

# LAYOUT EM IMPLEMENTAÇÃO - CONTRATO A TERMO DE MERCADORIA (COMMODITIES)

## CONTEÚDO

|          |  |          |
|----------|--|----------|
| <b>1</b> | <b>ATUALIZAÇÕES</b> .....                      | <b>3</b> |
| <b>2</b> | <b>ENVIAR ARQUIVOS</b> .....                   | <b>4</b> |
|          | 2.1 Registro de Contrato do Participante ..... | 4        |
| <b>3</b> | <b>RECEBER ARQUIVOS</b> .....                  | <b>7</b> |
|          | 3.1 DPOSICAO (AAAAMMDDPO.TER) .....            | 7        |
|          | 3.2 DMOVIMENTO (AAAAMMDDPO.TER) .....          | 14       |

## 1 ATUALIZAÇÕES

| Atualizado em | Referência   | Atualização   |
|---------------|--|---|
| 03/09/2020    | Registro de Contrato do Participante   | Ajuste da posição do campo “Quantidade Referência1”   |
| 30/06/2020    | Arquivo de Arquivo Registro de Contrato do Participante - Termo de Mercadorias | Disponibilização do layout, conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC. Manual Enviar Arquivos. Inclusão dos campos “Prêmio a ser pago pelo”, “Valor do Prêmio”, “Data de Liquidação” e “Modalidade de Liquidação”.  |
| 30/06/2020    | Arquivo de DPOSICAO (AAAAMMDDPO.TER)   | Disponibilização do layout, conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC. Manual Receber Arquivos. Inclusão dos campos “Atualização do Valor Base”, “Cotação Inicial” e “Valor Base Original”. Campos “Data de Fixação” e “Cotação para fixing” com descrição atualizada na coluna ‘Aplica-se a Termo(s) de:’.<br><br>Disponibilização do layout, conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC. Campos “Prêmio a ser pago pelo”, “Valor do Prêmio”, “Modalidade de Liquidação” e “Data de Liquidação do Prêmio” serão aplicáveis para Termo de Mercadorias. |
| 30/06/2020    | Arquivo de DMOVIMENTO (AAAAMMDDPO.TER)   | Disponibilização do layout, conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC. Manual Receber Arquivos. Campos “Prêmio a ser pago pelo”, “Valor do Prêmio”, “Modalidade de Liquidação” e “Data de Liquidação do Prêmio” serão aplicáveis para Termo de Mercadorias.   |

### Observação

Os campos tarjados em amarelo são campos novos.

Os campos tarjados em azul foram alterados no arquivo.

## 2 ENVIAR ARQUIVOS

|  |
|--|
| <b>Termo de Mercadorias</b>  |
| <b>Nome do Arquivo</b>   |
| <b>2.1 Registro de Contrato do Participante</b>  |
| <b>Descrição:</b> Este layout permite efetuar o registro de Contratos a Termo de Mercadoria. |

### Observação

Os campos tarjados em amarelo são campos novos no arquivo de Registro de Contrato do Participante

Os campos tarjados em azul foram alterados no arquivo de Registro de Contrato do Participante.

| Header |       |         |         |          |  |
|--------|-------|---------|---------|----------|--|
| Seq    | Campo | Formato | Posição | Conteúdo | Descrição                              |
| 01     | Data  | X(10)   | 1-10    |          | Data da operação. Formato: AAAA-MM-DD. |

| Registro |                                    |         |         |          |   |
|----------|------------------------------------|---------|---------|----------|---|
| Seq      | Campo                              | Formato | Posição | Conteúdo | Descrição   |
| 01       | Id.Sist.                           | X(05)   | 1-5     | TERMO    | Código identificador do sistema.  |
| 02       | C.Op.                              | 9(04)   | 6-9     | 0004     | Código identificador da operação.   |
| 03       | Nº Controle Interno                | X(10)   | 10-19   |          | 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. |
| 04       | Lançamento do Participante (Conta) | 9(08)   | 20-27   |          | Código CETIP do Participante que está acessando o sistema e, conseqüentemente, intermediando a operação entre dois de seus clientes.  |
| 05       | Posição do Participante            | 9(01)   | 28-28   | 0 e 1.   | Código identificador do papel que a parte realiza na operação.<br>0 – Comprador e 1 – Vendedor  |
| 06       | CPF/CNPJ da Parte                  | 9(14)   | 29-42   |          | CPF/CNPJ se Parte for Conta 10 ou 20.<br>Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. E as combinações possíveis são: Propria X Propria, Cliente X Propria, Cliente X Cliente.  |
| 07       | Cesta Garantias da Parte           | 9(01)   | 43-43   | S e N.   | Indica se Parte possui garantias.<br>S = SIM N = NÃO  |
| 08       | Contraparte (Conta)                | 9(08)   | 44-51   |          | Código CETIP do Participante que representa a contraparte do lançamento.<br>Sem ponto e traço   |
| 09       | CPF/CNPJ da Contraparte            | 9(14)   | 52-65   |          | CPF/CNPJ se Contraparte for Conta 10 ou 20. Não é permitida a   |

|    |                                |       |       |       |   |
|----|--------------------------------|-------|-------|-------|---|
|    |                                |       |       |       | realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. E as combinações possíveis são: Propria X Propria, Cliente X Propria, Cliente X Cliente. |
| 10 | Cesta Garantias da Contraparte | 9(01) | 66-66 | S e N | Indica se Parte possui garantias.<br>S = SIM N = NÃO  |

(continua)

| Registro |  |            |         |                 |   |
|----------|--|------------|---------|-----------------|---|
| Seq      | Campo  | Formato    | Posição | Conteúdo        | Descrição   |
| 11       | Data de Operação                             | 9(08)      | 67-74   |                 | Data em que o Participante contratou a operação. Pode ser informada até D-2 à data do sistema, quando a contraparte na operação é um de seus clientes, tipo conta10. Formato: AAAAMMDD      |
| 12       | Data de Vencimento                           | 9(08)      | 75-82   |                 | Data útil da apuração do resultado. Livremente pactuada entre os Participantes.<br>Formato: AAAAMMDD  |
| 13       | Bolsa Referência                             | X(40)      | 83-122  |                 | Nome da Bolsa de Referência.  |
| 14       | Commodity                                    | X(60)      | 123-182 |                 | Nome da Commodity negociada.  |
| 15       | Tipo   | X(60)      | 183-242 |                 | Nome do tipo.   |
| 16       | Unidade de Negociação                        | X(40)      | 243-282 |                 | Nome da unidade de Negociação.  |
| 17       | Quantidade                                   | 9(20)      | 283-302 |                 | Tamanho do contrato expresso na unidade de negociação.  |
| 18       | Preço da Operação                            | 9(12)V9(4) | 303-318 |                 | Preço da operação, expresso na moeda e unidade de negociação disponível para o contrato   |
| 19       | Moeda Cotada                                 | 9(03)      | 319-321 |                 | Código da moeda Cotada.   |
| 20       | Fonte Informação                             | 9(01)      | 322-322 | 0               | Exibe o nome da fonte utilizada para apuração da do preço de ajuste.<br>0 – REUTERS   |
| 21       | Mês de Vencimento                            | 9(2)       | 323-324 |                 | Preenchimento obrigatório.  |
| 22       | Ano de Vencimento                            | 9(4)       | 325-328 |                 | Preenchimento obrigatório.  |
| 23       | Fonte de Informação para conversão da moeda. | 9(01)      | 329-329 | 0               | Indica a fonte a ser utilizada para cotação da moeda. 0 – SISBACEN  |
| 24       | Paridade para Liquidação                     | 9(01)      | 330-330 | 0, 1, 2 e 3.    | Indica a paridade utilizada para atualização do contrato.<br>0 – Boletim PTAX800 11:00h<br>1 – Boletim PTAX800 12:00h<br>2 – Boletim PTAX800 15:30h<br>3 – Boletim PTAX800 18:00 Fechamento |
| 25       | Data da Cotação para Ajuste                  | 9(01)      | 331-331 | 1, 2, 3, 4 e 5. | Deslocamento na apuração do resultado. Indica se será utilizada a cotação de 1 - D-1;<br>2 - D-2; 3 - D-3; 4- D-4; ou 5 - D-5 para a avaliação final do contrato.                           |
| 26       | Tipo Ajuste                                  | X(01)      | 332-332 | D, P, F, L e R. | Tipo de Ajuste: D – Diário; P – Periódico; F – Final; L – Final: Asiático Simples; e R – Final Asiático Ponderado.  |

|    |                                    |        |         |                 |   |
|----|------------------------------------|--------|---------|-----------------|---|
| 27 | Observação                         | X(280) | 333-612 |                 | O campo não deve ser preenchido pelo participante.  |
| 28 | Cotação de Moeda para o Vencimento | 9(01)  | 613-613 | 1, 2, 3, 4 e 5. | Deslocamento na apuração do resultado. Indica se será utilizada a cotação de 1 – D-1; 2 – D-2; 3 – D-3; 4 – D-4; ou 5 – D-5 para a avaliação final do contrato. |

(continua)

| Registro |                          |            |         |          |   |
|----------|--------------------------|------------|---------|----------|---|
| Seq      | Campo                    | Formato    | Posição | Conteúdo | Descrição   |
| 29       | Código Identificador     | X(14)      | 614-627 |          | Código Identificador<br>Preenchimento não obrigatório.  |
| 30       | Taxa a Termo em Reais?   | X(1)       | 628-628 | S ou N   | Preenchimento obrigatório.  |
| 31       | Prêmio a ser pago pelo   | X(1)       | 629-629 | C ou V   | Campo destinado a informar o responsável a pagar o prêmio. Comprador ou Vendedor.   |
| 32       | Valor do Prêmio          | 9(14)V9(2) | 630-645 |          | Campo destinado a informar valores para o prêmio  |
| 33       | Data de Liquidação       | 9(08)      | 646-653 |          | Indica a data de liquidação do prêmio.<br>Formato: AAAAMMDD   |
| 34       | Modalidade de Liquidação | X(1)       | 654-654 | 0, 1 e 2 | Tipo da modalidade de liquidação da operação de prêmio.<br>0 - Bilateral<br>1 - Bruta<br>2 - Sem Modalidade   |
| 35       | Data de Ajuste1          | 9(08)      | 655-662 |          | Preenchimento obrigatório no caso de contrato com tipo de ajuste Periódico, Asiático Simples e Asiático Ponderado. Data de Ajuste 1 (Periódico, Asiático Simples e Asiático Ponderado)<br>Formato: AAAAMMDD |
| 36       | Quantidade Referência1   | 9(16)      | 663-678 |          | Quantidade Referência1 (Asiático Ponderado)   |
| 37       |                          |            | 679-N   |          | Ver observação  |

(fim)

**Observação:** A partir da posição 679 pode repetir os campos “Data Ajuste” e “Quantidade Referência” em quantas ocorrências forem necessárias.

### 3 RECEBER ARQUIVOS

|   |
|---|
| <b>Termo de Moedas, Paridade Asiático e de Mercadorias.</b> |
| Nome do Arquivo   |
| <b>3.1 DPOSICAO (AAAAMMDDPO.TER)</b>                        |
| <b>Descrição:</b>   |

#### Observação

Os campos tarjados em amarelo são campos novos no arquivo de DPOSICAO (AAAAMMDDPO.TER)

Os campos tarjados em azul foram alterados no arquivo de DPOSICAO (AAAAMMDDPO.TER)

| Seq. | Campo                                    | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|--|--|---|
| 01   | Data do Arquivo                          | Data de criação do arquivo<br>Formato: AAAAMMDD                    | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 02   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 03   | Código da Parte                          | Código CETIP do Participante que representa a parte do lançamento. | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 04   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 05   | Nome da Parte                            | Nome do Participante Parte.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 06   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 07   | CPF/CNPJ do Participante                 | Código do CPF/CNPJ do Participante                                 | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 08   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 09   | Indicador de Cesta Garantia Participante | Indica se Participante tem Cesta Garantia S ou N                   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 10   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 11   | Código Cesta Garantia Participante       | Código da Cesta Garantia do Participante                           | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 12   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 13   | Data de Vencimento                       | Data de vencimento do contrato.<br>Formato: AAAAMMDD               | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 14   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 15   | Contrato                                 | Código do contrato.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 16   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 17   | Data de Emissão                          | Data de Emissão do contrato.<br>(AAAAMMDD)                         | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 18   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 19   | Data de Início de Vigência               | Data de início da vigência do contrato.<br>Formato: AAAAMMDD.      | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 20   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 21   | Código da Contraparte                    | Código CETIP do Participante contraparte do contrato.              | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 22   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 23   | Nome da Contraparte                      | Nome do Participante Contraparte.                                  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 24   | Separador                                | Ponto e vírgula (;).   |   |

| Seq. | Campo                   | Descrição/Conteúdo                | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|-------------------------|-----------------------------------|---|
| 25   | CPF/CNPJ da Contraparte | Código do CPF/CNPJ da Contraparte | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 26   | Separador               | Ponto e vírgula (;).              |   |

(continua)

| Seq. | Campo                                   | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|---|--|---|
| 27   | Indicador de Cesta Garantia Contraparte | Indica se Contraparte tem Cesta Garantia S ou N  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 28   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 29   | Código Cesta Garantia Contraparte       | Código da Cesta Garantia da Contraparte  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 30   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 31   | Código Sisbacen da Moeda                | Código Sisbacen da Moeda do contrato. Veja tabela em anexo.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 32   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 33   | Símbolo da Moeda                        | Símbolo da Moeda do contrato.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 34   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 35   | Valor Base no registro                  | Valor Nominal na emissão do contrato, na moeda do contrato. Editado com vírgula decimal.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 36   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 37   | Valor Base atual                        | Valor Base atualizado em Reais. Não será calculado para contratos registrados com Cross-Rate, Feeder ou Spot. Editado com vírgula decimal. | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 38   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 39   | Valor Antecipado                        | Total das antecipações sobre o contrato, na moeda do contrato. Editado com vírgula decimal.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 40   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 41   | Taxa Forward                            | Taxa Forward no Registro. Editado com vírgula decimal.   | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 42   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 43   | Posição do Participante                 | Código do Papel do Participante:<br>0=Comprador; 1=Vendedor.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 44   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 45   | Descrição da posição do Participante    | Descritivo do Papel do Participante:<br>COMPRADOR; VENDEDOR.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 46   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 47   | Cross-Rate                              | Seleção de Cross-rate:<br>SIM ou NAO   | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 48   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 49   | Data de Alteração                       | Data de alteração do contrato se houver.<br>Formato: AAAAMMDD.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 50   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 51   | Situação do Contrato                    | Situação atual do contrato.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 52   | Separador                               | Ponto e vírgula (;).   |   |

(continua)

| Seq. | Campo                              | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|------------------------------------|--|---|
| 53   | Tipo do Contrato                   | Tipo do contrato relacionado com a fonte de consulta para a cotação do contrato: SISBACEN; FEEDER; SPOT OU SISBACEN/FEEDER.                | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 54   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 55   | Código do Boletim                  | Código do Boletim utilizado para atualizar a cotação do contrato. 0=11h; 1=12h; 2=15h30minh; 3=18h.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 56   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 57   | Horário do Boletim                 | Horário do Boletim utilizado para atualizar a cotação do contrato. (HH:MM)   | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 58   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 59   | Código da Cotação                  | Dia utilizado em relação ao vencimento para obter a taxa para avaliação do contrato: 0=D0 ; 1=D-1 ; 2=D-2 ; 3=D-3                          | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 60   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 61   | Taxa de Câmbio                     | Taxa Forward (taxa atual) Editado com sinal e vírgula decimal.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 62   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 63   | Taxa de Paridade                   | Taxa de Paridade (se o contrato tiver paridade). Editado com sinal e vírgula decimal.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 64   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 65   | Cotação de Moeda para o Vencimento | Dia utilizado em relação ao vencimento para obter a taxa para avaliação do contrato: 1=D-1 ; 2=D-2 ; 3=D-3 ; 4=D-4 ; 5=D-5                 | Mercadorias.                            |
| 66   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 67   | Nome do Feeder                     | Nome do Feeder se for o caso de contrato feeder.   | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 68   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 69   | Tela função Consulta               | Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que será utilizada pelos Participantes para obtenção da cotação. | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 70   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 71   | Praça de Negociação                | Texto livre. Referência à praça de negociação a ser utilizada em contratos Feeder, Spot e Sisbacen/Feeder.                                 | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 72   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |   |

(continua)

| Seq. | Campo                | Descrição/Conteúdo  | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|----------------------|---|---|
| 73   | Horário da Consulta  | Texto livre. Referência ao horário de apuração da consulta para contratos Feeder, Spot e Sisbacen/Feeder.             | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 74   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 75   | Tipo de Cotação      | Tipo de cotação da moeda de referência utilizada em contratos Feeder, Spot e Sisbacen/Feeder: COMPRA ; VENDA ou MEDIA | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 76   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 77   | Tipo de Paridade     | Tipo de taxa de Paridade (se o contrato tiver paridade): COMPRA ; VENDA ; MEDIA ou NENHUM                             | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 78   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 79   | Data de Avaliação    | Data a ser utilizada para obter as cotações visando avaliar o contrato.<br>Formato: AAAAMMDD                          | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 80   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 81   | Comissão             | Taxa de comissão caso exista intermediação.<br>Editado com vírgula decimal.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 82   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 83   | Momento do Pagamento | Momento do pagamento da intermediação.<br>INICIO.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 84   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 85   | Código do Cedente    | Código CETIP do Participante cedente no caso do contrato ter sido cedido.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 86   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 87   | Código do Adquirente | Código CETIP do Participante adquirente no caso do contrato ter sido cedido.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 88   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 89   | Código do Anuente    | Código CETIP do Participante anuente no caso do contrato ter sido cedido.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 90   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 91   | Contrato de Origem   | Contrato de origem para o caso de o contrato ter sido cedido.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 92   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 93   | Contrato Global      | Indica se o contrato é Global ou não:<br>SIM ou NÃO   | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 94   | Separador            | Ponto e vírgula (;).  |   |

(continua)

| Seq. | Campo                                | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:        |
|------|--------------------------------------|--|---------------------------------|
| 95   | Código Sisbacen da Moeda Cotada      | Código Sisbacen da Moeda Cotada no caso de contrato de Paridades/Asiático<br>Veja tabela em anexo.   | Paridade Asiático               |
| 96   | Separador                            | Ponto e vírgula (;)  |                                 |
| 97   | Tipo Média Asiático                  | Tipo da média utilizada na apuração no contrato Asiático.  | Paridade Asiático               |
| 98   | Separador                            | Ponto e vírgula (;)  |                                 |
| 99   | Tipo Indicador Financeiro            | Código do Tipo de Indicador Financeiro do contrato   | Paridade Asiático e Mercadorias |
| 100  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |                                 |
| 101  | Indicador de Termo a Termo           | Indica se o contrato é Termo a Termo   | Paridade Asiático               |
| 102  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |                                 |
| 103  | Data de Fixação                      | Para contrato Termo a Termo, data em que o contrato terá início. Para contratos com "Atualizar Valor Base?" = SIM, também indica a data de fixing para atualização do valor base, a qual será aplicada o deslocamento informado no campo "Cotação para fixing" para captura da cotação final para atualização do valor base. | Moeda e Paridade Asiático       |
| 104  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |                                 |
| 105  | Forma de Atualização da taxa a termo | Para contrato Termo a Termo, indica qual será a forma de atualização da taxa inicial a ser apurada na data de início do contrato   | Paridade Asiático               |
| 106  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |                                 |
| 107  | Valor ou Percentual Negociado        | Para contrato Termo a Termo, campo destinado a informar o valor ou o percentual negociado para ser aplicado na data de início do contrato  | Paridade Asiático               |
| 108  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |                                 |
| 109  | Ajustar Taxa                         | Campo destinado a informar se ocorrerá ajuste de taxa no contrato.   | Paridade Asiático               |
| 110  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |                                 |
| 111  | Responsável pelo Ajuste de Taxa      | Campo destinado a informar o responsável pelo ajuste da taxa   | Paridade Asiático               |
| 112  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |                                 |
| 113  | Data inicial para o ajuste da taxa   | Campo destinado a informar a data inicial para o ajuste da taxa  | Paridade Asiático               |
| 114  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |                                 |
| 115  | Data final para o ajuste da taxa     | Campo destinado a informar a data final para o ajuste da taxa  | Paridade Asiático               |

|     |                        |   |                   |
|-----|------------------------|---|-------------------|
| 116 | Separador              | Ponto e vírgula (;).  |                   |
| 117 | Data do Ajuste da Taxa | Campo destinado a informar a data de quando foi ajustado a Taxa Forward | Paridade Asiático |
| 118 | Separador              | Ponto e vírgula (;).  |                   |
| 119 | Limites                | Campo destinado para informar o tipo de limite no contrato              | Paridade Asiático |

(continua)

| Seq. | Campo                     | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:         |
|------|---------------------------|--|----------------------------------|
| 120  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 121  | Valor Superior            | Campo destinado para informar o valor do limite superior no contrato | Paridade Asiático                |
| 122  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 123  | Valor Inferior            | Campo destinado para informar o valor do limite inferior no contrato | Paridade Asiático                |
| 124  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 125  | Prêmio a ser pago pelo    | Campo destinado a informar o responsável a pagar o prêmio            | Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 126  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 127  | Valor do Prêmio           | Campo destinado a informar valores para o prêmio                     | Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 128  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 129  | Modalidade de Liquidação  | Tipo da modalidade de liquidação da operação de prêmio.              | Paridade Asiático e Mercadorias  |
| 130  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 131  | Bolsa Referência          | Descrição da Bolsa de Referência. (Fonte Apuração)                   | Mercadorias                      |
| 132  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 133  | Indicador Financeiro      | Nome do Indicador Financeiro (Commodity / Mercadoria)                | Mercadorias                      |
| 134  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 135  | Critério de Apuração      | Descrição do Critério de Apuração (Tipo de Critério)                 | Mercadorias                      |
| 136  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 137  | Unidade de Negociação     | Unidade de Medida de negociação                                      | Mercadorias                      |
| 138  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 139  | Fonte de Informação       | Fonte de Informação  | Mercadorias                      |
| 140  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 141  | Mês Vencimento            | Mês de Vencimento do Grupo de Commodity                              | Mercadorias                      |
| 142  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 143  | Ano de Vencimento         | Ano de Vencimento do Grupo de Commodities                            | Mercadorias                      |
| 144  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 145  | Quantidade de Commodities | Quantidade de Commodities  | Mercadorias                      |
| 146  | Separador                 | Ponto e vírgula (;).   |                                  |

|     |                       |                                      |   |
|-----|-----------------------|--------------------------------------|---|
| 147 | Quantidade Antecipada | Quantidade de Commodities Antecipada | Mercadorias                             |
| 148 | Separador             | Ponto e vírgula (;).                 |   |
| 149 | Preço de Operação     | Preço de Operação                    | Mercadorias                             |
| 150 | Separador             | Ponto e vírgula (;).                 |   |
| 151 | Observação            | Observação do contrato               | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 152 | Separador             | Ponto e vírgula (;).                 |   |

(continua)

| Seq. | Campo                        | Descrição/Conteúdo  | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|------------------------------|---|---|
| 153  | Código Identificador         | Descrição do Código Identificador   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 154  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 155  | Data da Última Correção      | Data da Última Correção   | Moeda e Paridade Asiático               |
| 156  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 157  | Data do Último Aditamento    | Data do Último Aditamento   | Moeda e Paridade Asiático               |
| 158  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 159  | Cotação para Fixing          | Dia utilizado em relação ao vencimento para obter a taxa para avaliação do contrato: 0=D-0 ; 1=D-1 ; 2=D-2 ; 3=D-3 ; 4=D-4 ; 5=D-5. Campo para o cálculo da moeda de início do período do Termo. Para contrato Atualizar Valor Base?" = SIM, também indica o deslocamento a ser aplicado na data informada no campo "Data de Fixação" para captura da cotação final para atualização do valor base. | Moeda e Paridade Asiático               |
| 160  | Separador                    | Ponto e virgula(;).   |   |
| 161  | Taxa a Termo em Reais?       | Indica que a Taxa a Termo da Commodity está cotada em BRL   | Moedas, Paridade Asiático e Mercadorias |
| 162  | Separador                    | Ponto e virgula(;).   |   |
| 163  | Data de Liquidação do Prêmio | Indica a data de liquidação do prêmio   | Paridade Asiático e Mercadorias         |
| 164  | Separador                    | Ponto e virgula(;).   | Separador                               |
| 165  | Atualizar Valor Base?        | Indica se o valor base do contrato será atualizado no período a termo   | Moeda                                   |
| 166  | Separador                    | Ponto e virgula(;).   | Separador                               |
| 167  | Cotação Inicial              | Cotação inicial da paridade que será utilizada para a atualização do valor base no período a termo.   | Moeda                                   |
| 168  | Separador                    | Ponto e virgula(;).   | Separador                               |

|     |                     |  |  |
|-----|---------------------|--|--|
| 169 | Valor Base Original | Valor base do contrato informado na data de registro, expresso em quantidades da moeda base.                             | Moeda  |
| 170 | Separador           | Ponto e vírgula(;).  |  |
| 171 | Data Verificação 1  | Data de Verificação 1. Formato: AAAAMMDD   | Paridade Asiático e Mercadorias com ajuste periódico |
| 172 | Separador           | Ponto e vírgula (;)  |  |
| 173 | Valor Referência 1  | Valor de Referência 1 da data de Verificação. Somente preenchido para tipo média PONDERADA. Editado com vírgula decimal. | Paridade Asiático                                    |
| 174 | Separador           | Ponto e vírgula (;)  |  |
| 175 | Data Verificação 2  | Data de Verificação 2. Formato: AAAAMMDD   | Paridade Asiático e Mercadorias com ajuste periódico |
| 176 | Separador           | Ponto e vírgula (;)  |  |
| 177 | Valor Referência 2  | Valor de Referência 2 da data de Verificação. Somente preenchido para tipo média PONDERADA. Editado com vírgula decimal. | Paridade Asiático                                    |
| 178 | Separador           | Ponto e vírgula (;)  |  |
| 179 | Data Verificação N  | Data de Verificação N. Formato: AAAAMMDD   | Paridade Asiático e Mercadorias com ajuste periódico |
| 180 | Separador           | Ponto e vírgula (;)  |  |
| 181 | Valor Referência N  | Valor de Referência N da data de Verificação. Somente preenchido para tipo média PONDERADA. Editado com vírgula decimal. | Paridade Asiático e Mercadorias com ajuste periódico |

(fim)

**Observação:**

- Os contratos com ajuste periódico (Commodity periódico ou Moeda Asiático) serão exibidos com datas e valores relativos. O comprimento, nestes casos, pode aumentar de acordo com a quantidade de datas de verificação ou datas de ajuste do contrato em questão (estes registros não muito frequentes). Para outros tipos de contrato estes campos ficam vazios.

| Termo de Moedas, Paridade Asiático e de Mercadorias |  |
|---|--|
| Nome do Arquivo                                     |  |
| <b>3.2 DMOVIMENTO (AAAAMMDDPO.TER)</b>              |  |
| Descrição:  |  |

**Obs: Os campos tarjados em azul foram alterados no arquivo de DMOVIMENTO (AAAAMMDDPO.TER)**

| Seq. | Campo            | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|------------------|--|---|
| 01   | Data da Operação | Data de criação da operação. Formato: AAAAMMDD                     | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 02   | Separador        | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 03   | Código da Parte  | Código CETIP do Participante que representa a parte do lançamento. | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 04   | Separador        | Ponto e vírgula (;).   |   |

| Seq. | Campo                      | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|----------------------------|--|---|
| 05   | Nome da Parte              | Nome do Participante Parte.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 06   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 07   | Cpf/Cnpj da Parte          | Código do Cpf/Cnpj do participante Parte                                 | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 08   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 09   | Contrato                   | Código do contrato.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 10   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 11   | Número de Controle         | Texto livre de uso do Participante em seu lançamento.                    | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 12   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 13   | Tipo da Operação           | Tipo da operação.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 14   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 15   | Código do Tipo da Operação | Código numérico do tipo da Operação.<br>Veja tabela em anexo.            | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 16   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 17   | Motivo da Pendência        | Descrição do Motivo da Pendência   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 18   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 19   | Código da Contraparte      | Código CETIP do Participante que representa a contraparte do lançamento. | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 20   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 21   | Nome da Contraparte        | Nome do Participante Contraparte.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 22   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 23   | Cpf/Cnpj da ContraParte    | Código do Cpf/Cnpj do participante ContraParte                           | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 24   | Separador                  | Ponto e vírgula(;).  |   |
| 25   | Data de Início de Vigência | Data de início da vigência do contrato.<br>Formato: AAAAMMDD             | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 26   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 27   | Data de Vencimento         | Data de vencimento do contrato.<br>Formato: AAAAMMDD                     | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 28   | Separador                  | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 29   | Valor Financeiro           | Valor Financeiro da Operação.<br>Editado com sinal e vírgula decimal.    | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |

(continua)

| Seq. | Campo                    | Descrição/Conteúdo                                       | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|--------------------------|--|---|
| 30   | Separador                | Ponto e vírgula (;).                                     |   |
| 31   | Operação Original        | Numero da Operação original quando se tratar de estorno. | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 32   | Separador                | Ponto e vírgula (;).                                     |   |
| 33   | Código Sisbacen da Moeda | Código Sisbacen da Moeda do contrato.<br>Veja tabela.    | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 34   | Separador                | Ponto e vírgula (;).                                     |   |
| 35   | Símbolo da Moeda         | Símbolo da Moeda do contrato.                            | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 36   | Separador                | Ponto e vírgula (;).                                     |   |

| Seq. | Campo                                | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|--------------------------------------|--|---|
| 37   | Valor Base no Registro               | Valor Base no Registro do contrato, na moeda do contrato. Editado com vírgula decimal.   | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 38   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 39   | Valor Base atual                     | Valor Base atualizado em Reais Não será calculado para contratos registrados com Cross-Rate, Feeder ou Spot. Editado com vírgula decimal.                                      | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 40   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 41   | Taxa Forward                         | Taxa Forward no Registro. Editado com vírgula decimal.   | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 42   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 43   | Posição do Participante              | Código do Papel do Participante:<br>0=Comprador; 1=Vendedor; 2=Devedor;<br>3=Credor; 4=Cessionário; 5=Cedente;<br>6=Adquirente; 7=Anuente;<br>8=Intermediador; 9=Intermediado. | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 44   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 45   | Descrição da posição do Participante | Descritivo do Papel do Participante:<br>COMPRADOR; VENDEDOR;<br>DEVEDOR; CREDOR.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 46   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 47   | Cross-Rate                           | Seleção de Cross-rate: SIM ou NAO  | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 48   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 49   | Tipo do Contrato                     | Tipo do contrato relacionado com a fonte de consulta para a cotação do contrato:<br>SISBACEN; FEEDER; SPOT OU SISBACEN/FEEDER.   | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 50   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 51   | Código do Boletim                    | Código do Boletim utilizado para atualizar a cotação do contrato.<br>0=11h ; 1=12h ; 2=15:30h ; 3=18h  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 52   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 53   | Horário do Boletim                   | Horário do Boletim utilizado para atualizar a cotação do contrato.<br>(HH:MM)  | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 54   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 55   | Código da Cotação                    | Dia utilizado em relação ao vencimento para obter a taxa para avaliação do contrato: 0=D0; 1=D-1; 2=D-2; 3=D-3   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 56   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |

(continua)

| Seq. | Campo                              | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:   |
|------|------------------------------------|--|----------------------------|
| 57   | Cotação de Moeda para o Vencimento | Dia utilizado em relação ao vencimento para obter a taxa para avaliação do contrato: 1=D-1 ; 2=D-2 ; 3=D-3 ; 4=D-4 ; 5=D-5 | Mercadorias.               |
| 58   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                            |
| 59   | Nome do Feeder                     | Nome do Feeder se for o caso de contrato feeder.   | Moeda e Paridade Asiático. |
| 60   | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                            |
| 61   | Tela Função Consulta               | Nome da função de consulta ou código da tela disponibilizada pelo Feeder, que será   | Moeda e Paridade Asiático. |

| Seq. | Campo                 | Descrição/Conteúdo  | Aplica-se a Termo(s) de:                        |
|------|-----------------------|---|---|
|      |                       | utilizada pelos Participantes para obtenção da cotação.   |   |
| 62   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 63   | Praça de Negociação   | Local de negociação da moeda de referência.   | Moeda e Paridade Asiático.                      |
| 64   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 65   | Horário da Consulta   | Horário da consulta no Feeder no caso de contrato feeder.   | Moeda e Paridade Asiático.                      |
| 66   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 67   | Tipo de Cotação       | Tipo de cotação da moeda de referência utilizada em contratos Feeder, Spot e Sisbacen/Feeder: COMPRA; VENDA ou MEDIA. | Moeda e Paridade Asiático.                      |
| 68   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 69   | Tipo de Paridade      | Tipo de taxa de Paridade (se o contrato tiver paridade): COMPRA; VENDA; MEDIA ou NENHUM.                              | Moeda e Paridade Asiático.                      |
| 70   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 71   | Data de Avaliação     | Data de avaliação do contrato se houver. Formato: AAAAMMDD  | Moeda e Paridade Asiático.                      |
| 72   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 73   | Valor Antecipado      | Valor antecipado, na moeda do contrato. Editado com vírgula.  | Moeda e Paridade Asiático.                      |
| 74   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 75   | Taxa de Reversão      | Taxa da cotação de Referência para antecipação. Editado com vírgula decimal.  | Moeda, Paridade Asiático, Índice e Mercadorias. |
| 76   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  | Separador                                       |
| 77   | Cotação de Referência | Taxa da cotação de Referência para atualização de taxas. Editado com vírgula decimal.                                 | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias.         |
| 78   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 79   | Taxa de Paridade      | Taxa de Paridade (se o contrato tiver paridade). Editado com vírgula decimal.   | Moeda e Paridade Asiático.                      |
| 80   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 81   | Comissão              | Taxa de comissão caso exista intermediação. Editado com vírgula decimal.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias.         |
| 82   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 83   | Momento do Pagamento  | Momento do pagamento da intermediação. INICIO.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias.         |
| 84   | Separador             | Ponto e vírgula (;).  |   |
| 85   | Código do Cedente     | Código CETIP do Participante cedente no caso do contrato ter sido cedido.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias.         |

(continua)

| Seq. | Campo                | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|----------------------|--|---|
| 86   | Separador            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 87   | Código do Adquirente | Código CETIP do Participante adquirente no caso do contrato ter sido cedido. | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 88   | Separador            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 89   | Código do Anuente    | Código CETIP do Participante anuente no caso do contrato ter sido cedido.    | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 90   | Separador            | Ponto e vírgula (;).   |   |

| Seq. | Campo                                | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:                |
|------|--------------------------------------|--|---|
| 91   | Modalidade de Liquidação             | Tipo da modalidade de liquidação da operação: SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO; BRUTA; BILATERAL.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 92   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 93   | Código do Liquidante                 | Código CETIP do liquidante do Participante parte, se a operação tiver modalidade de liquidação.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 94   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 95   | Situação da Operação                 | Situação da Operação.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 96   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 97   | Código da situação da operação       | Código numérico da situação da operação. Veja tabela.  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 98   | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 99   | Contrato Global                      | Indica se o contrato é Global ou não: SIM ou NÃO.  | Moeda e Paridade Asiático.              |
| 100  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 101  | Código Sisbacen da Moeda Cotada      | Código Sisbacen da Moeda Cotada no caso de contrato de Paridade/Asiático. Veja Tabela em anexo.  | Paridade Asiático                       |
| 102  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 103  | Símbolo da Moeda Cotada              | Símbolo da Moeda Cotada no caso de Contrato de Paridade/Asiático.  | Paridade Asiático                       |
| 104  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 105  | Tipo Média Asiático                  | Tipo da média utilizada na apuração do contrato Asiático.  | Paridade Asiático                       |
| 106  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 107  | Tipo Indicador Financeiro            | Código do Tipo de Indicador Financeiro do contrato   | Paridade Asiático e Mercadorias         |
| 108  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 109  | Indicador de Termo a Termo           | Indica se o contrato é Termo a Termo   | Paridade Asiático                       |
| 110  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 111  | Data de Fixação                      | Para contrato Termo a Termo, indica a data em que o contrato terá o seu início   | Paridade Asiático                       |
| 112  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 113  | Forma de Atualização da taxa a termo | Para contrato Termo a Termo, indica qual será a forma de atualização da taxa inicial a ser apurada na data de início do contrato         | Paridade Asiático                       |
| 114  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |
| 115  | Valor ou Percentual Negociado        | Para contrato Termo a Termo, ampo destinado a informar o valor ou o percentual negociado para ser aplicado na data de início do contrato | Paridade Asiático                       |
| 116  | Separador                            | Ponto e vírgula (;).   |   |

(continua)

| Seq. | Campo                           | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de: |
|------|---------------------------------|--|--------------------------|
| 117  | Ajustar Taxa                    | Campo destinado a informar se ocorrerá ajuste de taxa no contrato. | Paridade Asiático        |
| 118  | Separador                       | Ponto e vírgula (;).   |                          |
| 119  | Responsável pelo Ajuste de Taxa | Campo destinado a informar o responsável pelo ajuste da taxa       | Paridade Asiático        |
| 120  | Separador                       | Ponto e vírgula (;).   |                          |

| Seq. | Campo                              | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:         |
|------|------------------------------------|--|----------------------------------|
| 121  | Data inicial para o ajuste da taxa | Campo destinado a informar a data inicial para o ajuste da taxa      | Paridade Asiático                |
| 122  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 123  | Data final para o ajuste da taxa   | Campo destinado a informar a data final para o ajuste da taxa        | Paridade Asiático                |
| 124  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 125  | Limites                            | Campo destinado para informar o tipo de limite no contrato           | Paridade Asiático                |
| 126  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 127  | Valor Superior                     | Campo destinado para informar o valor do limite superior no contrato | Paridade Asiático                |
| 128  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 129  | Valor Inferior                     | Campo destinado para informar o valor do limite inferior no contrato | Paridade Asiático                |
| 130  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 131  | Prêmio a ser pago pelo             | Campo destinado a informar o responsável a pagar o prêmio            | Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 132  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 133  | Valor do Prêmio                    | Campo destinado a informar valores para o prêmio                     | Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 134  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 135  | Modalidade de Liquidação           | Tipo da modalidade de liquidação da operação de prêmio.              | Paridade Asiático e Mercadorias. |
| 136  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 137  | Bolsa Referência                   | Descrição da Bolsa de Referência. (Fonte Apuração)                   | Mercadorias                      |
| 138  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 139  | Indicador Financeiro               | Nome do Indicador Financeiro (Commodity / Mercadoria)                | Mercadorias                      |
| 140  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 141  | Critério de Apuração               | Descrição do Critério de Apuração (Tipo de Critério)                 | Mercadorias                      |
| 142  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 143  | Unidade de Negociação              | Unidade de Medida de negociação                                      | Mercadorias                      |
| 144  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 145  | Fonte de Informação                | Fonte de Informação  | Mercadorias                      |
| 146  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 147  | Mês Vencimento                     | Mês de Vencimento do Grupo de Commodity                              | Mercadorias                      |
| 148  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |
| 149  | Ano de Vencimento                  | Ano de Vencimento do Grupo de Commodity                              | Mercadorias                      |
| 150  | Separador                          | Ponto e vírgula (;).   |                                  |

(continua)

| Seq. | Campo   | Descrição/Conteúdo        | Aplica-se a Termo(s) de: |
|------|---|---------------------------|--------------------------|
| 151  | Quantidade de Commodities ou Quantidade de Índice | Quantidade de Commodities | Mercadorias              |
| 152  | Separador   | Ponto e vírgula (;).      |                          |

| Seq. | Campo                        | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:                             |
|------|------------------------------|--|--|
| 153  | Quantidade Antecipada        | Quantidade Antecipada  | Mercadorias  |
| 154  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).   |  |
| 155  | Preço da Operação            | Preço da Operação  | Mercadorias  |
| 156  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).   |  |
| 157  | Observação                   |  | Moeda, Paridade Asiático, e Mercadorias              |
| 158  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).   |  |
| 159  | Código Identificador         | Descrição do Código Identificador.   | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias.              |
| 160  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).   |  |
| 161  | Cotação para Fixing          | Dia utilizado em relação ao vencimento para obter a taxa para avaliação do contrato: 1=D-1 ; 2=D-2 ; 3=D-3 ; 4=D-4 ; 5=D-5   | Moeda e Paridade Asiático                            |
| 162  | Separador                    | Ponto e vírgula(;).  |  |
| 163  | Taxa a Termo em Reais?       | Indica que a Taxa a Termo da Commodity está cotada em BRL  | Moedas, Paridade Asiático e Mercadorias              |
| 164  | Separador                    | Ponto e vírgula(;).  |  |
| 165  | Data de Liquidação de Prêmio | Indica a data de liquidação do prêmio  | Moeda, Paridade Asiático e Mercadorias.              |
| 166  | Separador                    | Ponto e vírgula(;).  |  |
| 167  | Data Verificação 1           | Data de Verificação 1.<br>Formato: AAAAMMDD  | Paridade Asiático e Mercadorias com ajuste periódico |
| 168  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).   |  |
| 169  | Valor Referência/Cotação 1   | Valor de Referência 1 exceto para operações de atualização de taxa. No caso de operações de antecipação (014) os valores são os lançados para atualização.<br>Ou<br>Paridade entre moeda cotada e moeda base para a data referência 1 no caso de operações de atualização de taxa (015).<br>Editado com vírgula decimal. | Paridade Asiático                                    |
| 170  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).   |  |
| 171  | Data Verificação 2           | Data Verificação 2<br>Formato: AAAAMMDD  | Paridade Asiático e Mercadorias com ajuste periódico |
| 172  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).   |  |
| 173  | Valor Referência / Cotação 2 | Valor de Referência 2 exceto para operações de atualização de taxa. No caso de operações de antecipação (014) os valores são os lançados para atualização.<br>Ou<br>Paridade entre moeda cotada e moeda base para a data referência 1 no caso de Operações de atualização de taxa (015).<br>Editado com vírgula decimal. | Paridade Asiático                                    |
| 174  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).   |  |

(continua)

| Seq. | Campo                        | Descrição/Conteúdo   | Aplica-se a Termo(s) de:                             |
|------|------------------------------|--|--|
| 173  | Data Verificação N           | Data de Verificação N.<br>Formato: AAAAMMDD  | Paridade Asiático e Mercadorias com ajuste periódico |
| 174  | Separador                    | Ponto e vírgula (;).   |  |
| 175  | Valor Referência / Cotação N | Valor de Referência N exceto para operações de atualização de taxa. No caso de operações de antecipação (014) os valores são os lançados para atualização.<br>ou<br>Paridade entre moeda cotada e moeda base para a data referência 1 no caso de operações de atualização de taxa (015).<br>Editado com vírgula decimal. | Termo de Moedas, Paridade Asiático e de Mercadorias  |

(fim)

**Observação:**

- Os contratos com ajuste periódico (Commodity periódico ou Moeda Asiático) serão exibidos com datas e valores relativos. O comprimento, nestes casos, pode aumentar de acordo com a quantidade de datas de verificação ou datas de ajuste do contrato em questão (estes registros não muito frequentes). Para outros tipos de contrato estes campos ficam vazios.