com média ponderada – Campos de preenchimento obrigatório.			
Data	Data(s) de referência para apuração da atualização da Taxa Média Aritmética Ponderada .	Obrigatório (quando houver)	-
Valor Referência	Valor definido para data de referência, o qual deve ser utilizado no cálculo da Média Aritmética Ponderada .	Obrigatório (quando houver)	Tipo: Numérico (14 inteiros e 8 decimais)
Valor a Antecipar	Valor a antecipar do Valor Referência indicado.	Obrigatório (quando houver)	Tipo: Numérico (14 inteiros e 8 decimais)

Após a confirmação do lançamento da antecipação, o sistema envia mensagem informando:

- O número do lançamento, quando apenas uma das partes efetuou o registro da antecipação e o contrato é entre Membros de Mercado;
- O número da operação realizada, o código do contrato e o valor financeiro calculado a receber, quando efetuado o lançamento da antecipação.

Conforme mensagem a seguir.

Atualização da Versão

1.1. Termo Sem CCP

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
14/04/2025	22/04/2026	Inclusão de novo tipo de Média Asiática	Inclusão de um novo domínio no cálculo de Média Asiática: "Aritmética Média x Média".
14/04/2025	13/02/2026	Lançamento Termo MultiClasses - Registro de Contrato	Alteração do prazo de registro de D+2 para D0.
14/04/2025	12/12/2025	Lançamentos Termo MultiClasses – Cessão de Contrato	Ajuste na descrição do prazo, passando a constar "a partir de D0 da data do registro até D-1 da data de fixação do contrato".
14/04/2025	30/10/2025	Lançamentos Alteração – Termo MultiClasses	Ajuste no quadro referente aos prazos possíveis para alteração, de acordo com a nova redação: D0 até D+3 e "A partir de D+4 até D-5 do vencimento".
14/04/2025	09/10/2025	Termo MultiClasses – Lançamentos – Alteração e Exclusão	Ajuste nos prazos referentes as alterações que serão realizadas nos contratos.
14/04/2025	16/04/2025	Termo Multiclasses – Lançamentos – Alteração e Exclusão	Ajuste na regra referente a alteração e exclusão de contratos de clientes, esclarecendo que as operações a partir de D+4, podem ser realizadas até D-5 da data de vencimento do contrato mediante a devida justificativa.
14/04/2025	14/04/2025	Taxa de Câmbio para Avaliação	Disponibilização dos campos: Saldo e Taxa de Câmbio Utilizada na Avaliação, conforme divulgado no Comunicado Externo 006/2025-VPC.
09/10/2023	30/01/2025	Lançamentos – Estorno	Ajuste nos campos "Parte", "Contrato", "Posição do Participante", "Nº Controle Interno" com as respectivas descrições.
09/10/2023	21/01/2025	Commodities	Ajuste na descrição do campo "Data de fixing do Ativo Subjacente" no sentido de refletir que a data de fixing para commodities deve ser menor que a data de vencimento.
09/10/2023	08/01/2025	Termo Multiclasses	Ajuste na descrição do campo "Taxa a Termo" ressaltando que o preenchimento será numérico (4 inteiros e 6 decimais).
09/10/2023	07/11/2024	Termo Multiclasses	Ajuste na descrição do campo "Cotação para o Vencimento" referente a característica – Termo Multiclasses excluindo o preenchimento obrigatório para as fontes Feeder e Spot.
09/10/2023	12/04/2024	Commodities	Ajuste na descrição do campo "Data de fixing do Ativo Subjacente" no sentido de refletir que a data deve ser maior que a data de início e menor ou igual que a data de vencimento do contrato.
09/10/2023	14/03/2024	Termo MultiClasses – Alteração e Exclusão	Ajuste na descrição das Alterações e Exclusões do Termo MultiClasses. Inclusão dos prazos de alteração e exclusão nas regras gerais do módulo.
09/10/2023	09/10/2023	Ajuste de Menus	Ajuste na descrição dos Menus do produto Termo no sistema NoMe, conforme divulgado no comunicado externo 041/2023-VPC.
28/08/2023	12/09/2023	Cessão de Contrato	Ajustes na descrição da funcionalidade "Cessão de Contrato".
28/08/2023	28/08/2023	Termo MultiClasses – inclusão das funcionalidades: "Taxa a Termo em Reais" e "Prêmio em Moeda Estrangeira"	Inclusão das funcionalidades para o Termo MultiClasses permitindo a indicação de Taxa a Termo em Reais e Prêmio em Moeda Estrangeira, conforme divulgado no comunicado 031/2023-VCP

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
24/04/2023	25/07/2023	Termo Sem CCP	Novo Manual visando a unificação dos manuais Termo 21 (Termo Sem CCP) e Termo de Mercadorias.
24/04/2023	24/04/2023	Contrato a Termo	Flexibilização do módulo Termo 21 (Termo sem CCP) para abranger outras classes de ativos subjacentes além de "Taxas de Câmbio". Assim como, possibilidade em registrar, contratos de Termo de classes de ativos como "Commodities", utilizando as funcionalidades existentes conforme divulgado no comunicado 008/2023-VPC.
13/02/2023	13/02/2023	Antecipação	Atualização da informação sobre o prazo para lançamento da antecipação, que poderá ser feita no mesmo dia do registro do contrato, conforme divulgado no comunicado 001/2023-VPC.
05/12/2022	12/12/2022	Contrato a Termo de Moedas	Inclusão da possibilidade de registrar contratos com <i>fixing</i> de D0 do vencimento de forma calculada pelo sistema, conforme divulgado no comunicado 090/2022-VPC.
05/12/2022	05/12/2022	Alteração de Contrato	Atualização das informações sobre alteração de contrato a partir de D+3 do registro, conforme divulgado no comunicado 090/2022-VPC.
05/12/2022	05/12/2022	Contrato a Termo de Moedas	Possibilidade de registrar contratos com vencimento em feriados locais, de modo que a liquidação ocorra no dia útil subsequente, conforme divulgado no comunicado 084/2022-VPC.
05/12/2022	05/12/2022	Contrato a Termo de Moedas	Inclusão de informações sobre "Valor/Percentual Negociado" no tópico de Termo a Termo e ajuste na descrição de campos no tópico de "Fonte de Informação" inseridos na seção 3.1
08/08/2022	08/08/2022	Novas fontes de informação Bloomberg e Bloomberg/Sisbacen	Atualização das informações relativas ao registro de Termo de Moeda, com a inclusão das novas fontes (Bloomberg e Bloomberg/Sisbacen) e novos campos, conforme divulgado no comunicado 046/2022-VPC.
14/03/2022	14/03/2022	Contrato a Termo de Moedas	Atualização do Campo Cotação - Paridade (Moeda/USD ou USD Moeda).
20/09/2021	17/01/2022	Contrato a Termo de Moedas	Ajustes nas observações referente à Consulta de Arquivos e Relatórios.
20/09/2021	18/10/2021	Contratos de Termo de Moedas	Atualização de termos obsoletos do manual em aderência aos OC 005-2021 PRE, OC 022-2021 PRE, OC 109-2020 PRE quando se aplicar.
28/06/2021	28/06/2021	Contrato a Termo de Moedas	Permitir que o campo "Contrato Global" seja deixado em branco no momento de registro do contrato.
28/06/2021	28/06/2021	Antecipação	Inclusão do campo "Valor Financeiro" na Tela de confirmação do lançamento da Antecipação.
10/05/2021	10/05/2021	Contrato a Termo de Moedas	Permitir que Data(s) de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada ou aritmética simples, sejam lançadas com datas menores do que a data de início do contrato, conforme divulgado no comunicado 001/2021-VPC.
10/05/2021	10/05/2021	Contrato a Termo de Moedas	Possibilitar que o Participante indique, no momento do lançamento da Antecipação parcial ou total do contrato de Termo de Moeda, que a liquidação do financeiro da antecipação seja em D0 ou D+1 (indicando a data no novo campo "Data Liquidação"), conforme divulgado no comunicado 002/2021-VPC.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
10/05/2021	10/05/2021	Contrato a Termo de Moedas	Disponibilização de Notas de Antecipação, em formato PDF, para Termo de Moeda sem CCP no malote dos participantes e via Conecta, conforme divulgado no comunicado 009/2021-VPC.
28/09/2020	28/09/2020	Contrato a Termo de Moedas	Inclusão dos campos “Atualizar Valor Base?”, “Cotação Inicial” e “Valor Base Original” para atualização do Valor Base replicando o efeito de “travar” o notional na moeda cotada, conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC.
28/09/2020	28/09/2020	Termo com Fluxo	Antecipação: Alteração de decimais dos campos “Valor Base a Antecipar” e “Valor a Antecipar” de 12 (doze) inteiros e 2 (dois) decimais para 12 (doze) inteiros e 8 (dois) decimais, conforme divulgado no comunicado 031/2020-VPC.
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.
25/11/2019	15/04/2020	Contrato a Termo de Moedas	Ajuste nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
25/11/2019	25/11/2019	Alteração e Exclusão de Contrato	Inclusão do campo “Data de Liquidação” na Tela de Registro do Contrato a Termo de Moedas, conforme divulgado no Comunicado 030/2019-VPC.
25/11/2019	25/11/2019	Lançamentos	Inclusão do campo “Data de Liquidação” na Tela de Registro do Contrato a Termo de Moedas, conforme divulgado no Comunicado 030/2019-VPC.
26/11/2018	26/11/2018	Moedas Negociadas	Inclusão da Moeda Colón Costarriquenho conforme o comunicado 014/2018 – VPC e 020/2018 – VPC.
29/05/2017	04/04/2018	Contrato a Termo de Moedas	Melhoria da descrição do campo “Contrato Global”
29/05/2017	29/01/2018	Contrato a Termo de Moedas	Melhoria nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
29/05/2017	19/09/2017	Contrato a Termo de Moedas	Melhoria da descrição do campo “Taxa Termo”
29/05/2017	29/05/2017	Contrato a Termo de Moedas	Alteração na regra de preenchimento do campo “Taxa a Termo”, conforme comunicado 024/17.
21/11/2016	27/04/2017	Contrato a Termo de Moedas	Melhoria na descrição dos campos Limites, Superior (Paridade) e inferior (Paridade).
21/11/2016	07/04/2017	Contrato a Termo de Moedas	Alteração na descrição dos campos Cotação – Taxa de Câmbio (R\$/Cotada ou R\$/USD) e Cotação – Paridade (Moeda/USD ou USD/Moeda).
21/11/2016	22/12/2016	Glossário	Inclusão do arquivo Glossário.
21/11/2016	22/12/2016	Informações Adicionais	Inclusão dos arquivos “Cruzamento de Funcionalidades, Regras de Registro Conforme Fonte de Informação, Regras de Negócios, Cross Rate, Moedas Negociadas”.
21/11/2016	21/11/2016	Contrato a Termo de Moedas	Inclusão do campo “Cotação para Fixing”. Conforme comunicado 075/16.
29/08/2016	27/09/2016	Formação dos Códigos do Instrumento Financeiro	Atualização da informação.
29/08/2016	23/09/2016	Termo com Fluxo	Inclusão do módulo.
29/08/2016	29/08/2016	Cessão de Contrato	Inclusão da observação 3).

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
23/11/2016	22/07/2016	Todo o manual	Inclusão de quantidade de números inteiros e decimais nos campos.
23/11/2016	22/06/2016	Informações Adicionais	Inclusão do item.
23/11/2016	26/04/2016	Contrato a Termo de Moedas Alteração e Exclusão de Contrato	Alteração na descrição do campo “Fonte de Informação”.
23/11/2016	07/04/2016	Antecipação	Inclusão do campo “Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada)”.
23/11/2015	06/04/2015	Alteração e Exclusão do Contrato	Alteração nas descrições dos campos: CPF/CNPJ da Parte e Contraparte.
23/11/2015	11/03/2016	Contrato a Termo de Moedas Alteração e Exclusão de Contrato	Melhoria no texto da descrição do campo “Fonte de Informação”.
23/11/2015	23/11/2015	-	Criação do manual.

1.2. Termo de Mercadorias

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
10/10/2022	19/01/2024	Cessão	Ajuste no campo “Titular do Prêmio” no sentido de indicar a ponta que receberá o prêmio, se houver.
10/10/2022	21/12/2023	Registro Estorno Intermediação	Exclusão dos itens considerando nova estrutura do sistema.
10/10/2022	25/07/2023	Descontinuação do Manual	A partir da publicação do Manual Termo Sem CCP o manual Termo de Mercadorias será descontinuado devido ao agrupamento dos manuais.
10/10/2022	19/04/2023	Alteração e Exclusão de Contratos	Ajuste da informação sobre o campo “Posição do Participante”.
10/10/2022	28/11/2022	Lançamentos	Inclusão sobre abrangência de datas para “Data da Cotação Inicial” e “Data de Fixing”. Exclusão do termo “Triggers” na descrição de “Taxa a Termo em Reais?”
10/10/2022	16/11/2022	Lançamentos	Inclusão da informação de coleta de ambas mercadorias e moedas nas datas da média asiática.
10/10/2022	16/11/2022	Contratos a Termo de Mercadoria (Commodities)	Inclusão de informação de limites de datas para a média asiática.
10/10/2022	10/10/2022	Registro de Contrato a Termo de Mercadorias (Commodities) Alteração e Exclusão de Contrato Antecipação de Contrato Agenda de Eventos Informações Adicionais	Ajustes no prazo da alteração de contrato, nova consulta de eventos e demais ajustes relacionados as implementações da versão, conforme divulgado no comunicado 067/2022 - VPC.
08/08/2022	08/08/2022	Ajuste no preço da operação, deslocamento da mercadoria e moeda e regras da média asiática	Ajuste no preço da operação para possibilitar informar até 8 casas decimais, possibilidade do deslocamento da moeda e da mercadoria até D-45 e ajustes nas regras da indicação das datas da média asiática, conforme divulgado no comunicado 046/2022-VPC.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
13/12/2021	13/12/2021	Ajuste da Taxa a Termo	Possibilidade de ter o ajuste automático da Taxa a Termo por IPCA, conforme divulgado nos comunicados 051/2021-VPC e 060/2021-VPC.
20/09/2021	18/10/2021	Contratos de Termo de Mercadoria (Commodities)	Atualização de termos obsoletos do manual em aderência aos OC 005-2021 PRE, OC 022-2021 PRE, OC 109-2020 PRE quando se aplicar. Exclusão do item “3.3 Taxa de Câmbio para Avaliação”
10/05/2021	10/05/2021	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Permitir que Data(s) de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada ou aritmética simples, sejam lançadas com datas menores do que a data de início do contrato, conforme divulgado no comunicado 001/2021-VPC.
28/09/2020	28/09/2020	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Inclusão de pagamento de prêmio para Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities), conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC.
28/09/2020	28/09/2020	Antecipação de Contrato	Inclusão de um Fator de Desconto para fazer o cálculo da Antecipação, conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC
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 021/2020-VPC.
17/02/2020	15/04/2020	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Ajuste nas observações do Termo de Mercadoria referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
17/02/2020	17/02/2020	Termo de Índices	Exclusão das informações referente a Termo de Índices, conforme divulgado no Ofício Circular 005/2020-PRE
01/07/2019	18/11/2019	Informações Adicionais – Termo de Mercadoria	Alteração de informações.
01/07/2019	18/11/2019	Contratos entre Clientes	Alteração na descrição do campo “Data de Avaliação”
01/07/2019	18/11/2019	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Alteração na descrição do campo “Data Ajuste”
01/07/2019	14/10/2019	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Alteração na descrição dos campos “Taxa a Termo em Reais?” “Preço da Operação” e “Moeda”.
01/07/2019	09/08/2019	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Alteração na descrição do campo “Taxas a Termo em Reais?”
01/07/2019	01/07/2019	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Inclusão do Termo de Commodities (cotado em outras moedas) convertido em Reais
11/09/2017	29/01/2018	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Melhoria nas observações do Termo de Mercadoria referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
11/09/2017	19/12/2017	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Melhoria nas descrições dos campos “Data de Cotação para Ajuste” e “Cotação de Moeda para o Vencimento”.
11/09/2017	08/12/2017	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Melhoria nas descrições dos campos “Data de Cotação para Ajuste”, “Data Ajuste” e “Qtd. Referência”.
11/09/2017	11/09/2017	Contratos	Inclusão dos campos “Tipo Sistema Origem” e “Código Sistema Origem”, alteração da tela Filtro e Relação.
21/11/2016	09/03/2017	Moedas Negociadas	Exclusão do arquivo.
21/11/2016	09/03/2017	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities) Registro de Contrato a Termo de Índice	Alteração da descrição do campo Observação.
21/11/2016	02/02/2017	Contrato	Exclusão do arquivo.
21/11/2016	02/02/2017	Ativos Subjacentes Disponíveis	Inclusão do arquivo.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
21/11/2016	02/02/2017	Conhecendo o Produto Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Alteração de informações.
21/11/2016	26/12/2016	Conhecendo o Produto	Alteração da observação do Termo com Agenda de Redutor de Risco Crédito
21/11/2016	21/11/2016	Cessão de Contrato	O sistema permite a realização de uma nova cessão apenas se o status da operação “20 – CESSÃO DE CONTRATO” for igual a “Finalizada” ou “Cancelada”.
29/08/2016	27/09/2016	Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros	Retirada da informação referente ao TCF.
29/08/2016	29/08/2016	Cessão de Contrato	Inclusão da observação na Visão Geral.
22/08/2016	22/08/2016	Termo de Moedas	Migração dos contratos de Termo de Moeda para o ambiente Cetip21, conforme mencionado nos Comunicados Cetip nº070/16 e nº045/16.
21/03/2016	12/08/2016	Registro de Contrato a Termo de Índice	Inclusão da opção INDICE SELIC no campo Índice.
21/03/2016	25/07/2016	Todo o manual	Inclusão da quantidade de números inteiros e decimais nos campos necessários.
21/03/2016	22/06/2016	Informações Adicionais	Inclusão do item: Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros.
21/03/2016	26/04/2016	Contrato Contrato a Termo de Moedas Contrato entre Clientes Alteração e Exclusão do Contrato	Alteração na descrição do campo “Fonte de Informação”.
21/03/2016	13/04/2016	Regras de Registro Conforme Fonte de Informação	Na tabela 2, inclusão de nova regra.
21/03/2016	06/04/2016	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Alteração na descrição dos campos: Data de cotação para ajuste e Cotação de moeda para o vencimento.
21/03/2016	06/04/2016	Alteração e Exclusão do Contrato	Alteração na descrição dos campos: “CPF/CNPJ Parte e CPF/CNPJ Contraparte”.
21/03/2016	21/03/2016	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Inclusão da observação 2), conforme comunicado 029/16.
21/09/2015	02/03/2016	Conhecendo o Produto (Termo com Agenda de Redutor de Risco Crédito)	Inclusão da observação 1).
21/09/2015	21/09/2015	Contrato Contrato a Termo de Moedas Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities) Registro de Contrato a Termo de Índice Contrato entre Clientes	Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte.
21/09/2015	21/09/2015	Conhecendo o Produto (Termo de Índice)	Inclusão do Índice Selic.
21/09/2015	21/09/2015	Contrato a Termo de Moedas	Inclusão da observação no campo “Data de Fixação”.
27/07/2015	27/07/2015	Cessão de Contrato (Lançamentos e Termo com Fluxo)	Disponibilização da Conta Cliente 1 para Conta Cliente 2 do mesmo participante, que possuam o mesmo CPF ou CNPJ.
15/09/2014	02/07/2015	Registro de contrato a termo de índice	Exclusão do índice Selic (ainda não disponibilizado na produção).
15/09/2014	30/06/2015	Registro de contrato a termo de índice	Inclusão do índice Selic.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
15/09/2014	04/02/2015	Contrato a Termo de Moedas e Mercadoria (Commodities)	Nos campos “Data de Verificação” e “Data Ajuste”, retirada da informação, que a data informada deve ser em dia útil.
15/09/2014	31/10/2014	Atualizações da Versão	Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais nova para a mais antiga.
15/09/2014	15/09/2014	Registro de Termo de Moedas com Fluxo e TARF	Alteração em telas conforme o comunicado 069/14.
18/08/2014	09/09/2014	Todo o manual	Consolidação dos manuais do Termo de Índice, Mercadoria e Moedas. Nas descrições dos campos, inclusão da informação se o preenchimento é obrigatório ou não.
18/08/2014	18/08/2014	Registro do Contrato a Termo de Índice	No campo Data de Vencimento, a data de vencimento do contrato pode ser indicada em dias não uteis.
18/08/2014	18/08/2014	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities) Contrato a Termo de Moedas e Registro de Termo de Moedas com Fluxo	No campo Data de Vencimento, a data de vencimento do contrato pode ser indicada em dias não uteis.
07/07/2014	31/07/2014	Todo o manual	Inclusão do caminho completo da função no NoMe.
07/07/2014	11/07/2014	Antecipação de Contrato	Inclusão da descrição da antecipação com parâmetros diferentes por fluxo
07/07/2014	07/07/2014	Registro do Termo de Moeda com Fluxo e TARF	Mudança das telas e melhoria na descrição do campo Moeda Cotada.
17/03/2014	17/03/2014	Consulta aos Contratos	Na tela de relação, inclusão das colunas: Responsável pela Aceleração – Parte, Responsável pela Aceleração – Contraparte, Agente de Cálculo – Parte e Agente de Cálculo – Contraparte.
01/07/2013	27/02/2014	Registro de Contrato a Termo Simples - Entre Clientes do Participante	Inclusão da frase, “Quando for Spot D0 a data é a do vencimento do contrato.” No campo Data de Avaliação.
01/07/2013	01/07/2013	Registro de Contrato	Mudança na descrição do campo Observação. Inclusão do campo Código Identificador. Conforme comunicado 033 e 039/13.
01/07/2013	01/07/2013	Taxa de Câmbio para Avaliação	Inclusão da Regra para os campos Tx Câmbio, Tx Paridade e Tx Cotada. Conforme comunicado 033 e 039/13.
01/04/2013	01/04/2013	Registro e Antecipação	Inclusão do campo “Cotação de Moeda para o vencimento” Inclusão do campo “Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada)”
14/01/2013	25/02/2013	Campos com a descrição opcional.	Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
14/01/2013	25/02/2013	Campos com a descrição opcional.	Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
14/01/2013	14/01/2013	Consultas	Exclusão das consultas de Transferência de Arquivos e Erros.
14/01/2013	14/01/2013	Consultas	Exclusão das consultas de Transferência de Arquivos e Erros.
14/01/2013	14/01/2013	Registro/Operações	Inclusão do Termo de Moedas com Fluxo e TARF.
25/07/2011	20/12/2012	Alteração e Exclusão de contrato	Alteração na descrição do campo Posição do Participante.
25/07/2011	11/12/2012	Alteração e Exclusão de contrato	Alteração na descrição dos campos CPF/CNPJ Parte e Contraparte.
25/07/2011	16/10/2012	Data de Fixação, página 21.	Melhoria no texto.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
25/07/2011	05/06/2012	Registro de Contrato a Termo Simples – Participante Registro de Contrato a Termo Simples - Entre Clientes do Participante Registro de Contrato a Termo de Moedas	Quando a Fonte de Informação for FEEDER ou SPOT, é possível a indicação do Fixing em D0, informando Spot D0 no campo “Tela ou Função de Consulta Função de Consulta”. A regra é válida para geração de eventos de Resgate de Termo de Moedas e para eventos de fixing dos contratos de termo de Asiático.
25/07/2011	30/05/2012	Cross Rate	Melhorias no texto sobre a descrição do Cross Rate
25/07/2011	07/05/2012	Registro - exemplo com fonte de Informações SISBACEN	Melhorias no texto do campo “Data de Avaliação” do Registro de Contrato.
24/10/2010	27/08/2012	Registro/Emissão	Campo Preço da Operação com até 04 decimais.
24/10/2010	17/04/2012	Regras de Negócios	Inclusão de informações sobre calendário nacional e internacional para liquidação e cotação.