

MANUAL DE OPERAÇÕES – TERMO DE MERCADORIA

CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÃO DA VERSÃO 3

2 INTRODUÇÃO AO TERMO 7

2.1 Conhecendo o Produto 7

2.2 Ações dos Botões das Telas 8

3 LANÇAMENTOS 8

3.1 Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)..... 8

3.2 Estorno 16

3.3 Antecipação de Contrato 17

3.4 Intermediação de Contrato 21

3.5 Cessão de Contrato 23

3.6 Confirmação de Cessão de Contrato 25

3.7 Alteração e Exclusão de Lançamento..... 26

3.8 Alteração e Exclusão do Contrato..... 27

4 CONSULTAS..... 34

4.1 Lançamentos 34

4.2 Contratos 36

4.3 Operações 39

5 INFORMAÇÕES ADICIONAIS 42

5.1 Ativos Subjacentes Disponíveis 42

5.2 Cruzamento de Funcionalidades 42

5.3 Regras de Registro Conforme Fonte de Informação 43

5.4 Informações Adicionais – Termo de Mercadoria..... 46

5.5 Cross Rate 48

5.6 Metodologia de Cálculo 48

5.7 Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros 48

1 ATUALIZAÇÃO DA VERSÃO

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
20/09/2021	18/10/2021	Contratos de Termo de Mercadoria (Commodities)	Atualização de termos obsoletos do manual em aderência aos OC 005-2021 PRE, OC 022-2021 PRE, OC 109-2020 PRE quando se aplicar. Exclusão do item “3.3 Taxa de Câmbio para Avaliação”
10/05/2021	10/05/2021	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Permitir que Data(s) de referência para apuração da taxa média aritmética ponderada ou aritmética simples, sejam lançadas com datas menores do que a data de início do contrato, conforme divulgado no comunicado 001/2021-VPC.
28/09/2020	28/09/2020	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Inclusão de pagamento de prêmio para Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities), conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC.
28/09/2020	28/09/2020	Antecipação de Contrato	Inclusão de um Fator de Desconto para fazer o cálculo da Antecipação, conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC
29/06/2020	29/06/2020	Alteração de Contrato	Informação de que podem ser realizadas mais de uma alteração do contrato no dia, conforme divulgado no comunicado 021/2020-VPC.
17/02/2020	15/04/2020	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Ajuste nas observações do Termo de Mercadoria referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
17/02/2020	17/02/2020	Termo de Índices	Exclusão das informações referente a Termo de Índices, conforme divulgado no Ofício Circular 005/2020-PRE
01/07/2019	18/11/2019	Informações Adicionais – Termo de Mercadoria	Alteração de informações.
01/07/2019	18/11/2019	Contratos entre Clientes	Alteração na descrição do campo “Data de Avaliação”
01/07/2019	18/11/2019	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Alteração na descrição do campo “Data Ajuste”
01/07/2019	14/10/2019	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Alteração na descrição dos campos “Taxa a Termo em Reais?” “Preço da Operação” e “Moeda”.
01/07/2019	09/08/2019	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Alteração na descrição do campo “Taxas a Termo em Reais?”
01/07/2019	01/07/2019	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Inclusão do Termo de Commodities (cotado em outras moedas) convertido em Reais
11/09/2017	29/01/2018	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Melhoria nas observações do Termo de Mercadoria referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
11/09/2017	19/12/2017	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Melhoria nas descrições dos campos “Data de Cotação para Ajuste” e “Cotação de Moeda para o Vencimento”.
11/09/2017	08/12/2017	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)	Melhoria nas descrições dos campos “Data de Cotação para Ajuste”, “Data Ajuste” e “Qtd. Referência”.
11/09/2017	11/09/2017	Contratos	Inclusão dos campos “Tipo Sistema Origem” e “Código Sistema Origem”, alteração da tela Filtro e Relação.
21/11/2016	09/03/2017	Moedas Negociadas	Exclusão do arquivo.
21/11/2016	09/03/2017	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities) Registro de Contrato a Termo de Índice	Alteração da descrição do campo Observação.
21/11/2016	02/02/2017	Contrato	Exclusão do arquivo.

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

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
21/09/2015	21/09/2015	Conhecendo o Produto (Termo de Índice)	Inclusão do Índice Selic.
21/09/2015	21/09/2015	Contrato a Termo de Moedas	Inclusão da observação no campo “Data de Fixação”.
27/07/2015	27/07/2015	Cessão de Contrato (Lançamentos e Termo com Fluxo)	Disponibilização da Conta Cliente 1 para Conta Cliente 2 do mesmo participante, que possuam o mesmo CPF ou CNPJ.
15/09/2014	02/07/2015	Registro de contrato a termo de índice	Exclusão do índice Selic (ainda não disponibilizado na produção).
15/09/2014	30/06/2015	Registro de contrato a termo de índice	Inclusão do índice Selic.
15/09/2014	04/02/2015	Contrato a Termo de Moedas e Mercadoria (Commodities)	Nos campos “Data de Verificação” e “Data Ajuste”, retirada da informação, que a data informada deve ser em dia útil.
15/09/2014	31/10/2014	Atualizações da Versão	Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais nova para a mais antiga.
15/09/2014	15/09/2014	Registro de Termo de Moedas com Fluxo e TARF	Alteração em telas conforme o comunicado 069/14.
18/08/2014	09/09/2014	Todo o manual	Consolidação dos manuais do Termo de Índice, Mercadoria e Moedas. Nas descrições dos campos, inclusão da informação se o preenchimento é obrigatório ou não.
18/08/2014	18/08/2014	Registro do Contrato a Termo de Índice	No campo Data de Vencimento, a data de vencimento do contrato pode ser indicada em dias não uteis.
18/08/2014	18/08/2014	Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities) Contrato a Termo de Moedas e Registro de Termo de Moedas com Fluxo	No campo Data de Vencimento, a data de vencimento do contrato pode ser indicada em dias não uteis.
07/07/2014	31/07/2014	Todo o manual	Inclusão do caminho completo da função no NoMe.
07/07/2014	11/07/2014	Antecipação de Contrato	Inclusão da descrição da antecipação com parâmetros diferentes por fluxo
07/07/2014	07/07/2014	Registro do Termo de Moeda com Fluxo e TARF	Mudança das telas e melhoria na descrição do campo Moeda Cotada.
17/03/2014	17/03/2014	Consulta aos Contratos	Na tela de relação, inclusão das colunas: Responsável pela Aceleração – Parte, Responsável pela Aceleração – Contraparte, Agente de Cálculo – Parte e Agente de Cálculo – Contraparte.
01/07/2013	27/02/2014	Registro de Contrato a Termo Simples - Entre Clientes do Participante	Inclusão da frase, “Quando for Spot D0 a data é a do vencimento do contrato.” No campo Data de Avaliação.
01/07/2013	01/07/2013	Registro de Contrato	Mudança na descrição do campo Observação. Inclusão do campo Código Identificador. Conforme comunicado 033 e 039/13.
01/07/2013	01/07/2013	Taxa de Câmbio para Avaliação	Inclusão da Regra para os campos Tx Câmbio, Tx Paridade e Tx Cotada. Conforme comunicado 033 e 039/13.
01/04/2013	01/04/2013	Registro e Antecipação	Inclusão do campo “Cotação de Moeda para o vencimento” Inclusão do campo “Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada)”
14/01/2013	25/02/2013	Campos com a descrição opcional.	Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
14/01/2013	25/02/2013	Campos com a descrição opcional.	Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
14/01/2013	14/01/2013	Consultas	Exclusão das consultas de Transferência de Arquivos e Erros.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
14/01/2013	14/01/2013	Consultas	Exclusão das consultas de Transferência de Arquivos e Erros.
14/01/2013	14/01/2013	Registro/Operações	Inclusão do Termo de Moedas com Fluxo e TARF.
25/07/2011	20/12/2012	Alteração e Exclusão de contrato	Alteração na descrição do campo Posição do Participante.
25/07/2011	11/12/2012	Alteração e Exclusão de contrato	Alteração na descrição dos campos CPF/CNPJ Parte e Contraparte.
25/07/2011	16/10/2012	Data de Fixação, página 21.	Melhoria no texto.
25/07/2011	05/06/2012	Registro de Contrato a Termo Simples – Participante Registro de Contrato a Termo Simples - Entre Clientes do Participante Registro de Contrato a Termo de Moedas	Quando a Fonte de Informação for FEEDER ou SPOT, é possível a indicação do Fixing em D0, informando Spot D0 no campo “Tela ou Função de Consulta Função de Consulta”. A regra é válida para geração de eventos de Resgate de Termo de Moedas e para eventos de fixing dos contratos de termo de Asiático.
25/07/2011	30/05/2012	Cross Rate	Melhorias no texto sobre a descrição do Cross Rate
25/07/2011	07/05/2012	Registro - exemplo com fonte de Informações SISBACEN	Melhorias no texto do campo “Data de Avaliação” do Registro de Contrato.
24/10/2010	27/08/2012	Registro/Emissão	Campo Preço da Operação com até 04 decimais.
24/10/2010	17/04/2012	Regras de Negócios	Inclusão de informações sobre calendário nacional e internacional para liquidação e cotação.

2 INTRODUÇÃO AO TERMO

2.1 Conhecendo o Produto

O Módulo de Contrato a Termo possui o objetivo de contribuir para o desenvolvimento do mercado local de derivativos. Nele, os Participantes podem realizar operações de compra e venda a termo de mercadorias.

Os contratos a termo são acordos de compra e venda de um ativo em uma data futura, por preço previamente estabelecido. Esses acordos são particulares e são estabelecidos entre dois agentes financeiros, no qual uma das partes assume sua posição de compra no contrato a termo em data específica e por um preço certo e ajustado; e a contraparte assume sua posição de venda em iguais condições.

Termo de Mercadoria (Commodities)

É realizado através da operação de compra e venda a termo de mercadorias, sem previsão de entrega física, referenciada em preços praticados no mercado futuro em Bolsas de Mercadorias Nacionais ou Internacionais. A cotação utilizada é o preço de ajuste, definido conforme metodologia própria de cada bolsa.

O registro deste contrato na B3 permite ao Participante, que hoje não tem acesso aos mercados externos, operar neste segmento sem a necessidade de movimentação de margens e garantias em moeda estrangeira. A Instituição Participante também tem flexibilidade para optar por fechar um contrato com previsão de ajustes diários, periódicos, final ou asiático (simples ou ponderado), conforme as datas definidas no registro.

Outra vantagem estratégica possível é permitir que as Instituições Financeiras registrem, com seus clientes, operações locais que são contrapartida de operações de hedge fechadas pelas próprias instituições no mercado externo.

A fonte de informação para o preço das mercadorias é a Agência de Notícias Reuters e das cotações das moedas é o SISBACEN, ambos capturados automaticamente pelo Módulo.

Termo com Agenda de Redutor de Risco Crédito

É possível registrar no Módulo de Informações de Derivativos os eventos e as condições de agenda de Redutor de Risco de Crédito, para os contratos de Termo de Mercadoria ou Moeda.

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

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

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

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

Observação:

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

2.2 Ações dos Botões das Telas

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

Botão	Funcionalidade
Limpar campos	Limpa todos os campos selecionados e digitados.
Confirmar	Confirma os dados informados em tela.
Pesquisar	Submete os dados selecionados para pesquisa.
Excluir	Permite a exclusão de lançamentos pendentes de contraparte ou dos contratos selecionados.

3 LANÇAMENTOS

3.1 Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)

Termo > Lançamentos > Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)

Visão Geral

Esta função permite efetuar o registro de Contratos a Termo de Mercadoria.

O registro é realizado por duplo comando, pela Parte e Contraparte, e somente é efetivado se não apresentarem divergências nos lançamentos. Quando o contrato é realizado entre o Participante e conta de seu cliente 1, o mesmo é registrado apenas com o lançamento do Participante, comando único.

O Participante pode efetuar o registro de cinco tipos de modalidade de Contrato a Termo:

- Diário;
- Periódico;
- Final;Final: Asiático Simples, utiliza a **Média Aritmética Simples**, obtida pela média das cotações apuradas nas datas indicadas na tela de Registro do Contrato
- Final: Asiático Ponderado, utiliza a **Média Aritmética Ponderada**, obtida pela média das cotações apuradas nas datas indicadas na tela de Registro de Contrato e ponderadas pela parcela do Valor Base, também indicada na referida tela.

De acordo com a informação do campo Tipo de Ajuste, o módulo apresenta campos diferentes a serem preenchidos.

Os contratos realizados com clientes do tipo 1 e 2 devem ter seus comitentes finais identificados nesta função, no momento da inclusão do Contrato.

Observações:

- 1) Para informações sobre cálculo, acesse o **Caderno de Fórmulas do Termo** no *site* da B3.
- 2) As combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos são:

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

Tela de Registro – Exemplo de Contrato a Termo de Mercadoria

Contrato a Termo de Mercadoria (Commodities)			
Lançamento do Participante (Conta):	10020	. 00	- 1
Posição do Participante:	Comprador ▼		
CPF/CNPJ Cliente Parte:			
Cesta Garantias Parte:	Não ▼		
Contraparte (Conta):	05000	. 20	- 1
CPF/CNPJ Cliente Contraparte:	98765432100		
Cesta Garantias Contraparte:	Não ▼		
Nº Controle Interno:	1043	✕	
Data de Operação:	04	/ 09	/ 2020
Data de Vencimento:	29	/ 10	/ 2020
Dados da Commodity			
Bolsa Referência:	BMF ▼		
Commodity:	CAFE ▼		
Tipo:	ARABICO EM GRAOS- TIPO 4/5 ▼		
Taxa a Termo em Reais?	Não ▼		
Quantidade:	1.000		
Unidade de negociação:	SACA(60KG) ▼		
Preço da Operação:	100,0000		
Moeda:	BRL (790) - REAL ▼		
Fonte de Informação:	REUTERS ▼		
Preço de Referência da Commodity			
Mês do Vencimento:	DEZEMBRO ▼		
Ano do Vencimento:	2020 ▼		
Fonte de Informação para conversão da Moeda:	SISBACEN ▼		
Paridade para Liquidação:	Boletim PTAX800 de FECHAMENTO ▼		
Data da cotação para ajuste/Spot:	D-1 ▼		
Cotação de Moeda para o Vencimento:	D-2 ▼		
Tipo de Ajuste:	DIÁRIO ▼		
Observação:			
Código Identificador:			
Prêmio			
Prêmio a ser pago pelo:	COMPRADOR ▼		
Valor do Prêmio (R\$):	100,00		
Modalidade de Liquidação:	BILATERAL ▼		
Data de Liquidação:	29	/ 09	/ 2020
Confirmar		Limpar Campos	

Para que o lançamento seja efetuado, após o preenchimento dos campos na tela, é necessário clicar no botão **Confirmar**.

Após a confirmação do primeiro lançamento (contratos com duplo comando), é enviada mensagem informando o número do lançamento. Quando da confirmação do segundo lançamento (contraparte) e após o casamento da operação, é enviada mensagem informando o número da operação e o número do contrato.

Para os contratos registrados por lançamento único, o número da operação e o número do contrato são informados após sua confirmação.

Observação: Para preencher os campos relativos a área **Dados da Commodity**, o Participante deve consultar as relação de contrato existentes através da função **Relação de Contratos de Mercadoria (Commodities)**.

Descrição dos Campos da Tela de Registro

Campo	Descrição
Lançamento do Participante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.
Posição do Participante	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a posição assumida pelo participante. Lista pré-definida: Vendedor ou Comprador.
CPF/CNPJ Cliente Parte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte.
Cesta Garantias Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: SIM ou NÃO. Informa se o participante vai indicar cesta de garantia para o contrato.
Contraparte (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta da outra parte envolvida no contrato.
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte.
Cesta Garantias Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: SIM ou NÃO. Informa se o participante vai indicar cesta de garantia para o contrato.

Campo	Descrição
Nº Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 10 (dez) inteiros. 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, outros dados são confrontados para que a operação seja efetuada.
Data de Operação	Campo de preenchimento obrigatório. Data em que o Participante contratou a operação. Pode ser informada em até D-2 útil anterior à data do sistema, quando a contraparte na operação é um dos seus clientes, tipo de conta 1. A data da operação deve ser dia útil.
Data de Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Livremente pactuada entre os Participantes. A data de vencimento do contrato pode ser indicada em dias não uteis. Caso o ajuste caia em dia não útil, o comportamento do sistema deve ser como ocorre em outros casos, de gerar o ajuste para o próximo dia útil conhecido. O módulo somente aceita data de vencimento igual ou superior a n dias úteis do registro ou da data limite para vencimento, indicada na consulta de Relação de Contratos de Mercadoria (Commodities), sendo n o mesmo parâmetro utilizado para definição da data de captura da cotação.
Dados da Commodity – Campos de preenchimento obrigatório.	
Bolsa Referência	Lista pré-definida para indicar a bolsa de referência da commodity. A lista pode ser consultada no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias.
Commodity	Lista pré-definida para indicar a <i>commodity</i> negociada. Exemplo: Aço, açúcar, zinco etc. Pode ser consultada na função “Consulta as Cotações de Mercadoria (Commodities)” ou no arquivo público “AAAAMMDD_Mercadorias.txt
Tipo	Lista pré-definida para indicar o tipo de <i>commodity</i> negociada. A lista pode ser consultada no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias. Exemplo: Cristal, Em grãos, Liga etc.
Taxa a Termo em Reais?	Campo de preenchimento obrigatório. Permitido para mercadorias cotadas em moeda diferente do real. Indica que a taxa a Termo, o limitador e os triggers informados no registro do contrato estão expressos em reais*. Para mercadorias cotadas em reais, preencher como “Não”. * Para mais informações sobre a metodologia de cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas do Termo de Mercadoria.
Quantidade	Tamanho do contrato expresso na unidade de negociação. Informado com até 16 (dezesesseis) inteiros.

Campo	Descrição
Unidade de Negociação	Lista pré-definida para indicar a unidade de negociação do contrato. A lista pode ser consultada no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias. Exemplo: Arroba Líquida, Bushels, Tonelada, etc.
Preço da Operação	Preço da operação, expresso na moeda e unidade de negociação da mercadoria. Caso seja indicado “Sim” no campo “Taxa a Termo em Reais?”, o Preço da Operação deverá ser expresso em reais. Verificar as observações existentes sobre os preços de atualização na Consulta Relação de contratos de mercadoria (commodities). Informado com até 12 (doze) inteiros e 4 (quatro) decimais.
Moeda	Indica a moeda em que está cotada a mercadoria.
Fonte de Informação	Fonte de informação para captura automática da cotação da <i>Commodity</i> .
Preço de Referência da <i>Commodity</i>	
Mês do Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Lista pré-definida para indicar o mês de vencimento do contrato na Bolsa de Referência. Os meses disponíveis podem ser consultados no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias.
Ano do Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Os anos disponíveis podem ser consultados no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias. Ano do vencimento do contrato na Bolsa de Referência.
Fonte de Informação para Conversão da Moeda	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Fonte de informação utilizada para conversão dos valores do contrato para o Real: SISBACEN.
Paridade para Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Indica o boletim a ser utilizado para conversão dos valores do contrato para o Real: Boletim PTAX800 de Fechamento.
Data de Cotação para Ajuste	Campo de preenchimento obrigatório. Lista pré-definida para indicar a referência de data para captura de cotação do Preço de Ajuste (Reuters): D-1, D-2, D-3, D-4, D-5 dia útil, do calendário nacional e internacional, da data definida para o evento. Válido para ajustes, vencimento e antecipação. Observação: O tipo de cotação capturado será sempre do tipo ajuste.

Campo	Descrição
	Campo de preenchimento obrigatório.
Cotação de Moeda para o Vencimento	Lista pré-definida para indicar a referência de data para captura de cotação da paridade cambial (SISBACEN): D-1, D-2, D-3, D-4, D-5 dia útil, do calendário nacional e internacional, da data definida para o evento. Válido para ajustes, vencimento e antecipação.
	Campo de preenchimento obrigatório.
Tipo de Ajuste	Lista pré-definida para indicar o tipo de ajuste a ser aplicado no contrato: DIÁRIO, PERIÓDICO, FINAL (no vencimento), FINAL: ASIÁTICO SIMPLES e FINAL: ASIÁTICO PONDERADO. Quando as opções PERIÓDICO, FINAL: ASIÁTICO SIMPLES ou FINAL: ASIÁTICO PONDERADO são selecionadas, é aberto novos campos para a inserção das datas de avaliação do contrato.
Observação	Campo de preenchimento opcional.
Código de Identificação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 14 (quatorze) inteiros. Código de controle interno do participante.
Prêmio a ser pago pelo	Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor. Indicar a Parte que pagará o prêmio na data informada no campo Data de Liquidação, se houver.
Valor do Prêmio (R\$)	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. Informado com até 14 (quatorze) inteiros e 2 (dois) decimais. Informar o valor em reais (R\$) do prêmio total a ser pago na data informada no campo Data de Liquidação.
Modalidade de Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. Caixa de seleção com as opções: Bilateral, Bruta ou Sem Modalidade. Indicar a modalidade de liquidação da operação de prêmio na data informada no campo Data de Liquidação. Operações Mercado x Cliente deverão ser obrigatoriamente na “Sem Modalidade”
Data de Liquidação	Campo de preenchimento opcional. Indica a data de liquidação do prêmio. Permitida a inclusão de qualquer data útil entre a data de registro (inclusive) e a data de vencimento (inclusive). Caso esse campo não seja preenchido, a liquidação do prêmio será realizada na data do registro do contrato.
Datas de Verificação / Ajuste – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	

Campo	Descrição
Data Ajuste	Este campo é disponibilizado caso o Participante selecione, na caixa de seleção Tipo de Ajuste, as opções PERIÓDICO, FINAL: ASIÁTICO SIMPLES ou FINAL: ASIÁTICO PONDERADO. Caso o tipo de ajuste selecionado for “PERIÓDICO”: Informar no campo “Data Ajuste” as referidas datas para os ajustes periódicos. Permite datas anteriores à data de início do contrato e menores ou iguais a data de vencimento. Ao menos uma das datas de verificação deve ser maior que a data de início. O módulo somente aceita data de ajuste igual ou superior a n dias úteis do registro, sendo n o mesmo parâmetro utilizado para definição da data de captura da cotação. Caso o tipo de ajuste selecionado for “FINAL: ASIÁTICO SIMPLES” ou “FINAL: ASIÁTICO PONDERADO”: Informar as referidas datas para formação da média asiática. O número de datas indicadas para formação da média asiática está limitado à vida útil do contrato. Sendo que a primeira data de verificação deverá ser igual ou maior que a data de início, e a última data de verificação poderá ser menor ou igual à data de vencimento. A data efetiva considerada para a captura da cotação será a data de ajustes, vencimento, antecipação informadas aplicando-se o deslocamento* indicado. *mais informações sobre o deslocamento, consultar a seção “Regras de Negócios – Termo de Mercadoria”.
Qtd. Referência	Este campo é disponibilizado caso o Participante selecione, na caixa de seleção Tipo de Ajuste, a opção FINAL: ASIÁTICO PONDERADO. Informado com até 11 (onze) inteiros. Quantidade definida para a data referência, a qual é utilizada no cálculo da taxa média aritmética ponderada. Observação: A soma das “Qtd. Referências” indicadas deverá ser igual ao valor informado no campo “Quantidade” no registro.
Pesos (%)	Automaticamente calculado pelo sistema, quando a Quantidade Referência é informada. Indica a porcentagem da Quantidade na data de verificação para apuração da taxa média aritmética ponderada.

3.2 Estorno

Termo > Lançamentos > Estorno

Visão Geral

O estorno faz com que o contrato volte a situação que tinha anteriormente e ocorre com respectiva digitação de ambas as partes envolvidas na operação. Quando a operação é efetuada entre clientes 1 do participante é necessário apenas o lançamento do Membro de Mercado.

O estorno pode ser realizado para as seguintes operações:

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

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

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

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

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

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

Tela de Filtro de Estorno

Estorno

Lançamento do Participante (Conta): . -

Contraparte (Conta): . -

Nº Controle Interno:

Contrato:

Operação:

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

Descrição dos Campos da tela filtro de Estorno

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Lançamento do Participante (Conta)	Código da conta que identifica o membro envolvido na operação que está acessando o módulo.
Contraparte (Conta)	Código da conta que identifica o membro que efetuou o contrato.
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Informado com até 10 (dez) inteiros. 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.
Contrato	Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro do mesmo.
Operação	Número da operação que se deseja estornar.

3.3 Antecipação de Contrato

Termo > Lançamentos > Antecipação de Contrato

Visão Geral

É possível a partir do primeiro dia útil subsequente ao seu registro no Módulo e até o dia útil anterior (D-1) ao vencimento da opção.

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

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

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

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

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

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

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

O lançamento de antecipação não deve ser realizado com o objetivo de cancelamento do contrato, em função de identificação de registro incorreto, nem ser combinado com o registro de um novo contrato para refletir qualquer alteração das condições originalmente pactuadas. Nestes casos, o participante deve remeter a documentação comprobatória para a avaliação da área operacional da B3.

Ressaltamos que a utilização da função de antecipação com a finalidade de realizar alteração e/ou cancelamento de contrato poderá caracterizar a inadimplência regulamentar do participante, sujeitando-o às penalidades previstas no regulamento da B3.

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

Observação: Informação sobre cálculo da liquidação antecipada acesse o **Caderno de Fórmulas** na *site* da B3.

Tela Filtro de Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato	
Nº do Contrato:	F12G64302
	Confirmar Limpar Campos

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

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

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

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

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

Tela Detalhe de Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato	
Lançamento do Participante (Conta):	. -
Contraparte (Conta):	. -
Cesta Garantia Comprador :	
Cesta Garantia Vendedor :	
Nº Controle Interno:	
Contrato:	F20G28340
Quantidade:	
Data Antecipação:	25 / 08 / 2020
Preço de Antecipação:	
Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada):	
Fator de Desconto:	
Liquidante (Conta):	. -
Confirmar Limpar Campos	

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

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

Conforme mensagem a seguir.

Realizada operação de Antecipação 14430713 do contrato F12G64302.

Descrição dos Campos da Tela Detalhe Antecipação de Contrato

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

Campo	Descrição
Número Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório. Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.
Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro.
Quantidade	Campo de preenchimento obrigatório. Quantidade de contratos para antecipação.
Data Antecipação	Campo de preenchimento obrigatório. Este campo deve ser preenchido quando se deseja efetuar uma Antecipação Retroativa com cliente 1. Deve ser preenchido em no máximo D-2 útil anterior a data do sistema.
Preço de Antecipação	Campo de preenchimento obrigatório. Preço de ajuste da mercadoria, por unidade de negociação do contrato, informado pelo participante com até 4 (quatro) casas decimais.
Taxa de Câmbio (R\$/Moeda Cotada)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 4 (quatro) inteiros e 8 (oito) decimais. Campo exclusivo para Termo de Paridade/Asiático.
Fator de Desconto	Campo de preenchimento obrigatório Informado com até 3 (três) inteiros e 8 (oito) decimais Nesse campo deverá ser informado o fator de juros utilizado para o cálculo do valor financeiro da antecipação. * Para mais informações sobre a metodologia de cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas do Termo de Mercadoria.
Liquidante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Código da conta do Banco Liquidante que fará a liquidação financeira da operação. Caso o campo não seja preenchido, o sistema assumirá o Banco Liquidante Principal.
Datas de verificação - Dados complementares para contrato com modalidade Termo Asiático com média ponderada – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Data	Data(s) de referência para apuração da atualização da Taxa Média Aritmética Ponderada .
Valor Referência	Valor definido para data de referência, o qual deve ser utilizado no cálculo da Média Aritmética Ponderada. Informado com até 14 (quatorze) inteiros e 8 (oito) decimais.

Campo	Descrição
Valor a Antecipar	Valor a antecipar do Valor Referência indicado. Informado com 14 (quatorze) inteiros e 8 (oito) decimais.

3.4 Intermediação de Contrato

Termo > Lançamentos > Intermediação de Contrato

Visão Geral

A intermediação de um contrato é registrada pela digitação de ambas as partes envolvidas, o Intermediador, que promove o encontro das partes interessadas em realizar determinado contrato e, conseqüentemente, recebe o percentual de comissão acordada; e o Participante, quem paga a comissão. Pode ser efetuada somente no dia do registro do contrato.

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

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

Tela de Intermediação de Contrato

Intermediação de Contrato

Lançamento do Participante (Conta): . -

Posição do Participante:

Contraparte (Conta): . -

Nº Controle Interno:

Contrato:

Comissão (%):

Momento do Pagamento:

Liquidante (Conta): . -

Modalidade de Liquidação:

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

- O número do lançamento, quando apenas uma das partes efetuou a operação;
- O número da operação e o número do contrato, quando as duas partes envolvidas na operação efetuaram o lançamento.

Descrição dos Campos da Tela de Intermediação de Contrato

Campo	Descrição
Lançamento do Participante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta do Participante que está efetuando o lançamento da intermediação.
Posição do Participante	Campo de preenchimento obrigatório. Lista pré-definida de valores: Intermediador ou Intermediado. Indica o papel assumido pelo membro que está efetuando o lançamento da intermediação.
Contraparte (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta do outro membro envolvido na operação.
Nº Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 10 (dez) inteiros. 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.
Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro.
Comissão (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 2 (dois) inteiros e 4 (quatro) decimais. Valor percentual que deve ser aplicado sobre o Valor Base Inicial ou Valor Base Final da operação, a ser paga ao intermediador.
Momento do Pagamento	Campo de preenchimento obrigatório. Indica que a comissão deve ser paga no início do contrato. Não é permitido registros de intermediação com liquidação do valor da comissão na data do vencimento do contrato. O pagamento da comissão de intermediação deve ser na data de registro do contrato.
Liquidante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Código da conta do Banco Liquidante que deve efetuar a liquidação financeira da operação. Caso o campo não seja preenchido, o sistema assume o Banco Liquidante principal.
Modalidade de Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Forma de liquidação financeira da operação.

3.5 Cessão de Contrato

Termo > Lançamentos > Cessão de Contrato

Visão Geral

Um dos participantes envolvidos no contrato pode ceder a um terceiro o contrato registrado anteriormente, desde que exista anuência da contraparte. A cessão pode ocorrer entre a data de registro até a data anterior de vencimento do contrato, sempre pelo valor total.

Ocorre com digitação das partes envolvidas, o cedente e o adquirente com a necessidade de confirmação do Anuente, através da função **Confirmação de Cessão de Contrato**.

A cessão de contrato realizada entre contas de cliente 1 ou de cliente 2 de um mesmo Participante são realizadas sem confirmação do Anuente.

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

O sistema permite a realização de uma nova cessão apenas se o status da operação “20 – CESSÃO DE CONTRATO” for igual a “Finalizada” ou “Cancelada”. Caso exista uma cessão com status diferente de “Finalizada” ou “Cancelada”, o sistema não permite que a operação seja realizada.

Cessão e Pagamento de Prêmio

Somente o Cedente ou o Adquirente pode ser titular da operação de pagamento de prêmio. O adquirente paga prêmio da cessão, quando o Cedente for o Lançador do contrato e recebe o prêmio, quando o Cedente for o Titular.

A operação de prêmio somente é gerada após lançamento da operação de confirmação da cessão pelo Anuente. O pagamento de prêmio é efetuado simultaneamente à respectiva liquidação financeira.

Os direitos ou obrigações do cedente nos pagamentos de prêmios agendados nos registros do contrato anterior a cessão são transferidos para o adquirente.

Não é permitido pagamento de prêmio para Cessão de Contrato realizadas entre Clientes 1 ou 2 do mesmo Participante.

Observações:

Caso o Anuente não confirme a cessão, até o encerramento do horário estabelecido para a grade sem liquidação no STR (Sem modalidade), a mesma não é processada, permanecendo o contrato com suas condições originais.

Caso o contrato esteja vinculado a cesta de garantias, é necessário efetuar a desvinculação da cesta de garantias para que seja possível a operação de Cessão.

Tela Cessão de Contrato

Cessão de Contrato	
Lançamento do Participante (Conta):	. -
Posição do Participante:	Cedente ▼
Contraparte (Conta):	. -
CPF/CNPJ (Cedente):	
CPF/CNPJ (Adquirente):	
Nº Controle Interno:	
Contrato:	
Valor do Prêmio:	
Titular do Prêmio:	▼
Confirmar Limpar Campos	

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

- O número do lançamento, quando apenas uma das partes efetuou a operação;
- O número da operação e o número do contrato, quando as duas partes envolvidas na operação efetuaram o lançamento.

Descrição dos Campos da Tela Cessão de Contrato

Campo	Descrição
Lançamento do Participante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta do Participante que está efetuando o lançamento: Cedente ou Adquirente.
Posição do participante	Campo de preenchimento obrigatório. Lista pré-definida de valores: Cedente ou Adquirente. Identifica o participante que está efetuando o lançamento.
Contraparte (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta do outro participante envolvido na operação: Cedente ou Adquirente.
CPF/CNPJ (Cedente)	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.
CPF/CNPJ (Adquirente)	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.

Campo	Descrição
Nº Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 10 (dez) inteiros. 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.
Contrato	Campo de preenchimento obrigatório. Número atribuído ao contrato, quando efetuado o registro do mesmo.
Valor do Prêmio	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 17 (dezesete) inteiros e 2 (dois) decimais. Valor do prêmio a ser pago. Não é necessário que o valor do prêmio seja o mesmo pago na operação original. Caso o campo não seja preenchido as partes não se obrigam, ou seja, apenas realizam a cessão do contrato.
Titular do Prêmio	Preenchimento obrigatório se for preenchido o campo Valor do Prêmio. Indica a ponta que deve pagar o prêmio, se houver.

3.6 Confirmação de Cessão de Contrato

Termo > Lançamentos > Confirmação de Cessão de Contrato

Visão Geral

Através desta função o Anuente, em uma operação de Cessão, confirma a transação gerando um novo contrato entre o Adquirente e o Anuente.

Função de comando unilateral, após digitação dos dados pelo Anuente o sistema atualiza o contrato.

Tela Confirmação de Cessão de Contrato

Confirmação de Cessão de Contrato

Anuente (Conta): . -

Cedente (Conta): . -

Adquirente (Conta): . -

N° Controle Interno:

Contrato:

Para que o lançamento seja efetuado, após o preenchimento dos campos, clique no botão **Confirmar**, o sistema envia mensagem referente a operação.

Efetivada a cessão é criado um número de contrato com as mesmas características que o anterior (cedido). O contrato anterior pode ser apenas consultado, saindo do sistema em sua data de vencimento.

Descrição dos Campos da Tela de Confirmação de Cessão de Contrato

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Anuente (Conta)	Código da conta do Participante que permaneceu no contrato.
Cedente (Conta)	Código da conta do Participante que transfere o contrato.
Adquirente (Conta)	Código da conta do novo participante.
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Informado com até 10 (dez) inteiros. 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.
Contrato	Número do contrato.

3.7 Alteração e Exclusão de Lançamento

Termo > Lançamentos > Alteração e Exclusão de Lançamento

Visão Geral

Esta função pode ser utilizada no caso de lançamento de contrato, antecipação, cessão, intermediação de contratos e taxa de câmbio para avaliação que ainda não foram confirmadas por uma das partes e o membro que lançou deseja corrigir ou excluir o lançamento.

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

Tela de Alteração e Exclusão de Lançamento

Após o preenchimento dos campos da tela acima, clique no botão **Confirmar**. É apresentada Tela de Relação com os dados postados, referente à operação desejada.

A tela exibe duas opções: Excluir ou Alterar o lançamento.

- Para alterar, o participante deve digitar os dados necessários e clicar em **Confirmar**.
- Para excluir, basta clicar no botão **Excluir**.

Quando realizada a opção, o sistema retorna mensagem conforme operação realizada:

- Opção Excluir: Informa o número do lançamento excluído.
- Opção alterar: Automaticamente é criado um número ao lançamento alterado e o anterior é excluído, como pode ser visualizado na **Consulta aos Lançamentos**.

Descrição dos Campos da Tela de Alteração e Exclusão de Lançamento

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Lançamento do Participante	Código da conta do Participante que deseja alterar ou excluir seu lançamento.
Nº do lançamento	Número que o sistema atribuiu ao lançamento da operação a ser alterada ou excluída.

3.8 Alteração e Exclusão do Contrato

Termo > Lançamentos > Alteração e Exclusão do Contrato

Visão Geral

Esta função permite ao participante com perfil de SUPERVISOR ou DIGITADOR, alterar ou excluir os contratos realizados entre Participantes distintos, contratos realizados entre sua conta própria e seus Clientes 1 e 2, assim como contratos realizados entre seus Clientes 1, no período de 1 até 3 dias úteis após o registro, não podendo o mesmo encontrar-se VENCIDO ou CEDIDO.

Quando operação efetuada entre clientes 1 do participante ou entre o participante e seu cliente 1, é necessário apenas o lançamento do participante. No caso de contrato entre Participantes ou entre o Participante e seu cliente 2, o duplo lançamento é obrigatório.

A alteração/exclusão do contrato deve obedecer a Grade Sem Liquidação STR - CTP11 e não pode ocorrer na data do vencimento do mesmo.

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

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

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

Observações:

Alterações e exclusões não envolvem financeiro;

A consulta de **Operações** é sensibilizada na plataforma NoMe. Na consulta **Operações**, é gerada uma operação, cujo campo Tipo de Operação exibe a informação Alteração, campo Modalidade com Sem Modalidade de Liquidação e o campo Situação recebe *status* FINALIZADA;

Na consulta **Contratos** é exibida a informação atualizada, no campo que sofreu a alteração;

O código da operação é 099, se realizada pelo mercado e 098, se realizada pela Cetip.

Disponibilização ao participante do relatório RALTERAÇÕES, através do Nome/Transferência de Arquivos/Arquivo/Receber Relatórios, em formato .pdf. A Emissão desse relatório é no dia seguinte ao da retificação do contrato e no próprio são exibidos os detalhes do contrato, antes e depois da alteração;

No relatório RMAPAMOVTERMOPDF também são exibidas as operações de alterações realizadas.

Tela Filtro de Alteração e Exclusão de Contrato

Alteração e Exclusão de Contrato

Nº do Contrato:

Posição:

Ação:

Confirmar

Limpar Campos

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

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

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório.	
Nº Contrato	Número do Contrato que deseja alterar ou excluir.
Posição	Caixa de seleção com as opções: COMPRADOR e VENDEDOR COMPRADOR parte compradora do contrato e VENDEDOR parte vendedora do contrato.
Ação	Caixa de seleção com as opções: Correção, Aditamento e Exclusão.

Tela de Correção de Contrato

Alteração e Exclusão de Contrato F20I28779		
Lançamento do Participante (Conta):	10020	. 00 - 1
Posição do Participante:	Comprador ▼	
CPF/CNPJ Cliente Parte:		
Cesta Garantias Parte:	Não ▼	
Contraparte (Conta):	05000	. 20 - 1
CPF/CNPJ Cliente Contraparte:	987.654.321-00	
Cesta Garantias Contraparte:	Não ▼	
Nº Controle Interno:		
Data de Operação:	17	/ 09 / 2020
Data de Vencimento:	29	/ 10 / 2020
Dados da Commodity		
Bolsa Referência:	BMF ▼	
Commodity:	CAFE ▼	
Tipo:	ARABICO EM GRAOS- TIPO 4/5 ▼	
Taxa a Termo em Reais?	Não ▼	
Quantidade:	1000	
Unidade de negociação:	SACA(60KG) ▼	
Preço da Operação:	100,0000	
Moeda:	BRL (790) - REAL ▼	
Fonte de Informação:	REUTERS ▼	
Preço de Referência da Commodity		
Mês do Vencimento:	DEZEMBRO ▼	
Ano do Vencimento:	2020 ▼	
Fonte de Informação para conversão da Moeda:	SISBACEN ▼	
Paridade para Liquidação:	Boletim PTAX800 de FECHAMENTO ▼	
Data da cotação para ajuste/Spot:	D-1 ▼	
Cotação de Moeda para o Vencimento:	D-2 ▼	
Tipo de Ajuste:	DIÁRIO ▼	
Observação:		
Código Identificador:		
Prêmio		
Prêmio a ser pago pelo:	COMPRADOR ▼	
Valor do Prêmio (R\$):	100,00	
Modalidade de Liquidação:	BILATERAL ▼	
Data de Liquidação:	29	/ 09 / 2020
Confirmar		Limpar Campos

Descrição dos Campos da Tela de Correção de Contrato

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório ou não, igual ao do registro.	
Lançamento do Participante (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.
Posição do Participante	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a posição assumida pelo participante. Lista pré-definida: Vendedor ou Comprador.
CPF/CNPJ Cliente Parte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte.
Cesta Garantias Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: SIM ou NÃO. Informa se o participante vai indicar cesta de garantia para o contrato.
Contraparte (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código da conta da outra parte envolvida no contrato.
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte.
Cesta Garantias Contraparte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: SIM ou NÃO. Informa se o participante vai indicar cesta de garantia para o contrato.
Nº Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório. Informado com até 10 (dez) inteiros. 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, outros dados são confrontados para que a operação seja efetuada.
Data de Operação	Campo de preenchimento obrigatório. Data em que o Participante contratou a operação. Pode ser informada em até D-2 útil anterior à data do sistema, quando a contraparte na operação é um dos seus clientes, tipo de conta 1. A data da operação deve ser dia útil.

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório ou não, igual ao do registro.	
Data de Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Livremente pactuada entre os Participantes. A data de vencimento do contrato pode ser indicada em dias não uteis. Caso o ajuste caia em dia não útil, o comportamento do sistema deve ser como ocorre em outros casos, de gerar o ajuste para o próximo dia útil conhecido. O módulo somente aceita data de vencimento igual ou superior a n dias úteis do registro ou da data limite para vencimento, indicada na consulta de Relação de Contratos de Mercadoria (Commodities), sendo n o mesmo parâmetro utilizado para definição da data de captura da cotação.
Dados da Commodity – Campos de preenchimento obrigatório.	
Bolsa Referência	Lista pré-definida para indicar a bolsa de referência da commodity. A lista pode ser consultada no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias.
Commodity	Lista pré-definida para indicar a <i>commodity</i> negociada. Exemplo: Aço, açúcar, zinco etc. Pode ser consultada na função “Consulta as Cotações de Mercadoria (Commodities)” ou no arquivo público “AAAAMMDD_Mercadorias.txt
Tipo	Lista pré-definida para indicar o tipo de <i>commodity</i> negociada. A lista pode ser consultada no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias. Exemplo: Cristal, Em grãos, Liga etc.
Taxa a Termo em Reais?	Campo de preenchimento obrigatório. Permitido para mercadorias cotadas em moeda diferente do real. Indica que a taxa a Termo, o limitador e os triggers informados no registro do contrato estão expressos em reais*. Para mercadorias cotadas em reais, preencher como “Não”. * Para mais informações sobre a metodologia de cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas do Termo de Mercadoria.
Quantidade	Tamanho do contrato expresso na unidade de negociação. Informado com até 16 (dezesesseis) inteiros.
Unidade de Negociação	Lista pré-definida para indicar a unidade de negociação do contrato. A lista pode ser consultada no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias. Exemplo: Arroba Líquida, Bushels, Tonelada, etc.

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório ou não, igual ao do registro.	
Preço da Operação	Preço da operação, expresso na moeda e unidade de negociação da mercadoria. Caso seja indicado “Sim” no campo “Taxa a Termo em Reais?”, o Preço da Operação deverá ser expresso em reais. Verificar as observações existentes sobre os preços de atualização na Consulta Relação de contratos de mercadoria (commodities). Informado com até 12 (doze) inteiros e 4 (quatro) decimais.
Moeda	Indica a moeda em que está cotada a mercadoria.
Fonte de Informação	Fonte de informação para captura automática da cotação da <i>Commodity</i> .
Preço de Referência da <i>Commodity</i>	
Mês do Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Lista pré-definida para indicar o mês de vencimento do contrato na Bolsa de Referência. Os meses disponíveis podem ser consultados no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias.
Ano do Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Os anos disponíveis podem ser consultados no arquivo público AAAAMMDD_Mercadorias. Ano do vencimento do contrato na Bolsa de Referência.
Fonte de Informação para Conversão da Moeda	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Fonte de informação utilizada para conversão dos valores do contrato para o Real: SISBACEN.
Paridade para Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Indica o boletim a ser utilizado para conversão dos valores do contrato para o Real: Boletim PTAX800 de Fechamento.
Data de Cotação para Ajuste	Campo de preenchimento obrigatório. Lista pré-definida para indicar a referência de data para captura de cotação do Preço de Ajuste (Reuters): D-1, D-2, D-3, D-4, D-5 dia útil, do calendário nacional e internacional, da data definida para o evento. Válido para ajustes, vencimento e antecipação. Observação: O tipo de cotação capturado será sempre do tipo ajuste.
Cotação de Moeda para o Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Lista pré-definida para indicar a referência de data para captura de cotação da paridade cambial (SISBACEN): D-1, D-2, D-3, D-4, D-5 dia útil, do calendário nacional e internacional, da data definida para o evento. Válido para ajustes, vencimento e antecipação.

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório ou não, igual ao do registro.	
Tipo de Ajuste	Campo de preenchimento obrigatório. Lista pré-definida para indicar o tipo de ajuste a ser aplicado no contrato: DIÁRIO, PERIÓDICO, FINAL (no vencimento), FINAL: ASIÁTICO SIMPLES e FINAL: ASIÁTICO PONDERADO. Quando as opções PERIÓDICO, FINAL: ASIÁTICO SIMPLES ou FINAL: ASIÁTICO PONDERADO são selecionadas, é aberto novos campos para a inserção das datas de avaliação do contrato.
Observação	Campo de preenchimento opcional.
Código de Identificação	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 14 (quatorze) inteiros. Código de controle interno do participante.
Prêmio a ser pago pelo	Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor. Indicar a Parte que pagará o prêmio na data informada no campo Data de Liquidação, se houver.
Valor do Prêmio (R\$)	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. Informado com até 14 (quatorze) inteiros e 2 (dois) decimais. Informar o valor em reais (R\$) do prêmio total a ser pago na data informada no campo Data de Liquidação.
Modalidade de Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. Caixa de seleção com as opções: Bilateral, Bruta ou Sem Modalidade. Indicar a modalidade de liquidação da operação de prêmio na data informada no campo Data de Liquidação. Operações Mercado x Cliente deverão ser obrigatoriamente na “Sem Modalidade”
Data de Liquidação	Campo de preenchimento opcional. Indica a data de liquidação do prêmio. Permitida a inclusão de qualquer data útil entre a data de registro (inclusive) e a data de vencimento (inclusive). Caso esse campo não seja preenchido, a liquidação do prêmio será realizada na data do registro do contrato.

4 CONSULTAS

4.1 Lançamentos

Termo > Consultas > Lançamentos

Visão Geral

Exibe todos os lançamentos que estão pendentes no dia, por alguma situação.

Tela de Filtro

Lançamentos

Participante (Nome Simplificado):

Participante (Razão Social):

Tipo de Conta Participante:

Participante (Conta):

Contraparte (Nome Simplificado):

Contraparte (Razão Social):

Tipo de Conta Contraparte:

Contraparte (Conta):

Situação:

Todas

Tipo de Operação:

Qualquer

Nº Controle Interno:

Contrato:

Nº do lançamento:

Pesquisar

Limpar Campos

Após o preenchimento dos campos da Tela de Filtro, clique no botão **Pesquisar**. É apresentada a Tela de Relação com os dados postados.

Na Tela de Relação, a primeira coluna (Lançamento) identifica o número do lançamento. Ao ser selecionado, exibe as características correspondentes a este lançamento e permite, se for o caso, alteração do mesmo.

Descrição dos Campos da Tela de Filtro

Campo	Descrição
Participante (Nome simplificado)	Nome simplificado que identifica, no ambiente da Cetip, o participante.
Participante (Razão Social)	Razão Social do participante envolvido na operação.
Tipo de Conta Participante	Identificação da conta do Participante. Lista pré-definida de valores: Própria, Cliente1, Cliente2, Emissora, Caução, Reserva Técnica ou Margem.
Participante (Conta)	Número da conta do participante na Cetip.

Campo	Descrição
Contraparte (Nome simplificado)	Nome simplificado que identifica, no ambiente da Cetip, o outro membro envolvido no lançamento da operação.
Contraparte (Razão Social)	Razão Social da contraparte envolvida na operação.
Tipo de Conta Contraparte	Identificação da conta da contraparte. Lista pré-definida de valores: Própria, Cliente1, Cliente2, Emissora, Caução, Reserva Técnica ou Margem.
Contraparte (Conta)	Código da conta do outro membro envolvido no lançamento da operação.
Situação	Lista pré-definida de valores: Pendente - Quando o lançamento não foi confirmado. Divergente - Apresentam dados diferentes quando efetuado o lançamento. Todas - Exibe todos os lançamentos pendentes e divergentes.
Tipo de operação	Determina a opção de operação pela qual o participante quer realizar a consulta.
Nº Controle Interno	Número de identificação do lançamento pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada. Informado com até 10 (dez) inteiros.
Contrato	Nº atribuído ao contrato quando efetuado o registro do mesmo. Somente para operações: Estorno de Contratos, Alteração, Atualização de Taxa, Antecipação, Intermediação de Contrato, Cancelamento, Estorno de Antecipação, Estorno de Pagamento de Intermediação, Pagamento de Intermediação, Cessão de Contrato, Confirmação de Cessão de Contrato e Estorno de Atualização de Taxa.
Nº do lançamento	Número do lançamento da operação que se deseja consultar.

Tela de Relação

Consulta de Lançamentos

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 20 de 20)

Data e Hora da Consulta: 30/07/2014 - 11:35:39

Lançamento	Participante	Conta	Contraparte	Conta	Tipo de Operação	Contrato	Controle	Situação	Pendência
26856093	TESTE BANCO LAPA S/A	01973.00-2	BCO LEME S/A	10020.00-1	REGISTRO	F14G09170	250	Casado	----
26856094	BCO LEME S/A	10020.00-1	TESTE BANCO LAPA S/A	01973.00-2	REGISTRO	F14G09170	251	Casado	----

Ao selecionar e clicar no link exibido na primeira coluna da Tela de Relação é apresentada Tela de Detalhe do referido lançamento.

4.2 Contratos

Termo > Consultas > Contratos

Visão Geral

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

Tela Filtro

Contratos

Comprador (Nome Simplificado):

Comprador (Razão Social):

Tipo de Conta Comprador:

Comprador (Conta):

Cesta Garantias Comprador:

Vendedor (Nome Simplificado):

Vendedor (Razão Social):

Tipo de Conta Vendedor:

Vendedor (Conta):

Cesta Garantias Vendedor:

Situação:

Fonte de Informação:

Contrato:

Tipo Sistema Origem:

Código Sistema Origem:

Contrato(Original):

Tipo Instrumento Financeiro:

Tipo:

Data de Operação:

Data de Registro:

Data de Vencimento:

Pesquisar

Limpar Campos

Após o preenchimento dos campos da Tela de Filtro, clique no botão **Pesquisar**. É apresentada a Tela de Relação com os dados postados.

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

Descrição dos Campos da Tela Filtro

Campo	Descrição
Comprador (Nome simplificado)	Nome simplificado que identifica, no ambiente da Cetip, o participante envolvido na operação.
Comprador (Razão Social)	Razão Social do participante envolvido na operação.

Campo	Descrição
Tipo de Conta Comprador	Identificação da conta do Comprador. Lista pré-definida de valores: Própria, Cliente1, Cliente2, Emissora, Caução, Reserva Técnica ou Margem.
Comprador (Conta)	Número da conta do Comprador na Cetip.
Cesta Garantias Comprador	Caixa de seleção com as opções: SIM ou NÃO. Informa se o contrato a ser consultado tem indicação de cesta de garantia do comprador.
Vendedor (Nome simplificado)	Nome simplificado que identifica o outro membro envolvido na operação no ambiente da Cetip.
Vendedor (Razão Social)	Razão Social do outro membro envolvido na operação.
Tipo de Conta Vendedor	Identificação da conta do Vendedor. Lista pré-definida de valores: Própria, Cliente1, Cliente2, Emissora, Caução, Reserva Técnica ou Margem.
Vendedor (Conta)	Número da conta do Vendedor na Cetip.
Cesta Garantias Vendedor	Caixa de seleção com as opções: SIM ou NÃO. Informa se o contrato a ser consultado tem indicação de cesta de garantia do vendedor.
Situação	Lista pré-definida com os valores: Todas, Cancelado, Antecipado total, Avaliado, Confirmado, Vencido, Vencido não resgatado, Resgatado, Confirmado, Pendente Câmbio (<i>Feeder</i>) e etc.
Fonte de informação	Indica a fonte utilizada para cotação da moeda.
Contrato	Número atribuído ao contrato quando efetuado o registro do mesmo.
Tipo Sistema Origem	Campo de preenchimento não obrigatório. Caixa combo-box com a opção BMFBOVESPA.
Código Sistema Origem	Campo de preenchimento não obrigatório. Campo de preenchimento com 14 (quatorze) caracteres.
Contrato Original	Número atribuído ao contrato quando efetuado uma operação de cessão.
Tipo Instrumento Financeiro	Informar o tipo de instrumento financeiro: TMO, TCO ou TIN.

Campo	Descrição
Tipo	Informar o tipo de característica do contrato. Lista pré-definida de valores: Diário; Final; Asiático Aritmética Simples; Periódico; ou Asiático Aritmética Ponderada.
Data da Operação	Data em que o participante contratou a operação.
Data de Registro	Data da efetivação do contrato.
Data de Vencimento	Data na qual o contrato vence.

Tela de Relação

Consulta de Contratos

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 4 de 4)

Data e Hora da Consulta: 04/09/2017 - 18:04:33

Contrato	Tipo Inst. Financeiro	Vendedor	Comprador	Fonte de Informação	Operação	Registro	Vencimento	Saldo (R\$)	Situação	Tipo	CPF/CNPJ Comprador
F17G25837	TERMO DE COMMODITY	05000.10-8 BCO RIO S/A	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	REUTERS	13/07/2017	13/07/2017	13/07/2018	188,74	PENDENTE COTACAO	DIÁRIO	----
F17G25836	TERMO DE COMMODITY	05000.10-8 BCO RIO S/A	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	REUTERS	13/07/2017	13/07/2017	13/07/2018	188,74	PENDENTE COTACAO	DIÁRIO	----
F17B25599	TERMO DE COMMODITY	05000.10-8 BCO RIO S/A	05000.10-8 BCO RIO S/A	REUTERS	03/02/2017	03/02/2017	05/02/2018	-273,30	PENDENTE COTACAO	DIÁRIO	987.654.321-00
F17B25601	TERMO DE COMMODITY	05000.10-8 BCO RIO S/A	05000.10-8 BCO RIO S/A	REUTERS	03/02/2017	03/02/2017	06/02/2018	-25,02	PENDENTE COTACAO	DIÁRIO	987.654.321-00

(continua)

Cód. Cesta de Garantias Comprador	CPF/CNPJ Vendedor	Cód. Cesta de Garantias Vendedor	Responsável pela Aceleração - Parte	Responsável pela Aceleração - Contraparte	Agente de Calculo - Parte
Não	396.406.728-82	Não	----	----	----
Não	396.406.728-82	Não	----	----	----
Não	012.345.678-90	Não	----	----	----
Não	012.345.678-90	Não	----	----	----

(continua)

Agente de Calculo - Contraparte	Código Sistema Origem	Sistema Origem
----	----	----
----	----	----
----	----	----
----	----	----

(fim)

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

Tela Detalhe do Contrato a Termo de Moeda

Nesta tela o Participante pode visualizar as características do contrato selecionado na tela anterior.

Contrato a Termo de Moeda Sem Entrega Física F12G64301					
COMPRADOR	05000.00-5 TESTE - BCO RIO S/A	CNPJ/CPF Comprador:			
VENDEDOR	05000.10-8 TESTE - BCO RIO S/A	CNPJ/CPF Vendedor:	111.111.112-00		
Cesta Garantias Comprador:	Não	Cesta Garantias Vendedor:	Não		
Data de Operação:	04/07/2012	Data de Vencimento:	01/04/2020		
Data de Registro:	04/07/2012				
Valor Base:	1.000.000,00	Situação:	CONFIRMADO		
Valor Antecipado:	0,00	Contrato Global	Não		
Moeda Base(Referência):	USD(220)-DOLAR DOS EUA	Taxa a Termo :	5,00000000	Cross Rate na Avaliação?	Não
Ajustar Taxa:	Não	Responsável pelo Ajuste de Taxa:			
Data Inicial para ajuste de taxa:		Data Final para ajuste de taxa:		Taxa ajustada em:	
Saldo:	-2.651.400,00	Taxa de Câmbio Utilizada na Avaliação:		Data da Última Atualização:	
Fonte de Informação:	SISBACEN				
Cotação para o Vencimento:	D-1	Boletim:	PTAX800 Fechamento		
Moeda Cotada:	BRL(790)-REAL	Taxa média para Termo Asiático:	--		
Termo a Termo:	Não	Data de Fixação:			
Forma de Atualização:		Valor ou Percentual de Negociado:			
Limites:		Superior (Paridade):			
		Inferior (Paridade):			
Prêmio a ser pago pelo:		Valor do Prêmio (R\$):			
Modalidade de Liquidação:		Código Identificador:			
Observação:					

Observação:

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

4.3 Operações

Termo > Consultas > Operações

Visão Geral

Esta função exibe todas as operações do participante, pendentes ou atualizadas, realizadas no dia da consulta.

Tela Filtro

Operações	
Participante (Nome Simplificado):	LEMEBM
Participante (Razão Social):	
Tipo de Conta Participante:	PRÓPRIA ▼
Participante (Conta):	. -
Contraparte (Nome Simplificado):	
Contraparte (Razão Social):	
Tipo de Conta Contraparte:	▼
Contraparte (Conta):	. -
Tipo de Operação:	Todas ▼
Originou Financeiro?	Todos ▼
Contrato:	
Pesquisar Limpar Campos	

Após o preenchimento dos campos da Tela de Filtro, clique no botão **Pesquisar**. É apresentada a Tela de Relação com os dados postados.

Na Tela de Relação, a coluna Contrato identifica o número do contrato. Ao ser selecionado, exibe as características do contrato.

Descrição dos Campos da Tela Filtro

Campo	Descrição
Participante (Nome simplificado)	Nome simplificado que identifica, no ambiente da Cetip, o participante envolvido na operação.
Participante (Razão Social)	Razão Social do participante envolvido na operação.
Tipo de Conta Participante	Identificação da conta do Participante. Lista pré-definida de valores: Própria, Cliente1, Cliente2, Emissora, Caução, Reserva Técnica ou Margem.
Participante (Conta)	Número da conta do participante na Cetip.
Contraparte (Nome simplificado)	Nome simplificado que identifica, no ambiente da Cetip, o outro membro envolvido no lançamento da operação.
Contraparte (Razão Social)	Razão Social da contraparte envolvida na operação.
Tipo de conta Contraparte	Identificação da conta da Contraparte. Lista pré-definida de valores: Própria, Cliente1, Cliente2, Emissora, Caução, Reserva Técnica ou Margem.
Contraparte (Conta)	Número da conta da contraparte da operação na Cetip.

Campo	Descrição
Tipo de Operação	Determina a opção de operação pela qual o participante quer realizar a consulta. Lista pré-definida de valores: Registro, contrato entre clientes, cancelamento, resgate contrato, antecipação, atualização taxa, pendente de câmbio, cessão contrato, confirmação de cessão, intermediação do contrato, pagamento intermediação, alteração e etc.
Originou financeiro?	Se a consulta é para operações que gera financeiro ou não.
Contrato	Número que identifica o contrato no qual incide a operação. É exibido <i>link</i> para visualizar as características do mesmo.

Tela de Relação

Consulta de Operações

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 12 de 12)

Data e Hora da Consulta: 30/07/2014 - 15:02:45

Operação	Participante	Posição	Contraparte	Posição	Tipo de Operação
14424515	10020.00-1 BANCO LEME S/A	VENDEDOR	01973.00-2 TESTE BANCO LAPA S/A	COMPRADOR	REGISTRO
14424516	10020.00-1 BANCO LEME S/A	VENDEDOR	01973.00-2 TESTE BANCO LAPA S/A	COMPRADOR	REGISTRO
14424517	10020.00-1 BANCO LEME S/A	VENDEDOR	01973.00-2 TESTE BANCO LAPA S/A	COMPRADOR	REGISTRO
14424518	10020.00-1 BANCO LEME S/A	VENDEDOR	01973.00-2 TESTE BANCO LAPA S/A	COMPRADOR	REGISTRO
14424519	10020.00-1 BANCO LEME S/A	VENDEDOR	01973.00-2 TESTE BANCO LAPA S/A	COMPRADOR	PAGAMENTO DE PREMIO

(continua)

Contrato	Valor (R\$)	Modalidade	Situação	Operação Original
F14G09170	----	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	FINALIZADA	----
F14G09171	----	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	FINALIZADA	----
F14G09172	----	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	FINALIZADA	----
F14G09173	----	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	FINALIZADA	----
F14G09173	-200,20	Bilateral STR	EST: TIMEOUT LIQ BL	14424518

(fim)

Descrição dos Campos da Tela de Relação

Campo	Descrição
Operação	Número atribuído pelo sistema a operação.
Participante	Código da conta do Participante que identifica o membro envolvido na operação.
Posição	Situação que se encontra a Parte na operação: Comprador, vendedor, intermediador ou intermediado.
Contraparte (conta)	Código da conta que identifica o outro membro envolvido no lançamento da operação.
Posição	Situação que se encontra a contraparte na operação: Comprador, vendedor, intermediador ou intermediado.

Campo	Descrição
Tipo de Operação	Nome que identifica a operação efetuada.
Contrato	Número que identifica o contrato no qual incide a operação. É exibido <i>link</i> para visualizar as características do mesmo.
Valor (R\$)	Exibido quando Tipo de Operação for resgate ou de antecipação.
Modalidade	Forma de liquidação financeira da operação.
Situação	Situação que se encontra a operação no momento da consulta.
Operação Original	Número da operação que está sendo estornada.

5 INFORMAÇÕES ADICIONAIS

5.1 Ativos Subjacentes Disponíveis

A consulta dos ativos subjacentes disponíveis para registro pode ser consultada através dos seguintes arquivos públicos, na plataforma NoMe:

Caso o Tipo Indicador seja PARIDADE:

Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos > AAAAMMDD_Indexadores_TERMO

Caso o Tipo Indicador seja MERCADORIA:

Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos > AAAAMMDD_Mercadorias

O Termo não permite o registro com parâmetro VCP como referência para apuração da atualização de seus contratos.

Cadastro de novos ativos subjacentes

Solicitações para inclusão de novos ativos-subjacentes podem ser feitas através do e-mail indices@b3.com.br.

5.2 Cruzamento de Funcionalidades

	Contrato	Contrato com Cesta de Garantia	Estorno	Taxa de Câmbio para Avaliação	Intermediação
Estorno	Possível			Possível	Possível
Antecipação	Possível	Possível	Possível		
Taxa de Câmbio para Avaliação	Possível	Possível	Possível		

	Contrato	Contrato com Cesta de Garantia	Estorno	Taxa de Câmbio para Avaliação	Intermediação
Intermediação	Possível	Possível	Possível		
Cessão	Possível		Possível		
Confirmação de Cessão			Possível		
Alteração de Lançamento	Possível	Possível		Possível	Possível
Alteração de Contrato	Possível				

5.3 Regras de Registro Conforme Fonte de Informação

Fontes Alternativas de Obtenção de Taxas de Câmbio

As fontes alternativas de utilização de cotações de compra venda ou média entre compra e venda são:

Sisbacen

Sistema de informação do Banco Central.

Os valores relativos às cotações utilizados para avaliação e liquidação dos contratos são obtidos através da consulta a este sistema.

Feeder

Sistema de informação de dados com atualização em tempo real.

Os valores relativos às cotações utilizados para avaliação e liquidação dos contratos são informados, através de função específica no sistema.

Spot

Alternativa disponível somente para moeda Dólar dos Estados Unidos.

Os valores relativos à cotação utilizados para avaliação e liquidação dos contratos são informados, através de função específica no sistema, pelos participantes registradores conforme as características do contrato previamente pactuadas no registro.

Sisbacen/Feeder

Alternativa válida exclusivamente para contratos que utilizam o *Cross Rate*.

Fonte mista de informação de taxas de câmbio para avaliação e liquidação de contratos.

Campos Que Devem Ser Informados Conforme a Escolha da Fonte de Informação

Campo da Tela Contrato	Campo Equivalente na Mensageria	FEEDER R	SPO T	SISBACE N	SISBACEN/FEEDER R
<TpContrtoTermo>					
Cotação para o Vencimento	<IndrDesloc>			Ver tabela 4 e 5	Ver tabela 6

Campo da Tela Contrato	Campo Equivalente na Mensageria	FEEDER	SPO T	SISBACE N	SISBACEN/FEEDER
Boletim	<IndrBol>			Ver tabela 4 e 5	Ver tabela 6
Fonte de Consulta	<TpFnte>	Ver tabela 1, 2, 7 e 8	Ver tabela 3		Ver tabela 7 e 8
Tela ou Função de Consulta	<DescRefCons>	X	X		X
Praça de Negociação	<DescPcaCot>	X	X		X
Horário de Consulta	<DescHrioCons >	X	X		X
Cotação Taxa Câmbio R\$/Cotada ou R\$/USD	<TpCotCam>	X	X		Ver tabela 6
Cotação Paridade Moeda/USD ou USD/Moeda	<TpCotParid>	Ver tabela 1 e 2	Ver tabela 3		Ver tabela 6
Data da Avaliação	<DtAval>	X	X		X

Tabela 1 - Fonte de Informação: FEEDER e moeda USD

Fonte de consulta	Cotação Taxa Câmbio	Cotação Paridade
Bloomberg, Reuters, Broadcast.	Venda	Nenhum
	Compra	
	Média	

É obrigatório selecionar a opção: Nenhum do campo Cotação-Paridade.
Não pode ser selecionado o campo *Cross Rate*.
Não é permitida fonte de consulta *Spot* e BCE- Banco Central Europeu.

Tabela 2 - Fonte de Informação: FEEDER e outra moeda diferente de USD

Fonte de consulta	Cotação Taxa Câmbio	Cotação Paridade
	Venda	

Fonte de consulta	Cotação Taxa Câmbio	Cotação Paridade
-------------------	---------------------	------------------

Bloomberg, Reuters, Broadcast, BCE.	Compra	Venda ou Compra ou Média ou Nenhum.
	Média	

É obrigatório informar Cotação-Paridade com Venda ou Compra ou Média, se o campo *Cross Rate* for selecionado com SIM.

Não é permitida fonte de consulta *Spot*.

É obrigatório informar Cotação-Paridade com Nenhum, se o campo *Cross Rate* for selecionado com NÃO.

Tabela 3 - Fonte de Informação: SPOT e moeda USD

Fonte de consulta	Cotação Taxa Câmbio	Cotação Paridade
-------------------	---------------------	------------------

Somente <i>Spot</i>	Venda	Nenhum
	Compra	
	Média	

É obrigatório selecionar a opção: Nenhum do campo Cotação-Paridade.

Não pode ser selecionado o campo *Cross Rate*.

Não é possível com outro tipo de moeda.

Tabela 4 - Fonte de Informação: SISBACEN e moeda USD

Cotação para o vencimento	Boletim
---------------------------	---------

D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5	PTAX800 18:00-Fechamento
--------------------------	--------------------------

Não é permitida a seleção do campo *Cross Rate*.

Tabela 5 - Fonte de Informação: SISBACEN e outra moeda diferente de USD

Cotação para o vencimento	Boletim
---------------------------	---------

D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5	PTAX800 de Fechamento
--------------------------	-----------------------

Não é permitida a seleção do campo *Cross Rate*.

Tabela 6 - Fonte de Informação: SISBACEN/FEEDER e outra moeda diferente de USD e EURO

Cotação para o vencimento	Boletim	Fonte de Consulta	Cotação Taxa de Câmbio	Cotação Paridade
D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5	PTAX800 de 18:00 Fechamento	Bloomberg, Reuters, Broadcast.	Venda	Compra, Venda ou Média.

Cotação para o vencimento	Boletim	Fonte de Consulta	Cotação Taxa de Câmbio	Cotação Paridade
---------------------------	---------	-------------------	------------------------	------------------

É obrigatório informar Cross Rate.

Não é possível Cotação Paridade Nenhum.

Não é permitida fonte de consulta *Spot*.

Tabela 7 - Fonte de Informação: FEEDER e moeda EURO

Fonte de consulta	Cotação Taxa Câmbio	Cotação Paridade
Bloomberg, Reuters, Broadcast, BCE.	Venda	Venda ou Compra ou Média ou Nenhum.
	Compra	
	Média	

É obrigatório informar Cotação-Paridade com Venda ou Compra ou Média, se o campo *Cross Rate* for selecionado.

Não é permitida fonte de consulta *Spot*.

Tabela 8 - Fonte de Informação: SISBACEN/FEEDER e moeda EURO

Cotação para o vencimento	Boletim	Fonte de Consulta	Cotação Taxa de Câmbio	Cotação Paridade
D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5	PTAX800 de 18:00 Fechamento	Bloomberg, Reuters, Broadcast, BCE.	Venda	Compra, Venda ou Média.

É obrigatório informar *Cross Rate*.

Não é possível Cotação Paridade Nenhum.

Não é permitida fonte de consulta *Spot*.

5.4 Informações Adicionais – Termo de Mercadoria

Identificação dos envolvidos na operação de Cessão de Contrato

Adquirente: Pessoa física ou jurídica que adquire o contrato

Anuente: Participante que permaneceu no contrato

Cedente: Participante (ou a Contraparte) que transfere o contrato.

Datas de *Fixing*

Os contratos de Termo de Mercadoria apresentam dois campos para *fixing* conforme tabela abaixo:

Campo	Descrição	Deslocamento (D-1,..., D-5)
Data de Cotação para Ajuste	contém a informação do deslocamento para a captura da cotação/preço da mercadoria	“Pula” sábado e domingo
Cotação de Moeda para o Vencimento	contém a informação do deslocamento para a captura da cotação da moeda (paridade entre a moeda de cotação da mercadoria contra o Real)	“Pula” sábado, domingo e feriados nacionais*

* feriados nacionais em que não há funcionamento na plataforma NoMe, Subsistema de registro do Balcão B3.

Tratamento de mercadorias internacionais em feriados

Se na data de *fixing* da mercadoria não houver divulgação do preço na bolsa em que a mercadoria é cotada, será utilizada a última cotação disponível.

Se a data de *fixing* da mercadoria for feriado nacional, mas houver divulgação do preço na bolsa em que a mercadoria é cotada, será utilizada a cotação divulgada pela bolsa de referência.

Exemplos práticos de deslocamento do fixing da mercadoria:

- a) Feriado sexta-feira no Brasil e tem vencimento de contrato na própria sexta-feira, com:
 - Fixing D-1: O contrato será liquidado na segunda-feira com cotação da quinta-feira.
 - Fixing D-2: O contrato será liquidado na segunda-feira com cotação da quarta-feira.
- b) Feriado internacional na quinta-feira e feriado local na sexta-feira, com vencimento de contrato na segunda-feira, com:
 - Fixing D-1: O contrato será liquidado na segunda-feira, com cotação de sexta-feira.
 - Fixing D-2: O contrato será liquidado na segunda-feira, com cotação de quarta-feira.

Outras Informações:

- É admitida a antecipação do contrato a Termo de Mercadoria, total ou parcial, a partir do primeiro dia útil após o registro até o dia útil anterior a data de seu vencimento.
- A ocorrência de inadimplência no pagamento referente à antecipação do contrato a Termo de Mercadoria, total ou parcial, acarretará o estorno da antecipação, voltando a vigorar, portanto, as condições anteriores a mesma.
- A liquidação financeira do valor da comissão devida pela intermediação de contrato a Termo de Mercadoria somente é processada no módulo na data do registro do respectivo contrato.
- É permitido que figure como Intermediador de contratos Participantes com natureza de Banco Múltiplo, Banco Comercial, Banco de Investimento, Corretoras e Distribuidoras.

- A operação de retificação de características de contrato a Termo de Mercadoria é disponibilizada exclusivamente para Participante titular de conta cliente, para correção dos contratos que tenham como partes o próprio e seu Cliente 1 ou 2.
- Se na data do evento houver inadimplência, o participante titular da conta cliente tem a possibilidade de informar esta situação na função Informar Não Pagamentos de Eventos, no Módulo de Operações, desta forma o Módulo altera a situação do evento para Retirado por Inadimplência.

5.5 Cross Rate

É a taxa de câmbio resultante das cotações de duas moedas, tendo como referência uma terceira moeda.

O uso desta opção não é permitido, quando moeda de referência ou cotada for Dólar dos EUA e quando a fonte de informação for Sisbacen.

A Cetip adota dois processos para obtenção das taxas de câmbio resultantes expressas em Reais por Moeda para avaliações intermediárias e avaliação para liquidações no vencimento, conforme o tipo de moeda de referência.

O sistema calcula a taxa resultante, baseadas no campo **Tipo** da Tabela Moedas Autorizadas para Registros de Contratos a Termo, no capítulo Informações Adicionais/Moedas Negociadas, cujo domínio é A ou B.

Observações: Para maiores informações acesse o **Caderno de Fórmulas** no *site* da Cetip.

5.6 Metodologia de Cálculo

Os cálculos aplicáveis na atualização dos contratos, de suas funcionalidades e de sua liquidação financeira, estão disponibilizados para download no site da Cetip (www.cetip.com.br), na seção Informação Técnica/Caderno de Fórmulas.

5.7 Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros

Para Contrato de Termo de Moeda – TMO e Contrato de Termo de Commodity – TCO.

Exemplo: F13H06089

Onde:

F - será sempre F

13 - Dois últimos dígitos do ano da data de operação

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

06089 - Sequência numérica.

