

BM&FBOVESPA

A Nova Bolsa



Sistema de Registro de Derivativos de Balcão

Roteiro de Certificação

Versão: 1.0

Data: 16/01/2013



Contato

Coordenadoria de Registro de Derivativos de Balcão

- balcao@bvmf.com.br
- +55 11 2565-4646

Índice

1. PREFÁCIO	6
2. INTRODUÇÃO	7
2.1. PRÉ-REQUISITOS.....	7
3. CENÁRIOS DE TESTES	8
4. ACESSO AO SISTEMA DE REGISTRO DE DERIVATIVOS DE BALCÃO	9
5. REGISTRO DE OPERAÇÕES - NDF	10
5.1. TERMO DE MOEDA	10
5.2. REGISTRO POR TELA.....	11
5.3. REGISTRO POR ARQUIVO - UPLOAD	16
5.4. REGISTRO POR ARQUIVO – LAYOUT DO ARQUIVO.....	17
5.5. ARQUIVO DE RETORNO.....	23
6. EVENTOS	25
6.1. LIQUIDAÇÃO ANTECIPADA.....	25
7. OPERAÇÕES.....	29
7.1. CONSULTA MOVIMENTAÇÕES DO DIA	29
7.2. CONSULTA OPERAÇÕES	31

Histórico de Versões

Data	Versão	Descrição	Autor
Janeiro 2013	1.0	- Versão inicial	DLI/GRO- CRDB

Nota

A BM&FBOVESPA publicará no canal eletrônico as atualizações com eventuais revisões no conteúdo, sempre que necessário.

As observações aqui descritas poderão ser alteradas sem prévia notificação se assim necessário.

O apoio às instituições envolvidas nesse processo, como questões relativas a suporte técnico, será dado pela Central de Atendimento (CAB) da BM&FBOVESPA - Telefone: **(+55 11) 2565-5000** ou e-mail: cab@bvmf.com.br.

1. Prefácio

Este documento descreve uma série de testes que qualificam o Participante do Mercado de Balcão a conectar-se à BM&FBOVESPA com o propósito de registrar e acompanhar o ciclo de vida de suas operações de derivativos de balcão.

O Sistema de Registro de Derivativos de Balcão é uma plataforma para registro e gerenciamento de operações de balcão (OTC) via web que visa modernizar, aperfeiçoar e expandir o serviço de registro de operações de balcão, oferecendo qualidade e agilidade aos clientes, bem como ferramentas completas de análise para atividades de back office. Suas ferramentas e funcionalidades permitem aos usuários:

- Registrar operações de Contrato a Termo de Moedas com características livremente pactuadas entre as partes, cujo ativo objeto é uma taxa de câmbio expressa em reais ou em moeda estrangeira, com liquidação financeira (*non-deliverable forward*);
- Consultar movimentações diárias e posições em aberto das operações registradas pelo participante, em seu nome ou em nome de terceiros;
- Operar em um sistema dotado dos meios necessários à pronta e eficiente realização e visibilidade das negociações.

Este documento especifica o processo de certificação para o Participante adquirir conhecimento e aptidão na utilização do sistema de registro, sendo oferecido a todos os participantes do Mercado de Balcão na BM&FBOVESPA.

Para solicitar cópias deste documento, favor contatar:

ctc@bvmf.com.br ou balcao@bvmf.com.br

2. Introdução

A BM&FBOVESPA possui um ambiente de certificação que é utilizado pelos participantes e pelos Independent Software Vendors (ISVs) para testar e certificar seu software antes de acessar o ambiente produtivo da Bolsa.

A validação e os testes de soluções adquiridas ou em desenvolvimento podem ser realizados durante dias úteis das **9h00 às 19h00**, sem a necessidade de acompanhamento da equipe de certificação. O acesso ao ambiente de certificação será concedido após “**Formulário de Solicitação de Acesso ao Sistema de Registro de Derivativos de Balcão**” (*Request Form to OTC Derivatives Register System*), disponível no site <http://www.bmfbovespa.com.br/balcao>.

Uma solução certificada de um ISV poderá ser utilizada pelos participantes do mercado sem necessidade de repetição do processo de certificação. No caso de soluções customizadas, a certificação é concedida somente ao participante, referente ao software testado na versão informada.

O processo de certificação consiste em executar o roteiro (cenários de teste) do produto em questão. Após aprovação técnica da BM&FBOVESPA, o participante receberá e-mail da BVMFSOLUTION formalizando a certificação e liberando o acesso à produção para o software certificado.

Não é escopo do processo certificação de soluções realizada pela BVMF:

1 - Aspectos de segurança da informação tais como:

- Logs e trilha de auditoria;
- Possibilidade de parametrização de senha de acordo com as melhores práticas;
- Controle por meio de perfis de acesso.

2.1. Pré-Requisitos:

Requisitos de Hardware:

- Processador Intel Pentium IV ou superior;
- Clock 1.8GHz;
- 1GB de memória RAM;
- 10GB de espaço livre em HD;
- Placa de rede Fast Ethernet de 100Mbps ou superior.

Requisitos de Software:

- Sistema operacional MS Windows XP Professional ou Microsoft Windows 7;
- Microsoft Internet Explorer 8.

3. Cenários de testes

Funcionalidade	Objetivo e Descrição	Quantidade de Cenários
Registro por tela	Registrar Termo de Moeda (ME x BRL) Data Negociação = entre D-1 a D-3 da Data Registro Data do Fixing = entre T-1 a T-5 Fonte de Informação: BCB	2
Registro por tela	Registrar Termo de Moeda (ME x BRL) Data Negociação = entre D-1 a D-3 da Data Registro Data do Fixing = entre T-1 a T-5 Câmbio Cruzado: SIM	2
Registro por tela	Registrar Termo de Moeda (ME x ME; liquidação em BRL) Data Negociação = entre D-1 a D-3 da Data Registro Data do Fixing = entre T-1 a T-5 Fonte de Informação: BLOOMBERG	1
Registro por tela	Registrar Termo de Moeda (ME x ME; liquidação em BRL) Data Negociação = entre D-1 a D-3 da Data Registro Data do Fixing = entre T-1 a T-5 Fonte de Informação: WMREUTERS	1
Consulta Movimentação do dia	Consultar o status das operações registradas no dia, de acordo com os filtros selecionados.	n
Consulta de Operações	Consultar os detalhes das operações de acordo com os filtros selecionados	n
Liquidação Antecipada	Liquidação Antecipada Parcial/Total de Operações de Termo de Moeda (ME x BRL).	2
Liquidação Antecipada	Liquidação Antecipada Parcial/Total de Operações de Termo de Moeda (ME x ME; liquidação em BRL).	2
Registro por arquivo XML	Simulação de preenchimento de operação de Termo de Moeda Simples e Paridade de Moedas com liquidação em BRL.	5
Retorno	Verificação das consistências do arquivo de registro através da tela de "Retorno"; Verificação do arquivo "Retorno.xml".	n
Totais		15

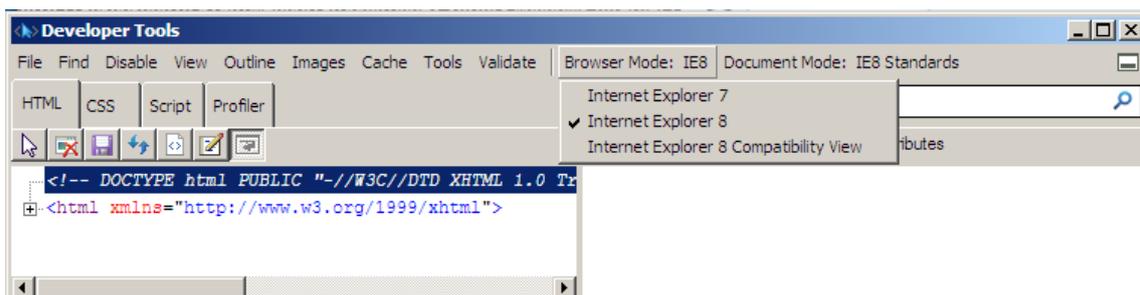
*n = quantidade definida pelo participante para entendimento da funcionalidade.

4. Acesso ao Sistema de Registro de Derivativos de Balcão

Para acessar o sistema, digite o endereço da página de login, localizada abaixo, no seu browser:

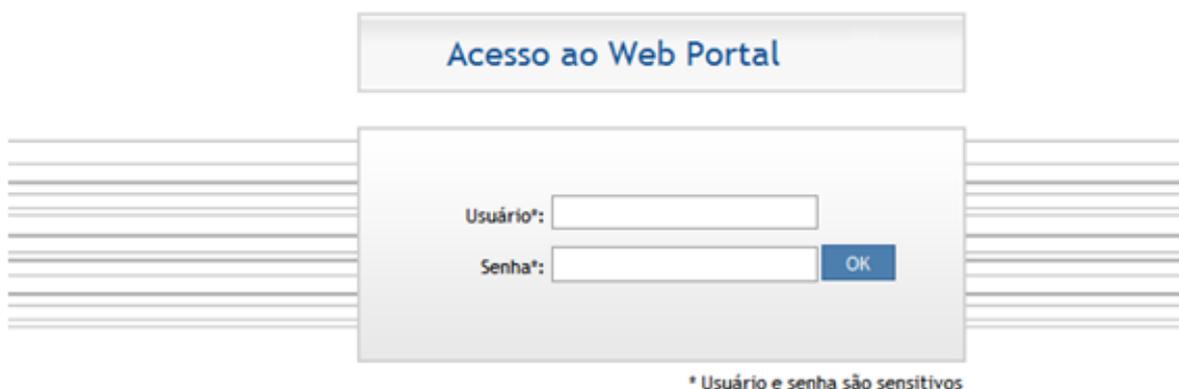
<https://cert-balcao-derivativos.bvmfnet.com.br>

Nota: No Internet Explorer 8 confirmar em “developer tools” se a versão do “Browser Mode” está configurada para o modo IE8. Para acessar essa informação, basta pressionar a tecla F12 no Internet Explorer 8 e a tela abaixo será apresentada:



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

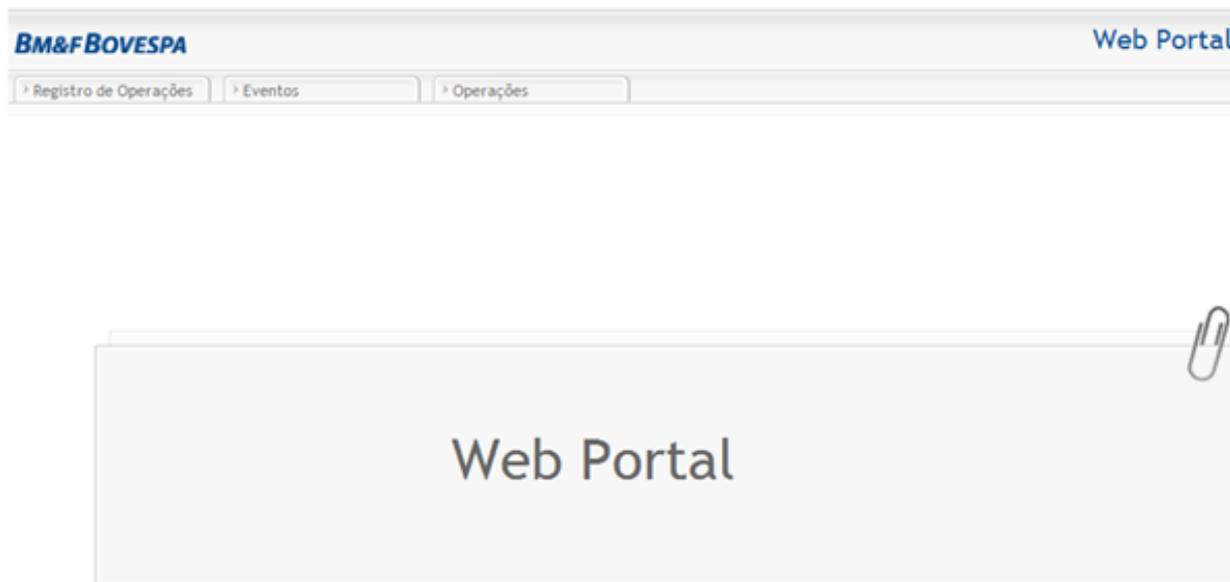
A mensagem para efetuar o login de acesso ao sistema de registro será apresentada e os campos de usuário e senha serão habilitados para digitação:



Usuário: campo do ID do Usuário no sistema de registro. Fornecido pelo sistema de controle de acesso da BMF&BOVESPA.

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

Após o fornecimento das credenciais e validação das mesmas, o sistema apresentará a tela inicial:



A tela está dividida em três abas, onde se podem ser efetuar as seguintes funções:

5. Registro de Operações - NDF

O registro de uma operação no sistema só poderá ser efetuado por um Participante autorizado, conforme regras no regulamento de acesso. Quando a operação é realizada entre o Participante e seu cliente, o registro é feito pelo Participante ou por um Participante terceiro autorizado por este a registrar em seu nome.

No caso de operações realizadas entre dois Participantes, estes, ou um Participante terceiro autorizado a registrar em seu nome, deverão registrar no Sistema de Registro individualmente e, após o confronto automático ("matching") das informações, a operação passará efetivamente a base das operações em aberto de cada Participante.

OBS: não haverá confronto entre números chave da operação. O confronto será feito com base das informações das partes da operação, das características do produto informado e das funcionalidades escolhidas.

5.1. Termo de Moeda

É um contrato de compra e venda de uma determinada quantidade de moeda sem entrega física em uma data futura acordado entre as partes, cuja liquidação é feita financeiramente pela diferença entre a taxa de câmbio ou paridade acordada, e a taxa de câmbio ou paridade verificada na data de liquidação. O tamanho, a data de vencimento e a fonte de informação (*feeder*) para a taxa de liquidação do contrato são livremente pactuados entre as partes e devem ser informadas no registro do produto no Sistema de Registro.

O termo de moeda sem entrega física pode ser registrado nas seguintes modalidades:

- **Simple Taxa de Câmbio:** contrato com vigência imediata, cujo ativo subjacente é a taxa de câmbio de reais por uma moeda estrangeira (ME/BRL);
- **Simple Paridade:** contrato com vigência imediata, cujo ativo subjacente pode ser a paridade tipo A: entre moeda estrangeira por Dólares dos Estados Unidos (USD/ME) ou paridade tipo B: Dólares dos Estados Unidos por moeda estrangeira (ME/USD);

Cada modalidade oferece diferentes combinações de moedas e provedores de informações, cujas possibilidades são descritas nas próximas sessões.

5.2. Registro por Tela:

Registro de Operações - NDF

Participante Registro: (A) BVMF3 Operação com Garantia: (B) <input type="radio"/> Sim <input checked="" type="radio"/> Não Termo (C) <input checked="" type="radio"/> Moedas <input type="radio"/> Mercadorias <input type="radio"/> Índices Indicador: (D) Termo Simples Parte CNPJ: (E) _____ Book: (F) Seleccione Posição: (G) Vendedor Contraparte CPF/CNPJ: (H) _____ Book: (I) Seleccione	Dados da Operação Data Registro: (J) 17/01/2013 Data Negociação: (K) 17/01/2013 Data Início Termo: (L) 17/01/2013 Data Vencimento: (M) _____ Valor Base/Quantidade: (N) _____ Moeda / Unidade Base: (O) Seleccione Moeda de Cotação: (P) Seleccione Objeto de Registro: (Q) Taxa a termo Valor Objeto de Registro: (R) _____,00	Câmbio Cruzado USD: (S) <input type="radio"/> Sim <input checked="" type="radio"/> Não Ref. Moeda/Unidade Base Fonte de Informação: (T) Seleccione Boletim: (U) Seleccione Ref. Cotação Fonte de Informação: (V) Seleccione Boletim: (X) Seleccione Critério de determinação do preço de Liquidação: (Z) <input checked="" type="radio"/> Final	Liquidação Data do Fixing: (Y) Seleccione Data da Liquidação: (W) Seleccione Outros Número de Controle Interno: (1) _____ Calcula MTM: (2) <input type="radio"/> Sim <input checked="" type="radio"/> Não Migração Migração: (3) <input type="radio"/> Sim <input checked="" type="radio"/> Não
---	---	--	--

Nome do Campo	Descrição
(A) Participante Registro	Instituição Financeira com acesso ao sistema de registro, responsável pelo registro da operação, podendo esta ser parte na operação ou autorizada a registrar em nome de outra Instituição Financeira.
(B) Operação com Garantia	Opções: SIM ou NÃO Campo de seleção para operações com ou sem garantia . Inicialmente o campo será habilitado somente para opção "NÃO".
(C) Termo	Tipo do contrato a termo ao qual o registro pertence, podendo ser: Moedas, Mercadorias ou Índices. Inicialmente o campo será habilitado somente para opção "Moedas".
(D) Indicador	Indicador do tipo de termo que está sendo registrado. A Opção "Termo Simples" é utilizada quando a data de início é igual à data de negociação. .

(E) CNPJ Parte	Número do CNPJ da parte da operação.
(F) Book Parte	Lista de <i>books</i> (contas) da parte selecionada.
(G) Posição Parte	Posição da parte na operação com as seguintes opções: comprador ou vendedor .
(H) CPF/CNPJ Contraparte	Número do CNPJ ou CPF da Contraparte da operação.
(I) Book Contraparte	Lista de <i>books</i> (contas) da parte selecionada. Este campo não deverá ser informado para operações de duplo comando.
(J) Data Registro	Data em que a operação foi registrada no sistema. Este campo não é editável.
(K) Data Negociação	Data em que a operação foi realizada entre as partes fora do ambiente de registro. Esta data deverá ser dia útil e poderá ser retroativa em até três dias (D-3) da data de registro, conforme regulamento.
(L) Data Início Termo	Dia útil em que se inicia o contrato a termo. Para termo simples, esta data deverá ser igual à data de negociação.
(M) Data Vencimento	Data de cálculo do valor financeiro de liquidação do contrato, devendo este ser dia útil e estar entre o segundo dia útil após a data de registro e até 15 anos, no máximo.
(N) Valor Base/ Quantidade	Valor financeiro do contrato, expresso em quantidade de moeda base, respeitando o valor mínimo equivalente à R\$ 1.000.
(O) Moeda / Unidade Base	Moeda objeto do contrato a termo. Exemplo: para taxa de câmbio de reais por uma unidade de Dólar dos Estados Unidos da América (USD/BRL), a moeda base é o Dólar dos Estados Unidos da América.
(P) Moeda de Cotação	Moeda pela qual será cotada a moeda base objeto do contrato a termo. Exemplo: para taxa de câmbio de reais por uma unidade de Dólar dos Estados Unidos da América (USD/BRL), a moeda cotada é o Real.
(Q) Objeto de Registro	<p>Taxa de Câmbio / Paridade: para registros de termo simples ou asiático o objeto de registro será uma taxa de câmbio ou paridade conforme definido no tipo de cotação.</p> <p>Forward Points: valor a ser acrescido ou diminuído da taxa de câmbio ou paridade, verificada na data de determinação do preço a termo objeto do contrato.</p> <p>Porcentagem: valor de multiplicação a ser aplicado sobre a taxa de câmbio ou paridade, verificada na data de determinação do preço a termo objeto do contrato.</p> <p>Inicialmente o campo será habilitado somente para opção: Taxa de Câmbio / Paridade</p>
(R) Valor Objeto de Registro	Valor ou uma taxa, conforme objeto de registro selecionado acima. Inicialmente o campo será habilitado somente para opção: Taxa de Câmbio / Paridade

(S) Câmbio Cruzado USD

Opções: SIM ou NÃO

Opção de *fixing* disponível para qualquer taxa de câmbio, exceto USD/BRL. Ao selecionar esta opção, o Participante terá o contrato a termo de moeda liquidado pelo câmbio cruzado entre a paridade da moeda base e a taxa de câmbio de Reais por Dólares dos Estados Unidos. Exemplo: Termo de Reais por Euro (EUR/BRL) pode ser liquidado pela multiplicação entre a paridade Dólares dos Estados Unidos por Euro (EUR/USD) e a taxa de câmbio de Reais por Dólares dos Estados Unidos (USD/BRL), de forma a se obter a taxa de câmbio EUR/BRL objeto do termo.

As opções possíveis para a fonte de informação do Câmbio Cruzado estão contidas na lista de Moedas e Taxas de Câmbio no Anexo I do manual do produto.

Ref. Moeda / Unidade Base

(T) Fonte de Informação

Nome do veículo oficial responsável pela divulgação do valor da moeda ou unidade base que está sendo registrada.

(U) Boletim

Boletim/horário do veículo na qual serão publicados os valores negociados da moeda Base

Ref. Cotação

(V) Fonte de Informação

Nome do veículo oficial responsável pela divulgação do valor da moeda cotada. (Habilitado para preenchimento somente se o campo Câmbio Cruzado for igual a "Sim")

(W) Boletim

Boletim/horário do veículo na qual serão publicados os valores negociados da moeda cotada. (Habilitado para preenchimento somente se o campo Câmbio Cruzado for igual a "Sim")

Liquidação

(X) Critério de determinação do preço de Liquidação

Taxa de câmbio ou paridade de liquidação observada na data de vencimento para efeito de cálculo de liquidação do contrato. O sistema aceita a seguinte opção para o período: Simples: valor a vista da taxa de câmbio ou paridade divulgado pela instituição fonte de informação do objeto do contrato, com opção de data entre D-5 da data de vencimento do contrato até a data de vencimento do contrato, inclusive;

(Y) Data do Fixing

Data da observação do preço de liquidação da taxa de câmbio ou paridade, objeto do contrato a termo. Essa data deverá ser dia útil e estar compreendida entre a data de vencimento (V), inclusive, e o quinto dia útil anterior a essa data (V-5), inclusive.

(Z) Data da Liquidação

Data do fluxo financeiro da liquidação. Essa data deverá estar compreendida entre a data de vencimento (V) e o dia útil seguinte (V+1). Caso a data de fixing seja igual à data de vencimento, a liquidação financeira ocorrerá no seguinte à data de vencimento.

(1) Número de Controle Interno

Campo de uso livre do participante para informar um número interno da operação na instituição. Esse campo não pode ser repetido para o mesmo participante

(2) Calcula MtM

Opções: SIM ou NÃO

Se escolhida a opção "sim", a operação registrada será marcada a mercado diariamente pela metodologia e preços divulgados pela BM&FBOVESPA e disponibilizado no relatório

de MTM para o participante.

(3) Migração

Opções: SIM ou NÃO

Indica se a operação que está sendo registrada é migrada, ou seja, a operação estava ativa em outro sistema de registro autorizado pelos órgãos reguladores. Se a opção "sim" for escolhida, a tela apresentará novos campos para a especificação da migração, conforme abaixo.

Caso a opção (3) da tabela acima seja "SIM", os seguintes campos são apresentados:

Migração

Migração:

Sim Não

Local de Registro de Origem*:

Selecione ▼

Código do Contrato Original*:

Valor Base Inicial*:

Data de Registro Original*:

Motivo da Migração*:

Migração

(A) Migração

Opções: SIM ou NÃO

Caso a opção sim seja selecionada, os campos de (B) à (F) são habilitados.

(B) Local de Registro de Origem

Campo do tipo lista que permite escolher a instituição em que a operação foi registrada inicialmente.

(C) Código do Contrato Original

Código do contrato na instituição em que a operação foi registrada

(D) Valor Base Inicial

Valor base do contrato na instituição em que a operação foi registrada

(E) Data Registro Original

Data em que a operação foi registrada

(F) Motivo da Migração

Campo livre ao usuário para informar os motivos da migração.

Demais comandos disponíveis na tela:

Confirmar

Limpar

CONFIRMAR: submete as informações para checagem primária da operação. Em operação entre Participante e Cliente, caso nenhuma informação seja invalidada, o status da operação passa a ser

“ativa”. Em operação entre dois Participantes (comando duplo), após o registro do primeiro comando o sistema gera um número de protocolo até que a contraparte lance o segundo comando. Somente após o confronto automático das informações das partes, o sistema gera o número da operação. Caso esta confirmação não ocorra em D0 do registro, a mesma será rejeitada ao final do dia.

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

Cenários para testes	Descrição da Operação	
Participante registra operação de termo de moeda (comando simples). Característica do cenário: Operação com garantia: Não Termo: Moedas Indicador: Termo Simples Data Negociação = D-0 a D-3 da Data de Registro Data de Início Termo = Data de Registro Objeto de Registro: Taxa a termo Câmbio Cruzado USD: Não Critério de Determinação do Preço de Liquidação: Final Data de Fixing: entre T-1 a T-5 Data de Liquidação: T0 Cálculo MTM: Não Migração: Não	Parte:	CNPJ
	Book:	Selecionar o Book
	Posição:	Vendedor/Comprador
	Contraparte:	CPF/CNPJ
	Book:	Selecionar o Book
	Data de negociação:	Data do teste (ou até D-3 da data de registro)
	Data de vencimento:	qualquer dia útil
	Valor Base:	ticket médio negociado pelo Participante
	Valor Objeto Registro:	de acordo com a cotação
	Moeda Base:	ARS, USD... (ou qualquer moeda estrangeira)
	Moeda Cotada:	BRL
	Ref. Base-Fonte de Informação:	BCB
	Ref. Base-Boletim:	PTAX.Venda (ou PTAX.Compra)
	Número de Operação:	gerado pela BVMF
Número de Controle Interno:	não obrigatório	
Participante registra operação de termo de moeda (comando simples). Característica do cenário: Operação com garantia: Não Termo: Moedas Indicador: Termo Simples Data de Negociação = D-0 a D-3 da Data de Registro Data de Início Termo = Data de Registro Objeto de Registro: Taxa a Termo Câmbio Cruzado USD: Sim Critério de Determinação do Preço de Liquidação: Final Data de Fixing: entre T-1 a T-5 Data de Liquidação: T0 Cálculo MTM: Não Migração: Não	Parte:	CNPJ
	Book:	Selecionar o Book
	Posição:	Vendedor/Comprador
	Contraparte:	CPF/CNPJ
	Book:	Selecionar o Book
	Data de negociação:	Data do teste (ou até D-3 da data de registro)
	Data de vencimento:	qualquer dia útil
	Valor Base:	ticket médio negociado pelo Participante
	Valor Objeto Registro:	de acordo com a cotação
	Moeda Base:	ARS, USD... (ou qualquer moeda estrangeira)
	Moeda Cotada:	BRL
	Ref. Base-Fonte de Informação:	BLO (ou WMR)
	Ref. Base-Boletim:	16:00 (ou Fechamento)
	Ref. Cotação-Fonte de Informação:	BCB
Ref. Cotação-Boletim:	PTAX.Venda (ou PTAX.Compra)	
Número de Operação:	gerado pela BVMF	
Número de Controle Interno:	não obrigatório	

Cenários para testes	Descrição da Operação	
Participante registra operação de Termo de Moeda Paridade (comando simples). Característica do cenário: Operação com garantia: Não Termo: Moedas Indicador: Termo Simples Data de Negociação = D-0 a D-3 da Data de Registro Data de Início Termo = Data de Registro Objeto de Registro: Taxa a Termo Câmbio Cruzado USD: Não Critério de Determinação do Preço de Liquidação: Final Data de Fixing: entre T-1 a T-5 Data de Liquidação: T0 Cálculo MTM: Não Migração: Não	Parte:	CNPJ
	Book:	Selecionar o Book
	Posição:	Vendedor/Comprador
	Contraparte:	CPF/CNPJ
	Book:	Selecionar o Book
	Data de negociação:	Data do teste (ou até D-3 da data de registro)
	Data de vencimento:	qualquer dia útil
	Valor Base:	ticket médio negociado pelo Participante
	Valor Objeto Registro:	de acordo com a cotação
	Moeda Base:	AUD, NZD, GBP, EUR...(de acordo com a paridade oficial)
	Moeda Cotada:	USD
	Ref. Base-Fonte de Informação:	WMR ou BLO (ou BCE)
	Ref. Base-Boletim:	16:00 (ou Fechamento)
	Número de Operação:	gerado pela BVMF
Número de Controle Interno:	não obrigatório	
Participante registra operação de Termo de Moeda Paridade (comando simples). Característica do cenário: Operação com garantia: Não Termo: Moedas Indicador: Termo Simples Data de Negociação = D-0 a D-3 da Data de Registro Data de Início Termo = Data de Registro Objeto de Registro: Taxa a Termo Câmbio Cruzado USD: Não Critério de Determinação do Preço de Liquidação: Final Data de Fixing: entre T-1 a T-5 Data de Liquidação: T0 Cálculo MTM: Não Migração: Não	Parte:	CNPJ
	Book:	Selecionar o Book
	Posição:	Vendedor/Comprador
	Contraparte:	CPF/CNPJ
	Book:	Selecionar o Book
	Data de negociação:	Data do teste (ou até D-3 da data de registro)
	Data de vencimento:	qualquer dia útil
	Valor Base:	ticket médio negociado pelo Participante
	Valor Objeto Registro:	de acordo com a cotação
	Moeda Base:	USD
	Moeda Cotada:	CNY, KRW, CHF, MXN,...(de acordo com a paridade oficial)
	Ref. Base-Fonte de Informação:	WMR ou BLO (ou BCE)
	Ref. Base-Boletim:	16:00 (ou Fechamento)
	Número de Operação:	gerado pela BVMF
Número de Controle Interno:	não obrigatório	

5.3. Registro por Arquivo – Upload

O registro de operações também pode ser realizado por arquivo formato "xml". Para acessar a tela de upload, deve-se selecionar a aba "REGISTRO DE OPERAÇÕES" e as opções "ARQUIVOS" e "UPLOAD".

Ao clicar em “PROCURAR”, o sistema abrirá a tela solicitando o arquivo para ser carregado através da opção. O formato do arquivo deve ser XML, cujo layout é definido abaixo.

Upload de Arquivo

Arquivo de Registro:

(1 de 1) |< << >> >| 20

Data e Hora	Arquivo	Observação
Nenhum registro encontrado		

(1 de 1) |< << >> >| 20

0 Arquivos

Caso o arquivo não possua o *layout* correto, o sistema apresentará a mensagem de formato inválido.

5.4. Registro por Arquivo - Layout do Arquivo

O layout do arquivo deverá seguir a seguinte estrutura:

Atributo	Tag XML	Definição Atributo	Tipo / Tamanho Dado	Lista de Domínio dos Atributos	REGRA
Função	CodFuncId	Indica a ação do Participante no sistema	X(2)	1 - Registro de Operação 2 - Exercício 3 - Bloqueio de Exercício 4 - Liquidação Antecipada 5 - Vencimento Antecipado 6 - Correção	
Produto	TpModBVF	Nome do produto previamente cadastrado	X(2)	82 – NDF 83 – SWAP 84 - OPÇÕES	
Grupo	CodGrpBVF	Grupos previamente cadastrados	X(3)	0 – Moedas 1 – Mercadoria 2 - Índice	
Indicador	CodIndex	Indicar em formato de domínio.	X(2)	01 – Algodão 02 – Açúcar 03 – Cobre	
Indicador de Garantia	IndTpGar	Identifica operação com ou sem CCP	X(1)	S ou N	
Data do Movimento	DtMovto	Data em que ocorre o registro	X(10)	AAAA-MM-DD	
Data de Negociação	DtNeg	Data de negociação	X(10)	AAAA-MM-DD	
Data de Vencimento	DtVenc	Data de vencimento	X(10)	AAAA-MM-DD	

Número Controle Interno	NumCtrlPart	Identifica o número de controle no sistema da BVMF	X(32)	
Identificação da Transação	NumrcSeqOpLote	Identifica quantas operações são enviadas	N(6)	
ParticipanteRegistro	CodPartBVF	Código do PR que registrou a operação	N(6)	
Migracao	InDrMigr	Flag que identifica caso de migração	X(1)	S ou N
CodigoContratoOrigem	CodContrtoOrigem	Identifica o número de contrato referente ao registro realizado fora BVMF	X(20)	
MotivoMigracao	MotvMigr	Motivo da Migração	X(100)	
DataRegistroOrigem	DtRegOrigem	Identifica a data do registro realizado fora da BVMF.	X(10)	AAAA-MM-DD
LocalRegistroOrigem	CodLocRegOrigem	Nome da Empresa Origem	X(2)	
ValorBaseIncial	VlrBaseInial	Valor Base do Registro	N(15,2)	
Parte	CNPJ_CPFFPart	CNPJ	X(14)	
PosicaoDaParte	TpPosPart	Compra ou Venda	X(1)	C- Comprado V - Vendido
BookDaParte	CTPart	Book da Parte	X(15)	
ContraParte	CNPJ_CPFCtraPart	CNPJ ou CPF da contraparte	N(14)	
BookDaContraparte	CtCtraPart	Book da Contraparte	X(15)	
ObjetodeRegistro	TpObjReg	Taxa/Preço à termo, Forward Points	N(2)	0 - Taxa/Preço a termo 1 - Forward Points
ValorObjetoRegistro	VlrObjReg	Campo a ser preenchido pelo PR refere-se ao valor a ser verificado no vencimento da operação	N(10,8)	
ValorBase	VlrBase	Valor sempre na unidade base	N(17,2)	

Quantidade	QtdBase	Quantidade registrada na unidade base	N(17,2)	
CambioCruzado	IndrCr	É a taxa de câmbio embutida entre duas moedas no caso do USD	X(1)	S ou N
Moeda/UnidadeBase	CodMoedaUnidd Base	Identifica a primeira moeda ou unidade	N(4)	1-BRL-Real 2-USD-United States Dollar 3-EUR-Euro 4-ARS-Argentine Peso 5-AUD-Australian Dollar 6-CAD-Canadian Dollar 7-CHF-Swiss Franc 8-CLP-Chilean Peso 9-CNY-Yuan Renminbi 10-COP-Colombian Peso 11-DKK-Danish Krone 12-GBP-British Pound 13-HKD-Hong Kong Dollar 14-JPY-Yen 15-KRW-Won South Korea 16-MXN-Mexican Peso 17-MYR-Malaysian Ringgit 18-NZD-New Zealand Dollar 19-RUB-Russian Ruble 20-SEK-Swedish Krona 21-SGD-Singapore Dollar 22-TRY-New Turkish Lira 23-ZAR-South African Rand
MoedaCotação	CodMoedaCotd	Moeda ou Unidade cotada	N(3)	1-BRL-Real 2-USD-United States Dollar 3-EUR-Euro 4-ARS-Argentine Peso 5-AUD-Australian Dollar 6-CAD-Canadian Dollar 7-CHF-Swiss Franc 8-CLP-Chilean Peso 9-CNY-Yuan Renminbi 10-COP-Colombian Peso 11-DKK-Danish Krone 12-GBP-British Pound 13-HKD-Hong Kong Dollar 14-JPY-Yen 15-KRW-Won South Korea 16-MXN-Mexican Peso 17-MYR-Malaysian Ringgit 18-NZD-New Zealand Dollar 19-RUB-Russian Ruble 20-SEK-Swedish Krona 21-SGD-Singapore Dollar 22-TRY-New Turkish Lira 23-ZAR-South African Rand

FonteInformação(Ref. A Moeda/Unidade Base)	TpFnteBVF	Fonte de Informação que determinará valores referente a moeda ou unidade base	X(2)	0 – BCB 1 – WMReuters 2 – BLOOMBERG 3 – BOJ 4 – BCE 5 - BVMF	Função do produto escolhido (termo de moedas ou de mercadorias)
FonteInformação(Ref. A Cotação)	TpInfContrtoBVF	Fonte de Informação que determinará valores referentes à cotação	X(2)	0 – BCB 1 – WMReuters 2 – BLOOMBERG 3 – BOJ 4 – BCE 5 – BVMF	
Boletim(Ref. A Moeda Base)	IndrBolMoedaBase	Abertura, Fechamento, datas (conforme fonte de informação referente à moeda base).	X(2)	0 - 11 horas 1 - 12 horas 2 - 13 horas 3 – Média 4 – Abertura 5 - Fechamento	Apresentar todos os horários cadastrados para a fonte selecionada
Boletim(Ref. A Cotação)	IndrBolMoedaCotd	Abertura, Fechamento, datas (conforme fonte de informação referente à cotação).	X(2)	0 - 11 horas 1 - 12 horas 2 - 13 horas 3 – Média 4 – Abertura 5 - Fechamento	Apresentar todos os horários cadastrados para a fonte selecionada
DataInicioTermo	DtIniContrto	Data início do Termo, na primeira fase será igual a data de negociação	X(10)	AAAA-MM-DD	
CriterioTaxaTermo	CritTaxTermo	Destinado a informar se esta é um termo a termo iniciando por critério asiático	X(1)	0 – Final 1 - Asiático	
DataTaxaTermo	DtTaxTermo	Data de determinação da taxa a Termo (Ts)	X(10)	AAAA-MM-DD	
DataCalculoInicio	DtCalcIni	Data Início para determinação do cálculo	X(10)	AAAA-MM-DD	
DataCalculoTermino	DtCalcFim	Data fim para determinação do cálculo	X(10)	AAAA-MM-DD	
CalculaMtm	IndMarcMerc	Marcação de Mercado(para efeito de valorização preços transacionados no mercado)	X(1)	S ou N	
CriterioPreçoinicioTermo	CritCotIniTermo	Critério do Preço de início do termo	X(2)	A - Média Aritmética Simples O - Média Não Padronizada P - Média Aritmética Ponderada	

CritérioPreçoLiquidacao	InDrPeriodBVF	Indicar em formato de domínio. Modalidade do contrato termo a termo, asiático.	N(1)	1 - Final 2 - Asiático
DataFixing	DtCotLiquid	Data negociada para liquidação dentro T+0... T-5. Data de fixação do preço antes do leilão sendo o vencimento (T) menos de 0 a 5 dias.	N(2)	1 - T-5 2 - T-4 3 - T-3 4 - T-2 5 - T-1 6 - T+0
CritérioFixing	CritCotLiquid	Critério utilizado para fixing no caso checar lista domínio.	X(2)	A - Média Aritmética Simples O - Média Não Padronizada P - Média Aritmética Ponderada
DataCalculoLiquidacaoInicio	DtCalcLiquidIni	Data inicio calculo liquidação	X(10)	AAAA-MM-DD
DataCalculoLiquidacaoTermino	DtCalcLiquidFim	Data fim calculo liquidação	X(10)	AAAA-MM-DD
DataDeLiquidacao	DtLiquidFinanc	Quando ocorre a liquidação	N(2)	6 - T+0 7 - T+1

Como exemplo, abaixo é exibido o *layout* do arquivo XML com as respectivas *tags* para melhor entendimento:

```

<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
- <DOC>
  - <SISMSG>
    - <OTC0001>
      <CodFuncld>1</CodFuncld>
      <TpModBVF>82</TpModBVF>
      <CodGrpBVF>0</CodGrpBVF>
      <CodIndex/>
      <IndTpGar>N</IndTpGar>
      <DtMovto>2012-10-26</DtMovto>
      <DtNeg>2012-10-26</DtNeg>
      <DtVenc>2012-11-26</DtVenc>
      <NumCtrlPart>09102016</NumCtrlPart>
      <NumrcSeqOpLote>000015</NumrcSeqOpLote>
      <CodPartBVF>258369</CodPartBVF>
      <IndrMigr>N</IndrMigr>
      <CodContrtoOrigem/>
      <MotvMigr/>
      <DtRegOrigem/>
      <CodLocRegOrigem/>
      <VlrBaseInial/>
      <CNPJ_CPFPart>61194353000164</CNPJ_CPFPart>
      <TpPosPart>C</TpPosPart>
      <CTPart>40732</CTPart>
      <CNPJ_CPFCTraPart>28302869872</CNPJ_CPFCTraPart>
      <CtCtraPart>40736</CtCtraPart>
      <TpObjReg>0</TpObjReg>
      <VlrObjReg>1.99</VlrObjReg>
      <VlrBase>10000</VlrBase>
      <QtdBase/>
      <IndrCr>N</IndrCr>
      <CodMoedaUniddBase>4</CodMoedaUniddBase>
      <CodMoedaCotd>1</CodMoedaCotd>
      <TpFnteBVF>0</TpFnteBVF>
      <TpInfContrtoBVF/>
      <IndrBolMoedaBase>2</IndrBolMoedaBase>
      <IndrBolMoedaCotd/>
      <DtIniContrto>2012-10-26</DtIniContrto>
      <CritTaxTermo/>
      <DtTaxTermo/>
      <DtCalcIni/>
      <DtCalcFim/>
      <IndMarcMerc>N</IndMarcMerc>
      <CritCotIniTermo/>
      <IndrPeriodBVF/>
      <DtCotLiquid>4</DtCotLiquid>
      <CritCotLiquid/>
      <DtCalcLiquidIni/>
      <DtCalcLiquidFim/>
      <DtLiquidFinanc>7</DtLiquidFinanc>
    </OTC0001>
  </SISMSG>
</DOC>

```

Uma vez importado com sucesso, o sistema irá acrescentar na tabela abaixo da sessão **“UPLOAD”** uma linha referente ao *upload* deste arquivo, informando automaticamente a data e a hora em que foi realizado, nome do arquivo e observação com respectiva mensagem de sucesso:

 O upload do arquivo foi realizado com sucesso 

Upload de Arquivo

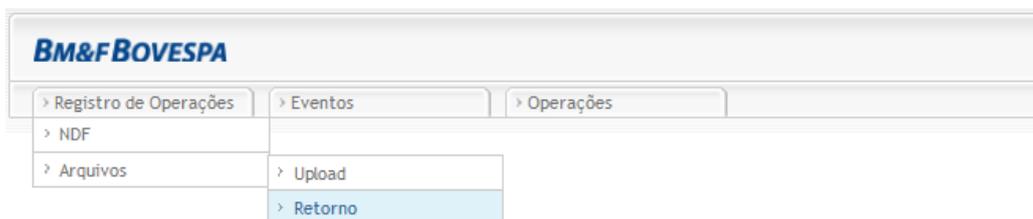
Arquivo de Registro:

Procurar

(1 de 1) < << 1 >> >		
Data e Hora	Arquivo	Observação
17/01/2013 18:30:13	testeqa CHFUSD real.xml	Upload do arquivo testeqa CHFUSD real.xml realizado com sucesso. Pro recebimento do arquivo A01136008 . Acompanhamento do processamer função retorno
(1 de 1) < << 1 >> >		
1 Arquivos		

5.5. Arquivo de Retorno

Para obter as informações de retorno de um arquivo importado na opção Upload, acessar a opção através da aba “Registro de Operações”, “Arquivos” e “Retorno”:



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

- Protocolo Arquivo;
- Nome do Arquivo;
- Situação: este campo possui 3 situações pré-definidas conforme abaixo ilustrado. Caso nenhuma situação for escolhida, o sistema trará todas;
- Data;
- O resultado da pesquisa pode se exibido em múltiplos de 10.

Arquivo Retorno

- **Arquivo processado com sucesso** - arquivo processado com sucesso: todas as operações foram registradas com sucesso, não ocorreu erro;
- **Arquivo parcialmente processado** - verificar detalhes das operações: o arquivo teve operações registradas com sucesso e operações com erro;
 - **Operação(ões) com erro de preenchimento** – operação(ões) com erro de preenchimento: apresenta operações com erro de preenchimento que devem ser apresentados ao visualizar os detalhes do arquivo

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

Arquivo Retorno

▼ Pesquisa

Protocolo Arquivo: Situação: Operação(ões) com erro de preenchimento Resultado por pesquisa: Selecione

Nome do Arquivo: Data: 17/01/2013

(1 de 1) 1 20

	Data/Hora	Nome do Arquivo	Protocolo	Operações	Situação
<input checked="" type="checkbox"/>	17/01/2013 18:30:13	testeqa CHFUSD real.xml	A01136008	ERRO	Operação(ões) com erro de preenchimento: apresenta operações com erro de preenchimento que devem ser apresentados ao se visualizar o detalhes do arquivo

1 Arquivos

O usuário pode selecionar o arquivo de retorno desejado e, em seguida, fazer o download (uma mensagem de sucesso deverá ser apresentada na tela após a disponibilização do arquivo), ou clicar sobre o nome do arquivo para verificar diretamente por tela as consistências e inconsistências identificadas no processamento do arquivo.

Arquivo Retorno

Arquivo disponibilizado com sucesso !
17/01/2013 06:38:43

Retorno.zip:

A01136008_20130117.xml

Figura: exemplo de arquivo parcialmente processado com sucesso.

Arquivo Retorno - Detalhes do Arquivo: testeqa comando simples.xml / Data/Hora: 14/01/2013 - 10:51:21

Nome do Arquivo: testeqa comando simples.xml
Data: 14/01/2013
Status: CONCLUIDO

NP. da Operação	Produto	Grupo	Funcionalidade / Indicador	NP. de Controle Interno	Protocolo	Detalhe
NDF410007527	NDF / NRG / BRL	Moeda	Termo Simples			Registro realizado com sucesso
NDF410007528	NDF / NRG / BRL	Moeda	Termo Simples			Registro realizado com sucesso
NDF410007529	NDF / NRG / BRL	Moeda	Termo Simples			Registro realizado com sucesso
ERRO	NDF	Moedas	Termo Simples			[1] Período entre Data de Registro e Data de Vencimento menor que o permitido. Alinhado de dias permitidos: 2 dias úteis
ERRO	NDF	Moedas	Termo Simples			[1] Período entre Data de Registro e Data de Vencimento menor que o permitido. Alinhado de dias permitidos: 2 dias úteis
NDF410007530	NDF / NRG / BRL	Moeda	Termo Simples			Registro realizado com sucesso
NDF410007531	NDF / NRG / BRL	Moeda	Termo Simples			Registro realizado com sucesso
NDF410007532	NDF / NRG / BRL	Moeda	Termo Simples			Registro realizado com sucesso
ERRO	NDF	Moedas	Termo Simples			[1] Período entre Data de Registro e Data de Vencimento menor que o permitido. Alinhado de dias permitidos: 2

6. Eventos

6.1. Liquidação antecipada

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

No caso de liquidação antecipada entre dois Participantes, à mesma deverá ser informada através de comando duplo, e o confronto automático das informações deverá ocorrer no mesmo dia.

O valor remanescente de uma liquidação parcial antecipada deve ser igual ou superior ao valor mínimo de R\$ 1.000,00.

TELA DE PESQUISA

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

Liquidação Antecipada

Pesquisa			
Nº. da Operação:	Data Vencimento:	Valor em Aberto:	Funcionalidade/Indicador:
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	Termo Simples
Book Parte:	Data Negociação:	Produto:	Resultado por pesquisa:
Selecione	<input type="text"/>	Selecione	Selecione
Book Contraparte:	CPF/CNPJ-Contraparte:	Grupo:	
Selecione	<input type="text"/>	Selecione	
			<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar"/>

As pesquisas das operações podem ser realizadas utilizando apenas um dos filtros ou combinando-os entre si.

Após informar um ou mais campos e acessar o botão “PESQUISAR”. O retorno da pesquisa será apresentado na parte inferior da tela sob a aba “**Termo**” como mostra figura abaixo:

Liquidação Antecipada

▼ Pesquisa

Nº. da Operação: Data Vencimento: Valor em Aberto: Funcionalidade/Indicador:

Book Parte: Data Negociação: Produto: Resultado por pesquisa:

Book Contraparte: CPF/CNPJ-Contraparte: Grupo:

Termo

10 Registros

	Nº. da Operação	Nº. de Controle Interno	Produto	Grupo	Book Parte	Book Contraparte	CNPJ Con
<input type="radio"/>	NDF413006512		NDF	Moeda	20	22	7823627
<input type="radio"/>	NDF413004705		NDF	Moeda	20		3167665
<input type="radio"/>	NDF412003132		NDF	Moeda	20	22	7823627
<input type="radio"/>	NDF412003136		NDF	Moeda	20	22	7823627
<input type="radio"/>	NDF412003157		NDF	Moeda	20	22	7823627
<input type="radio"/>	NDF412003203		NDF	Moeda	20	22	7823627
<input type="radio"/>	NDF413006508		NDF	Moeda	20	22	7823627
<input type="radio"/>	NDF413006511		NDF	Moeda	20	22	7823627
<input type="radio"/>	NDF413004507		NDF	Moeda	20	22	7823627
<input type="radio"/>	NDF413004539		NDF	Moeda	20		3167665

Selecione a operação que se deseja liquidar para acessar o detalhe da operação. O sistema apresentará os detalhes da operação da seguinte forma:

Liquidação Antecipada - Número da Operação: NDF413004694

<p>Participante Registro: BVMF3</p> <p>Operação com Garantia: Não</p> <p>Termo: Moedas</p> <p>Indicador*: Termo Simples</p> <p>Parte</p> <p>CNPJ*: 25903577000134</p> <p>Book*: 21</p> <p>Posição*: Comprador</p> <p>Contraparte</p> <p>CPF/CNPJ*: 31676654000163</p> <p>Book:</p>	<p>Dados da Operação</p> <p>Data Registro: 03/01/2013</p> <p>Data Negociação*: 03/01/2013</p> <p>Data Início Termo*: 03/01/2013</p> <p>Data Vencimento*: 07/01/2014</p> <p>Valor Base/Quantidade*: 150.000,00</p> <p>Moeda / Unidade Base*: MYR</p> <p>Moeda de Cotação*: BRL</p> <p>Objeto de Registro*: Taxa a Termo</p> <p>Valor Objeto de Registro*: 0,68300</p> <p>Câmbio Cruzado USD: Não</p> <p>Ref. Moeda/Unidade Base</p> <p>Fonte de Informação*: BCB</p> <p>Boletim*: PTAX.Compra</p> <p>Ref. Cotação</p> <p>Fonte de Informação*:</p> <p>Boletim*:</p> <p>Critério de determinação do preço de Liquidação: Final</p>	<p>Liquidação</p> <p>Data do Fixing*: T-1</p> <p>Data da Liquidação*: T+0</p> <p>Outros</p> <p>Número de Controle Interno:</p> <p>Calcula MTM: Não</p> <p>Migração</p> <p>Migração: Não</p>
--	---	--

Para dar continuidade na Liquidação Antecipada, o botão “LIQUIDAR ANTECIPADO” deve ser acionado e as informações acordadas entre as partes deverão ser informadas na tela seguinte, conforme segue:

Liquidação Antecipada - Número da Operação: NDF413004694

Data do Lançamento:
17/01/2013

Nº. de Controle Interno:

Base de Liquidação
Valor em Aberto:
150.000,00

Valor Percentual Total

Valor*:
150.000,00

Preço da Liquidação(Taxa de Câmbio)*:
0,00000000

Data Antecipação*:
17/01/2013

Taxa de Juros(%) a.a.*:
0,000000

Taxa de Câmbio para Reais:
0,00000000

Confirmar

Nome do Campo	Descrição
(A) Valor em Aberto	Campo demonstrativo do valor total em aberto da operação selecionada.
(A') Forma de Liquidação	<p>Valor: deverá ser informado um valor mínimo maior que zero, até o limite apresentado, em caso de Liquidação;</p> <p>Percentual: segue a mesma lógica especificada para valor. Em caso de liquidação antecipada parcial, deverá ficar em aberto um saldo remanescente mínimo de R\$ 1000;</p> <p>Total: repetirá o valor em aberto no campo, neste caso, será realizada a liquidação antecipada total da operação (B).</p>
(B) Valor	Valor ou percentual da liquidação antecipada.
(C) Preço da Liquidação	Taxa de câmbio ou paridade de antecipação acordada entre as partes.
(D) Data Antecipação	Data da antecipação em que a operação será efetuada, podendo ser retroativa em até um dia, desde que respeite as regras do período autorizado para liquidação antecipada (a partir do segundo dia útil do registro (D+2) da operação, até o dia útil anterior (D-1) a determinação do preço de liquidação.
(E) Taxa de Juros (%)	Taxa de juros, expressa ao ano, utilizada para trazer a valor presente o fluxo da antecipação.
(F) Taxa de Câmbio para Reais	Taxa de câmbio para conversão do montante financeiro em Reais (BRL), quando a operação for paridade entre moedas estrangeiras.

Para finalizar, clicar em **“CONFIRMAR”**.

Se nenhuma inconsistência for apurada, uma tela de confirmação será apresentada com os detalhes finais da liquidação:

Liquidação Antecipada - Número da Operação: NDF413004694

Data do Lançamento:
17/01/2013

Base de Liquidação:
Total: 150.000,00

Nº. de Controle Interno:

Preço da Liquidação(Taxa de Câmbio):
2,07840000

Data Antecipação:
17/01/2013

Taxa de Juros(%) a.a.:
7,073800

Valor Financeiro em BRL (Parte):
195.853,48 +

Valor Financeiro em BRL (Contraparte):
195.853,48 -

Salvar

Voltar

Caso todas as informações estejam corretas, clicar em **“SALVAR”** para finalizar a operação.

Se a operação for entre Participante e Cliente (comando simples), a operação apresentará uma mensagem de sucesso, conforme tela abaixo. Já em operações entre dois Participantes (comando duplo), o sistema aguardará o segundo comando da liquidação antecipada por parte da contraparte, conforme tela abaixo. Esse comando não sendo realizado até o final do horário do sistema, a solicitação do primeiro Participante será descartada e a operação não será liquidada antecipadamente.

Se por algum motivo o confronto automático das informações não ocorrer, como por exemplo, inconsistência nos dados informados, o sistema acusará as dados incorretos para os participantes para que o erro possa ser corrigido a tempo.

Liquidação Antecipada - Solicitação

Liquidação Antecipada pendente de Lançamento da contraparte.

Nº da Operação Liquidada:
NDF413004694

Número de Controle Interno:

Valor Financeiro em BRL (Parte):
195.853,48 +

Valor Financeiro em BRL (Contraparte):
195.853,48 -

Data Antecipação:
17/01/2013

Data do Lançamento:
17/01/2013

Nova Liquidação

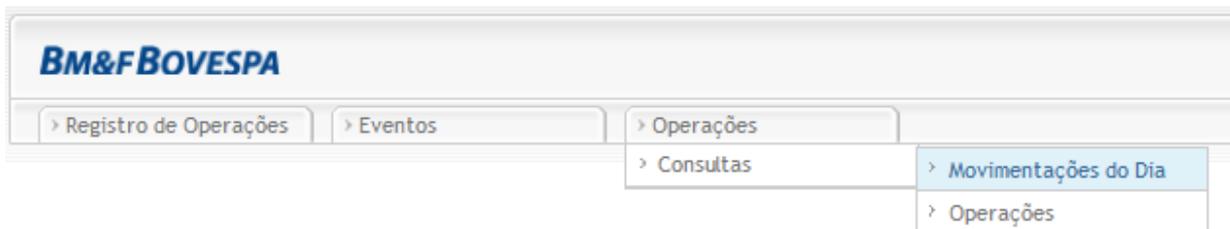
Clicar em **“NOVA LIQUIDAÇÃO”** para retornar a tela inicial de pesquisa de operações disponíveis para liquidação antecipada.

7. Operações

O usuário poderá a qualquer momento verificar as movimentações do dia ou checar as operações realizadas em um período determinado. Essas operações estão disponíveis na aba “OPERAÇÕES” do menu principal.

7.1. Consulta Movimentações do Dia

Acessar a consulta de movimentações do dia através da primeira opção do menu, conforme a ilustração abaixo:



A tela que o sistema apresenta após essa escolha é uma pesquisa refinada pelos diversos campos de preenchimento obrigatório no momento do registro da operação:

Consulta Movimentações do Dia

▼ Pesquisa

<p>Data: 17/01/2013</p> <p>Situação: Selecione</p> <p>Número Protocolo: []</p> <p>Nº. da Operação: []</p> <p>PR Autorizado: 25903577000134</p> <p>Funcionalidade/Indicador: Termo Simples</p>	<p>Parte</p> <p>Book: Selecione</p> <p>Posição: Selecione</p> <p>Contraparte</p> <p>Book: Selecione</p> <p>CPF/CNPJ: []</p> <p>Posição: Selecione</p>	<p>Datas</p> <p>Negociação: [] Vencimento: []</p> <p>Valor Base/Quantidade: []</p> <p>Derivativos</p> <p>Produtos: NDF</p> <p>Grupo: Selecione</p>
---	--	---

Pesquisar Limpar

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

Tela Consulta de Movimentações do Dia	
Nome do Campo	Descrição
(A) Data	Data do dia. Preenchida automaticamente pelo sistema.
(B) Situação	Lista pré-definida de situações em que a movimentação do registro da operação se encontra no sistema. Opções de movimentações possíveis para escolha:

- **Canceladas**
- **Cedidas**
- **Corrigidas**
- **Liquidadas Antecipadamente**
- **Registradas Ativas**
- **Registradas Pendentes Lançamento**
- **Rejeitadas**
- **Retiradas**
- **Transferidas**
- **Vencidas**

(C) Número Protocolo		Código alfanumérico atribuído ao registro.
(D) Número da Operação		Código alfanumérico atribuído automaticamente no ato do registro.
(E) PR Autorizado		Lista pré-definida com os números de CNPJ do Participante do Registro autorizado.
(F) Funcionalidade/Indicador		Lista pré-definida das funcionalidades e indicadores do registro.
Parte	(G) Book	Lista de book contas disponíveis de acordo com o CNPJ da parte selecionado.
	(H) Posição	Se a parte da operação é compradora ou vendedora do registro.
Contraparte	(I) Book	Lista de book contas disponíveis de acordo com o CNPJ da parte selecionado.
	(J) CNPJ	Número do CPF ou CNPJ da contraparte do registro cadastrado.
	(K) Posição	Se a contraparte da operação é compradora ou vendedora do registro.
(L) Data de Negociação		Data em que o Registro da oferta passará a ter validade para operação.
(M) Data de Vencimento		Data do vencimento da operação
(N) Valor Base/Quantidade		Valor da base ou quantidade no formato numérico.
(O) Produtos		Produto balcão que está sendo negociado.
(P) Grupo		Se a operação está vinculada a Moeda, Mercadoria ou Índice. Inicialmente, será disponibilizada somente a opção Moeda

Caso nenhum campo seja informado, o sistema também realiza a pesquisa trazendo todas as movimentações do dia que estiverem na base, na parte inferior da tela.

Movimentações

Termo(206)

206 Registro(s) (1 de 11) [1] [2] [3] [4] [5] [6] [7] [8] [9] [10] Resultados por Página 20

Numero da Operacao	No. Interno Usuário	No. Protocolo	Status	Tipo Pendencia	Produto	Grupo
NDF413009039		P01137015	Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413009042		P01137020	Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413010328		P01138537	Ativa com restrição	Registro	NDF	Moeda
NDF413010253		P01138395	Ativa com restrição	Registro	NDF	Moeda
NDF413009071		P01137055	Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413009077		P01137061	Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413009093			Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413009096			Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413009101			Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413010270		P01138428	Ativa com restrição	Registro	NDF	Moeda
NDF413010322		P01138527	Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413010229		P01138341	Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413010235		P01138350	Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413010277		P01138444	Ativa com restrição	Registro	NDF	Moeda
NDF413010273		P01138436	Ativa com restrição	Registro	NDF	Moeda
NDF413010279		P01138448	Ativa com restrição	Registro	NDF	Moeda
NDF413010280		P01138450	Ativa com restrição	Registro	NDF	Moeda
NDF413010283		P01138455	Ativa com restrição	Registro	NDF	Moeda
NDF413009062		P01137046	Ativa	Registro	NDF	Moeda
NDF413010310		P01138506	Ativa com restrição	Registro	NDF	Moeda

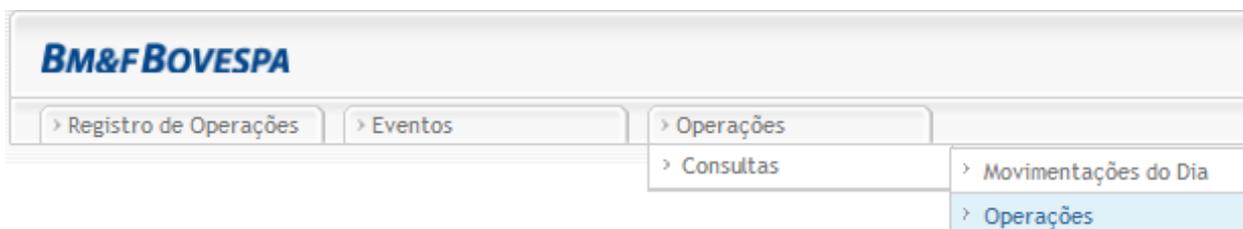
Exportar XLS Exportar CSV

No final da lista, as opções para exportar o resultado da pesquisa estarão disponíveis e o usuário poderá optar em obtê-lo no padrão XLS ou CSV:

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

7.2. Consulta Operações

Acessar a consulta de operações através da segunda opção do menu, conforme a ilustração abaixo:



A realização de pesquisa pode ser feita através da alimentação de múltiplos filtros:

Consulta de Operações

▼ Pesquisa

Derivativos Produtos: <input type="text" value="NDF"/> Grupo: <input type="text" value="Selecione"/>	Parte Book: <input type="text" value="Selecione"/> Posição: <input type="text" value="Selecione"/>	Garantia BVMF <input type="radio"/> Todas <input type="radio"/> Sim <input checked="" type="radio"/> Não Migrada <input checked="" type="radio"/> Todas <input type="radio"/> Sim <input type="radio"/> Não
Situação: <input type="text" value="Selecione"/> Nº. da Operação: <input type="text"/> Funcionalidade/Indicador: <input type="text" value="Termo Simples"/>	Contraparte Book: <input type="text" value="Selecione"/> CPF/CNPJ: <input type="text"/> Posição: <input type="text" value="Selecione"/>	Data de Pesquisa <input checked="" type="radio"/> Registro <input type="radio"/> Início <input type="radio"/> Vencimento <input type="radio"/> Não informar data De: <input type="text" value=""/> Até: <input type="text" value=""/> Valor Base/Quantidade: <input type="text"/> Moeda de Cotação: <input type="text" value="Selecione"/> Moeda / Unidade Base: <input type="text" value="Selecione"/>

Abaixo segue a explicação do que se espera de cada campo:

Nome do Campo		Descrição
(A) Produtos		Tipo de produto: NDF
(B) Grupo		Grupo de ativos do Produto: Moeda, Mercadoria ou Índice.
(C) Situação		<p>Lista pré-definida de situações em que a movimentação do registro da operação se encontra no sistema. Opções de movimentações possíveis para escolha:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Canceladas - Cedidas - Corrigidas - Liquidadas Antecipadamente - Registradas Ativas - Registradas Pendentes Lançamento - Rejeitadas - Retiradas - Transferidas - Vencidas
(D) Número da Operação		Código alfanumérico atribuído automaticamente no ato do registro.
(E) Funcionalidade/Indicador		Lista pré-definida das funcionalidades e indicadores do registro.
(F) PR Autorizado		Lista pré-definida com os números de CNPJ do Participante do Registro autorizado.
Parte	(G) Book	Lista de contas sob responsabilidade da instituição ou participante referente à parte do registro da operação.
	(H) Posição	Se a parte da operação é compradora ou vendedora do registro.
Contraparte	(I) Book	Lista de contas sintéticas ou analíticas de clientes sob responsabilidade da instituição ou participante referente à parte do registro da operação.
	(J) CPF/CNPJ	Número do CPF ou CNPJ da contraparte do registro cadastrado.

(K) Posição	Se a contraparte da operação é compradora ou vendedora do registro.
(L) Garantia BVMF	Escolha dos registros de operações que possuam garantia.
(M) Migração	Opção de selecionar operações migradas .
(N) Data da Pesquisa	Deverá ser escolhido o tipo de data de pesquisa que será realizada: - data de registro - data de início - data de vencimento ou sem seleção.
(O) De	Data inicial do item (N) escolhido.
(P) Até	Data final do item (N) escolhido.
(Q) Valor Base/Quantidade	Valor da base ou quantidade no formato numérico.
(R) Moeda de Cotação	Lista de moedas que a BVMF opera utilizada no fator de cotação.
(S) Moeda/Unidade Base	Lista de todas as moedas operadas pela BM&FBovespa.

Após a consulta, o sistema trará as operações encontradas de acordo com os filtros selecionados. Será possível clicar na linha de uma operação apresentada na tela para acessar os detalhes da mesma, conforme mostra figura a seguir:

Operações

Numero da Operacao	No. Protocolo	No. Interno Usuário	Status	Produto
NDF412003062			Ativa com restrição	NDF
NDF412003119			Ativa com restrição	NDF
NDF412003134			Ativa com restrição	NDF
NDF412003015		TesteR6	Ativa com restrição	NDF
NDF412003132			Ativa com restrição	NDF
<u>NDF412003136</u>			Ativa com restrição	NDF
NDF412003157			Ativa com restrição	NDF
NDF412003203			Ativa com restrição	NDF
NDF412003209			Ativa com restrição	NDF
NDF412003308			Ativa com restrição	NDF

Detalhes da operação são exibidos, ao clicar nas linhas de resultado de pesquisa das telas de movimentações diárias e operações:

Detalhe da Operação: NDF412003136

Participante Registro:
BVMF3

Operação com Garantia:
Não

Termo:

Moedas

Indicador*:

Termo Simples

Parte

CNPJ*:
25903577000134

Book*:
20

Posição*:
Vendedor

Contraparte

CPF/CNPJ*:
78236277000105

Book:
22

Dados da Operação

Data Registro:
26/12/2012

Data Negociação*:
26/12/2012

Data Início Termo*:
26/12/2012

Data Vencimento*:
01/07/2013

Valor Base/Quantidade*:
120.000,00

Moeda / Unidade Base*:
USD

Moeda de Cotação*:
BRL

Objeto de Registro*:
Taxa a Termo

Valor Objeto de Registro*:
2,1000

Câmbio Cruzado USD:
Não

Ref. Moeda/Unidade Base

Fonte de Informação*:
BCB

Boletim*:
USD/BRL BCB PTAX.Venda

Ref. Cotação

Fonte de Informação*:

Boletim*:

Critério de determinação do preço de
Liquidação:
Final

Liquidação

Data do Fixing*:
T-1

Data da Liquidação*:
T+0

Outros

Número de Controle Interno:

Calcula MTM:
Não

Migração

Migração:
Não

Voltar