

16 de abril de 2024  
058/2024-PRE

## OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Adequação dos Contratos de Derivativos Listados ao Tratamento de Feriado Extraordinário – Contratos de Moedas**

De acordo com Ofício Circular 160/2023-PRE de 10/10/2023, a B3 definiu o tratamento que será adotado nos Contratos de Derivativos Listados da B3 (Contratos), em caso de determinação de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3 (Feriado Extraordinário).

Os tratamentos foram definidos em grupos de acordo com as características dos Contratos, conforme descrito abaixo.

**Grupo 1** – Contratos que acumulam taxa ou índice.

**Grupo 2** – Contratos que não acumulam taxa ou índice e dependem de sessão de negociação.

**Grupo 3** – Contratos que não acumulam taxa ou índice e dependem de variáveis externas à B3, sendo **a)** PTAX ou **b)** Variável Offshore.

O tratamento de Feriado Extraordinário já está previsto nos Normativos da B3 desde 30/01/2023, conforme Ofício Circular 006/2023-PRE de 23/01/2023.

As novas versões dos Contratos listados abaixo, já ajustadas com o tratamento de Feriado Extraordinário, constam nos Anexos deste Ofício Circular e entram em vigor na presente data. As novas versões estarão disponíveis no site da B3, a partir de **30/04/2024**, em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br), Produtos e Serviços, Negociação, em Moedas (Anexos I ao XXXVIII); e Juros (Anexos XXXIX e XL).

- Anexo I: Contrato Futuro de Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial
- Anexo II: Contrato Futuro Míni de Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial
- Anexo III: Contrato de Opção de Compra sobre Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial
- Anexo IV: Contrato de Opção de Venda sobre Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial
- Anexo V: Minicontrato de Opção de Compra sobre Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial
- Anexo VI: Minicontrato de Opção de Venda sobre Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial
- Anexo VII: Minicontrato de Opção de Compra sobre Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial – Vencimentos Semanais
- Anexo VIII: Minicontrato de Opção de Venda sobre Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial – Vencimentos Semanais
- Anexo IX: Contrato Futuro de Coroa Norueguesa por USD (NOK)
- Anexo X: Contrato Futuro de Coroa Sueca por USD (SEK)
- Anexo XI: Contrato Futuro de Dólar Canadense por USD (CAN)
- Anexo XII: Contrato Futuro de Franco Suíço por USD (SWI)
- Anexo XIII: Contrato Futuro de Iene Japonês por USD (JAP)

- Anexo XIV: Contrato Futuro de Iuan Chinês por USD (CNH)
- Anexo XV: Contrato Futuro de Lira Turca por USD (TUQ)
- Anexo XVI: Contrato Futuro de Peso Argentino por USD (ARS)
- Anexo XVII: Contrato Futuro de Peso Chileno por USD (CHL)
- Anexo XVIII: Contrato Futuro de Peso Mexicano por USD (MEX)
- Anexo XIX: Contrato Futuro de Rande da África do sul por USD (AFS)
- Anexo XX: Contrato Futuro de Rublo Russo por USD (RUB)
- Anexo XXI: Contrato Futuro de USD por Dólar Australiano (AUS)
- Anexo XXII: Contrato Futuro de USD por Dólar da Nova Zelândia (NZL)
- Anexo XXIII: Contrato Futuro de USD por Euro (EUP)
- Anexo XXIV: Contrato Futuro de USD por Libra Esterlina (GBR)
- Anexo XXV: ARB – Contrato Futuro de Reais por Peso Argentino
- Anexo XXVI: AUD – Contrato Futuro de Câmbio Reais por Dólar Australiano
- Anexo XXVII: CAD – Contrato Futuro de Câmbio Reais por Dólar Canadense
- Anexo XXVIII: CHF – Contrato Futuro de Taxa de Câmbio de Reais por Franco Suíço
- Anexo XXIX: CLP – Contrato Futuro de Reais por Peso Chileno
- Anexo XXX: CNY – Contrato Futuro de Taxa de Câmbio de Reais por Iuan
- Anexo XXXI: EUR – Contrato Futuro de Taxa de Câmbio de Reais por Euro
- Anexo XXXII: GBP – Contrato Futuro de Taxa de Câmbio de Reais por Libra Esterlina
- Anexo XXXIII: JPY – Contrato Futuro de Taxa de Câmbio Reais por Iene Japonês
- Anexo XXXIV: MXN – Contrato Futuro de Reais por Peso Mexicano
- Anexo XXXV: NZD – Contrato Futuro de Câmbio Reais por Dólar da Nova Zelândia
- Anexo XXXVI: TRY – Contrato Futuro de Reais por Lira Turca

058/2024-PRE

- Anexo XXXVII: WEU – Contrato Futuro Míni de Reais por Euro
- Anexo XXXVIII: ZAR – Contrato Futuro de Reais por Rande da África do Sul
- Anexo XXXIX: DDI – Contrato Futuro de Cupom Cambial de Depósitos Interfinanceiros de Um Dia
- Anexo XL: SCS – Contrato de Swap Cambial com Ajuste Periódico Baseado em Operações Compromissadas de Um Dia

Ressalta-se que novos contratos e aqueles que, eventualmente, forem ajustados, já serão publicados com a nova redação.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Vice-Presidência de Operações – Negociação Eletrônica e CCP, pelo telefone (11) 2565-5030 ou pelo e-mail [pricing@b3.com.br](mailto:pricing@b3.com.br).

Gilson Finkelsztain  
Presidente

Mario Palhares  
Vice-Presidente de Operações –  
Negociação Eletrônica e CCP



## Anexo I do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR DÓLAR COMERCIAL

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de BRL por USD, negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	DOL
<b>Tamanho do contrato</b>	USD50.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em BRL por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,5 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo.
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo.
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo.
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em taxa de câmbio de reais (BRL) por 1.000,00 dólares dos Estados Unidos da América (USD), com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas no site da B3, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; (ii) "Dia de Sessão de Negociação" quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do dia, com movimentação financeira no Dia de Sessão de Negociação subsequente. O ajuste diário, para cada mês de vencimento, será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

### a) Ajuste da operação realizada no dia da contratação da operação

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 50 \times N$$

### b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 50 \times N$$

058/2024-PRE

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

PO = preço da operação;

N = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1", para o respectivo vencimento.

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

### **3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente, mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) à das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times 50.000 \times n$$

Onde:

VL = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD do Dia Útil anterior à data de vencimento, conforme definida no item 1;

n = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da referida taxa, a data de fixing e a data de vencimento serão mantidas, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de fixing será postergada para o primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para a sessão de negociação subsequente ao dia da captura da taxa de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato, e a data de vencimento será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

##### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.





058/2024-PRE

## **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

## **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



**Anexo II do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE**  
**CONTRATO FUTURO MÍNII DE TAXA DE CÂMBIO DE**  
**REAIS POR DÓLAR COMERCIAL**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de BRL por USD, negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	WDO
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em BRL por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,5 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês anterior ao vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em taxa de câmbio de reais (BRL) por 1.000,00 dólares dos Estados Unidos da América (USD), com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas no site da B3, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e de apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil.

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; (ii) "Dia de Sessão de Negociação" quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do dia, com movimentação financeira no Dia da Sessão de Negociação subsequente.

O ajuste diário, para cada mês de vencimento, será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 10 \times n$$

### b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 10 \times n$$

058/2024-PRE

Onde:

 $AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t"; $PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento; $PO$  = preço da operação; $n$  = número de contratos; $PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

### **3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) à da posição, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times 10.000 \times n$$

Onde:

 $VL$  = valor de liquidação, em reais; $TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD do Dia Útil anterior à data de vencimento, conforme definida no item 1; $n$  = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da referida taxa, a data de fixing e a data de vencimento serão mantidas, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de fixing será postergada para o primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para a sessão de negociação subsequente ao dia da captura da taxa de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato, e a data de vencimento será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

##### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.



058/2024-PRE

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



**Anexo III do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE**  
**CONTRATO DE OPÇÃO DE COMPRA SOBRE**  
**TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR DÓLAR COMERCIAL**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Opção de compra padronizada, negociada em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3), sobre a variação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), taxa PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil (opção)
<b>Titular</b>	O agente econômico que adquire a opção
<b>Lançador</b>	O agente econômico que vende a opção
<b>Código de negociação</b>	DOL
<b>Tamanho do contrato</b>	USD50.000,00
<b>Cotação do prêmio</b>	Valor expresso em reais (BRL) por USD1.000,00, com três casas decimais, a ser pago pelo titular e recebido pelo lançador (prêmio)
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,001 por USD1.000,00
<b>Preço de exercício</b>	Será estabelecido e divulgado pela B3, expresso em reais por USD1.000,00
<b>Estilo da opção</b>	Europeu, ou seja, com exercício apenas no vencimento

<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Último Dia de Sessão de Negociação do mês anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; (ii) "Dia de Sessão de Negociação" quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3.

## 2. Liquidação financeira do prêmio

O pagamento e o recebimento do prêmio serão efetuados no Dia de Sessão de Negociação subsequente ao de realização da operação, sendo o respectivo valor de liquidação calculado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VLP = P \times M \times N$$

Onde:

VLP = valor de liquidação do prêmio;

P = prêmio da opção negociado;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 50;

N = número de contratos negociados.



### 3. Exercício

O exercício da opção é automático no vencimento do contrato, sempre que o valor de liquidação no exercício, conforme definido na cláusula 4, for positivo e não houver solicitação de bloqueio do exercício pelo titular, que poderá ser feita no último dia de negociação.

### 4. Liquidação no exercício

A liquidação das posições exercidas será realizada de forma exclusivamente financeira, mediante o crédito do valor de liquidação ao titular e o débito do mesmo valor ao lançador, em reais, no Dia Útil subsequente ao vencimento, conforme fórmula abaixo:

$$VL = [(TC \times 1.000) - PE] \times M \times N$$

Onde:

VL = valor de liquidação do exercício;

TC = taxa de câmbio de BRL por USD, apurada nos termos definidos na cláusula 1 (objeto), na data de fixing;

PE = preço de exercício;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 50;

N = número de contratos exercidos.

### 5. Condições especiais

#### a) Feriado Extraordinário

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da referida taxa, a data de fixing e a data de vencimento serão mantidas, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a

data de fixing será postergada para o primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para a sessão de negociação subsequente ao dia da captura da taxa de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato, e a data de vencimento será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

#### **6. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

#### **7. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



**Anexo IV do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE**  
**CONTRATO DE OPÇÃO DE VENDA SOBRE**  
**TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR DÓLAR COMERCIAL**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Opção de venda padronizada, negociada em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3), sobre a variação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), taxa PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil (opção)
<b>Titular</b>	O agente econômico que adquire a opção
<b>Lançador</b>	O agente econômico que vende a opção
<b>Código de negociação</b>	DOL
<b>Tamanho do contrato</b>	USD50.000,00
<b>Cotação do prêmio</b>	Valor expresso em reais (BRL) por USD1.000,00, com três casas decimais, a ser pago pelo titular e recebido pelo lançador (prêmio)
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,001 por USD1.000,00
<b>Preço de exercício</b>	Será estabelecido e divulgado pela B3, expresso em reais por USD1.000,00
<b>Estilo da opção</b>	Europeu, ou seja, com exercício apenas no vencimento

<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Último Dia de Sessão de Negociação do mês anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; (ii) "Dia de Sessão de Negociação" quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3.

## 2. Liquidação financeira do prêmio

O pagamento e o recebimento dos prêmios serão efetuados no Dia de Sessão de Negociação subsequente ao de realização da operação, sendo o valor de liquidação calculado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VLP = P \times M \times N$$

Onde:

VLP = valor de liquidação do prêmio por contrato;

P = prêmio da opção negociado;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 50;

N = número de contratos negociados.

### 3. Exercício

O exercício da opção é automático no vencimento do contrato, sempre que o valor de liquidação no exercício, conforme definido na cláusula 4, for positivo e não houver solicitação de bloqueio do exercício pelo titular, que poderá ser feita no último dia de negociação.

### 4. Liquidação no exercício

A liquidação das posições exercidas será realizada de forma exclusivamente financeira, mediante o crédito do valor de liquidação ao titular e o débito do mesmo valor ao lançador, em reais, no Dia Útil subsequente ao vencimento, conforme fórmula abaixo:

$$VL = [PE - (TC \times 1.000)] \times M \times N$$

Onde:

VL = valor de liquidação do exercício;

PE = preço de exercício;

TC = taxa de câmbio de BRL por USD, apurada nos termos definidos na cláusula 1 (objeto), na data de fixing ;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 50;

N = número de contratos exercidos.

### 5. Condições especiais

#### a) Feriado Extraordinário

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da referida taxa, a data de fixing e a data de vencimento serão mantidas, conforme descrito na cláusula 1 do contrato.

Caso não haja divulgação da taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de fixing será postergada para o primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para a sessão de negociação subsequente ao dia da captura da taxa de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato, e a data de vencimento será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**6. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**7. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo V do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### MINICONTRATO DE OPÇÃO DE COMPRA SOBRE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR DÓLAR COMERCIAL

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Opção de compra padronizada, negociada em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3), sobre a variação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), taxa PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil (opção)
<b>Titular</b>	O agente econômico que adquire a opção
<b>Lançador</b>	O agente econômico que vende a opção
<b>Código de negociação</b>	WDO
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação do prêmio</b>	Valor expresso em reais (BRL), por USD1.000,00, com três casas decimais, a ser pago pelo titular e recebido pelo lançador (prêmio)
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,001 por USD1.000,00
<b>Preço de exercício</b>	O preço de exercício será estabelecido e divulgado pela B3, expresso em reais por USD1.000,00
<b>Estilo da opção</b>	Europeu, ou seja, com exercício apenas no vencimento

<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo.
<b>Último dia de negociação</b>	Último Dia de Sessão de Negociação do mês anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; (ii) "Dia de Sessão de Negociação" quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3.

## 2. Liquidação financeira do prêmio

O pagamento e o recebimento do prêmio serão efetuados no Dia de Sessão de Negociação subsequente ao da realização da operação, sendo o respectivo valor de liquidação calculado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VLP = P \times M \times N$$

Onde:

VLP = valor de liquidação do prêmio;

P = prêmio da opção negociado;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 10;

N = número de contratos negociados.



### 3. Exercício

O exercício da opção é automático no vencimento do contrato, sempre que o valor de liquidação no exercício, conforme definido na cláusula 4, for positivo e não houver solicitação de bloqueio do exercício pelo titular, que poderá ser feita no último dia de negociação.

### 4. Liquidação no exercício

A liquidação das posições exercidas será realizada de forma exclusivamente financeira, mediante o crédito do valor de liquidação ao titular e o débito do mesmo valor ao lançador, em reais, no Dia Útil subsequente ao vencimento, conforme fórmula abaixo:

$$VL = [(TC \times 1.000) - PE] \times M \times N$$

Onde

VL = valor de liquidação do exercício;

TC = taxa de câmbio de BRL por USD, apurada nos termos definidos na cláusula 1 (objeto), na data de fixing;

PE = preço de exercício;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 10;

N = número de contratos exercidos.

### 5. Condições especiais

#### a) Feriado Extraordinário

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da referida taxa, a data de fixing e a data de vencimento serão mantidas, conforme descrito na cláusula do contrato.

Caso não haja divulgação da taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de fixing será postergada para o primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para a sessão de negociação subsequente ao dia da captura da taxa de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato, e a data de vencimento será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **6. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **7. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo VI do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### MINICONTRATO DE OPÇÃO DE VENDA SOBRE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR DÓLAR COMERCIAL

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Opção de venda padronizada, negociada em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3), sobre a variação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), taxa PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil (opção)
<b>Titular</b>	O agente econômico que adquire a opção
<b>Lançador</b>	O agente econômico que vende a opção
<b>Código de negociação</b>	WDO
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação do prêmio</b>	Valor expresso em reais (BRL), por USD1.000,00, com três casas decimais, a ser pago pelo titular e recebido pelo lançador (prêmio)
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,001 por USD1.000,00
<b>Preço de exercício</b>	O preço de exercício será estabelecido e divulgado pela B3, expresso em reais por USD1.000,00
<b>Estilo da opção</b>	Europeu, ou seja, com exercício apenas no vencimento

<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Último Dia de Sessão de Negociação do mês anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; (ii) "Dia de Sessão de Negociação" quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3.

## 2. Liquidação financeira do prêmio

O pagamento e o recebimento do prêmio serão efetuados no Dia de Sessão de Negociação subsequente ao da realização da operação, sendo o respectivo valor de liquidação calculado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VLP = P \times M \times N$$

Onde

VLP = valor de liquidação do prêmio;

P = prêmio da opção negociado;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 10;

N = número de contratos negociados.

### **3. Exercício**

O exercício da opção é automático no vencimento do contrato, sempre que o valor de liquidação no exercício, conforme definido na cláusula 4, for positivo e não houver solicitação de bloqueio do exercício pelo titular, que poderá ser feita no último dia de negociação.

### **4. Liquidação no exercício**

A liquidação das posições exercidas será realizada de forma exclusivamente financeira, mediante o crédito do valor de liquidação ao titular e o débito do mesmo valor ao lançador, em reais, no Dia Útil subsequente ao vencimento, conforme fórmula abaixo:

$$VL = [PE - (TC \times 1.000)] \times M \times N$$

Onde

VL = valor de liquidação do exercício;

PE = preço de exercício;

TC = taxa de câmbio de BRL por USD, apurada nos termos definidos na cláusula 1 (objeto), na data de fixing;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 10;

N = número de contratos exercidos.

### **5. Condições especiais**

#### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da referida taxa, a data de fixing e a data de vencimento serão mantidas, conforme descrito na cláusula 1 do contrato.

Caso não haja divulgação da taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de fixing será postergada para o primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para a sessão de negociação subsequente ao dia da captura da taxa de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato, e a data de vencimento será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **6. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **7. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.

**Anexo VII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE**

**MINICONTRATO DE OPÇÃO DE COMPRA SOBRE TAXA DE CÂMBIO DE  
REAIS POR DÓLAR COMERCIAL – VENCIMENTOS SEMANAIS**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Opção de compra padronizada, negociada em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3), sobre a variação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), taxa PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil (opção)
<b>Titular</b>	O agente econômico que adquire a opção
<b>Lançador</b>	O agente econômico que vende a opção
<b>Código de negociação</b>	Cada tipo de opção, referenciada de acordo com o respectivo vencimento, será identificada como: <ul style="list-style-type: none"><li>– DS1: opção do tipo 1</li><li>– DS2: opção do tipo 2</li><li>– DS3: opção do tipo 3</li><li>– DS4: opção do tipo 4</li></ul>
<b>Tipo de série</b>	<ul style="list-style-type: none"><li>– Opção do tipo 1: com vencimento na primeira sessão de negociação imediatamente posterior à 1ª sexta-feira do mês de vencimento</li><li>– Opção do tipo 2: com vencimento na primeira sessão de negociação imediatamente posterior à 2ª sexta-feira do mês de vencimento</li></ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>– Opção do tipo 3: com vencimento na primeira sessão de negociação imediatamente posterior à 3ª sexta-feira do mês de vencimento</li> <li>– Opção do tipo 4: com vencimento na primeira sessão de negociação imediatamente posterior à 4ª sexta-feira do mês de vencimento</li> </ul>
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação do prêmio</b>	Valor expresso em reais (BRL), por USD1.000,00, com três casas decimais, a ser pago pelo titular e recebido pelo lançador (prêmio)
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,001 por USD1.000,00
<b>Preço de exercício</b>	Os preços de exercício serão estabelecidos e divulgados pela B3, expressos em reais (BRL) por USD1.000,00
<b>Estilo da opção</b>	Europeu, ou seja, com exercício apenas no vencimento
<b>Data de vencimento</b>	De acordo com o tipo de série, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia Útil imediatamente anterior ao vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior ao vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses



Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; (ii) "Dia de Sessão de Negociação" quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3.

## **2. Liquidação financeira do prêmio**

O pagamento e o recebimento do prêmio serão efetuados no Dia de Sessão de Negociação subsequente ao da realização da operação, sendo o respectivo valor de liquidação calculado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VLP = P \times M \times N$$

Onde

VLP = valor de liquidação do prêmio;

P = prêmio da opção negociado;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 10;

N = número de contratos negociados.

## **3. Exercício**

O exercício da opção é automático no vencimento do contrato, sempre que o valor de liquidação no exercício, conforme definido na cláusula 4, for positivo e não houver solicitação de bloqueio do exercício pelo titular, que poderá ser feita no último dia de negociação.

## **4. Liquidação no exercício**

A liquidação das posições exercidas será realizada de forma exclusivamente financeira, mediante o crédito do valor de liquidação ao titular e o débito do mesmo valor ao lançador, em reais, no Dia Útil subsequente ao vencimento, conforme fórmula abaixo:

$$VL = [(TC \times 1.000) - PE] \times M \times N$$

Onde

VL = valor de liquidação do exercício;

TC = taxa de câmbio de BRL por USD apurada nos termos definidos na cláusula 1 (objeto), na data de fixing;

PE = preço de exercício;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 10;

N = número de contratos exercidos.

## 5. Condições especiais

### a) Feriado Extraordinário

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da referida taxa, a data de fixing e a data de vencimento serão mantidas, conforme descrito na cláusula 1 do contrato.

Caso não haja divulgação da taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de fixing será postergada para o primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para a sessão de negociação subsequente à captura da taxa de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato, e a data de vencimento será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**6. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**7. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.

Anexo VIII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

**MINICONTRATO DE OPÇÃO DE VENDA SOBRE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS  
POR DÓLAR COMERCIAL – VENCIMENTOS SEMANAIS**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Opção de venda padronizada, negociada em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3), sobre a variação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), taxa PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil (opção)
<b>Titular</b>	O agente econômico que adquire a opção
<b>Lançador</b>	O agente econômico que vende a opção
<b>Código de negociação</b>	Cada tipo de opção, referenciada de acordo com o respectivo vencimento, será identificada como: <ul style="list-style-type: none"><li>– DS1: opção do tipo 1</li><li>– DS2: opção do tipo 2</li><li>– DS3: opção do tipo 3</li><li>– DS4: opção do tipo 4</li></ul>
<b>Tipo de série</b>	<ul style="list-style-type: none"><li>– Opção do tipo 1: com vencimento na primeira sessão de negociação imediatamente posterior à 1ª sexta-feira do mês de vencimento</li><li>– Opção do tipo 2: com vencimento na primeira sessão de negociação imediatamente posterior à 2ª sexta-feira do mês de vencimento</li></ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>– Opção do tipo 3: com vencimento na primeira sessão de negociação imediatamente posterior à 3ª sexta-feira do mês de vencimento</li> <li>– Opção do tipo 4: com vencimento na primeira sessão de negociação imediatamente posterior à 4ª sexta-feira do mês de vencimento</li> </ul>
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00.
<b>Cotação do prêmio</b>	Valor expresso em reais (BRL), por USD1.000,00, com três casas decimais, a ser pago pelo titular e recebido pelo lançador (prêmio).
<b>Variação mínima de apreçoação (tick size)</b>	BRL0,001 por USD1.000,00
<b>Preço de exercício</b>	Os preços de exercício serão estabelecidos e divulgados pela B3, expressos em reais (BRL) por USD1.000,00
<b>Estilo da opção</b>	Europeu, ou seja, com exercício apenas no vencimento
<b>Data de vencimento</b>	De acordo com o tipo de série, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia Útil imediatamente anterior ao vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior ao vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 5, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; (ii) "Dia de Sessão de Negociação" quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3.

## **2. Liquidação financeira do prêmio**

O pagamento e o recebimento do prêmio serão efetuados no Dia de Sessão de Negociação subsequente ao da realização da operação, sendo o respectivo valor de liquidação calculado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VLP = P \times M \times N$$

Onde

VLP = valor de liquidação do prêmio;

P = prêmio da opção negociado;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 10;

N = número de contratos negociados.

## **3. Exercício**

O exercício da opção é automático no vencimento do contrato, sempre que o valor de liquidação no exercício, conforme definido na cláusula 4, for positivo e não houver solicitação de bloqueio do exercício pelo titular, que poderá ser feita no último dia de negociação.

## **4. Liquidação no exercício**

A liquidação das posições exercidas será realizada de forma exclusivamente financeira, mediante o crédito do valor de liquidação ao titular e o débito do mesmo valor ao lançador, em reais, no Dia Útil subsequente ao vencimento, conforme fórmula abaixo:

$$VL = [PE - (TC \times 1.000)] \times M \times N$$

Onde

VL = valor de liquidação do exercício;

PE = preço de exercício;

TC = taxa de câmbio de BRL por USD apurada nos termos definidos na cláusula 1 (objeto), na data de fixing;

M = multiplicador do contrato, estabelecido em 10;

N = número de contratos exercidos.

## 5. Condições especiais

### a) Feriado Extraordinário

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da referida taxa, a data de fixing e a data de vencimento serão mantidas, conforme descrito na cláusula 1 do contrato.

Caso não haja divulgação da taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de fixing será postergada para o primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para a sessão de negociação subsequente ao dia da captura da taxa de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato, e a data de vencimento será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**6. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**7. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.





## Anexo IX do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024- PRE

### CONTRATO FUTURO DE COROA NORUEGUESA POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de coroa norueguesa (NOK) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	NOK
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em coroa norueguesa (NOK) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	NOK1,00 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo

<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses
<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em coroa norueguesa (NOK) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de coroa norueguesa (NOK) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação**

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

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de coroa norueguesa por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

058/2024-PRE

Onde

VL = valor de liquidação, em reais;

TD<sub>t-1</sub> = taxa de câmbio de NOK por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;TxC<sub>t-1</sub> = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1";PC<sub>t-1</sub> = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de coroa norueguesa por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

#### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

#### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



**Anexo X do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE**  
**CONTRATO FUTURO DE COROA SUECA POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA**  
**AMÉRICA**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de coroa sueca (SEK) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	SEK
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em coroa sueca (SEK) por USD1.000,00, com uma casa decimal.
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	SEK1,00 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em coroa sueca (SEK) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de coroa sueca (SEK) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de coroa sueca por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

Onde

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de SEK por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;



$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1" ;

$PC_{t-1}$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de coroa sueca por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XI do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE DÓLAR CANADENSE POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de dólar canadense (CAD) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	CAN
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em dólar canadense (CAD) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	CAD0,10 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em dólar canadense (CAD) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de dólar canadense (CAD) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de dólar canadense por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

Onde

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de CAD por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1";

$PC_{t-1}$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de dólar canadense por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024- PRE

### CONTRATO FUTURO DE FRANCO SUÍÇO POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de franco suíço (CHF) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	SWI
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em franco suíço (CHF) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	CHF0,10 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo.
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses



<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em franco suíço (CHF) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de franco suíço (CHF) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>2</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

<sup>2</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de franco suíço por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

Onde

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de CHF por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

058/2024-PRE

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1" ;

$PC_{t-1}$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de franco suíço por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



**Anexo XIII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE**  
**CONTRATO FUTURO DE IENE JAPONÊS POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA**  
**AMÉRICA**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de iene japonês (JPY) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	JAP
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em iene japonês (JPY) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	JPY10,00 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em iene japonês (JPY) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de iene japonês (JPY) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de iene japonês por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

Onde

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de JPY por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1" ;

$PC_{t-1}$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de iene japonês por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.



Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XIV do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE IUAN CHINÊS POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de iuan chinês (CNH) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	CNH
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em iuan chinês (CNH) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	CNH0,50 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em iuan chinês (CNH) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de iuan chinês (CNH) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de iuan chinês por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

Onde

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de CNH por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1" ;

$PC_{t-1}$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de iuan chinês por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



**Anexo XV do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024- PRE**  
**CONTRATO FUTURO DE LIRA TURCA POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA**  
**AMÉRICA**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de lira turca (TRY) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	TUQ
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em lira turca (TRY) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	TRY0,50 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em lira turca (TRY) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de lira turca (TRY) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.



**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de lira turca por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

Onde

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de TRY por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1" ;

$PC_{t-1}$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de lira turca por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



**Anexo XVI do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE**  
**CONTRATO FUTURO DE PESO ARGENTINO POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS**  
**DA AMÉRICA**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de peso argentino (ARS) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	ARS
<b>Tamanho do contrato</b>	USD 10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em peso argentino (ARS) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	ARS0,10 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em peso argentino (ARS) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de peso argentino por dólar dos Estados Unidos da América (USD), divulgada pelo Mercado Abierto Eletrônico, ARS MAE 05 (ARS05), conhecida como a taxa média negociada ou PPN das 3 p.m. de Buenos Aires

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

### b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior

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

058/2024-PRE

Onde:

- $AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";
- $PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;
- $PO$  = preço da operação;
- $TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;
- $PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de peso argentino por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";
- $TM$  = tamanho do contrato;
- $n$  = número de contratos;
- $PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

### 3. Condições de liquidação no vencimento

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

Onde

- $VL$  = valor de liquidação, em reais;
- $TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de ARS por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1";

$PC_{t-1}$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de peso argentino por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

#### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

#### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.





## Anexo XVII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE PESO CHILENO POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de peso chileno (CLP) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	CHL
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em peso chileno (CLP) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	CLP50,00 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em peso chileno (CLP) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de peso chileno (CLP) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), "dólar observado", apurada e divulgada pelo Banco Central do Chile na data de fixing e referente à data de vencimento, seguindo as regras e metodologia publicadas em seu site

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

### b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior

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

058/2024-PRE

Onde:

- $AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";
- $PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;
- $PO$  = preço da operação;
- $TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;
- $PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h0, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de peso chileno por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";
- $TM$  = tamanho do contrato;
- $n$  = número de contratos;
- $PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

### 3. Condições de liquidação no vencimento

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

Onde

VL = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de CLP por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1";

$PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de peso chileno por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

#### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

#### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XVIII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE PESO MEXICANO POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de peso mexicano (MXN) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	MEX
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em peso mexicano (MXN) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	MXN1,00 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em peso mexicano (MXN) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de peso mexicano (MXN) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

- $AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";
- $PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;
- PO = preço da operação;
- $TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;
- $PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de peso mexicano por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";
- TM = tamanho do contrato;
- n = número de contratos;
- $PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$



058/2024-PRE

Onde

VL = valor de liquidação, em reais;

TD<sub>t-1</sub> = taxa de câmbio de MXN por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

TxC<sub>t-1</sub> = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1";

PC<sub>t-1</sub> = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de peso mexicano por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a

taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

#### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

#### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XIX do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE RANDE DA ÁFRICA DO SUL POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de rande da África do Sul (ZAR) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	AFS
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em rande da África do Sul (ZAR) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	ZAR1,00 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em rande da África do Sul (ZAR) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de rande da África do Sul (ZAR) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de rande da África do Sul por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

Onde

VL = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de ZAR por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1";

$PC_{t-1}$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de rande da África do Sul por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados

Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XX do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024- PRE

### CONTRATO FUTURO DE RUBLO RUSSO POR DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de rublo russo (RUB) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	RUB
<b>Tamanho do contrato</b>	USD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em rublo russo (RUB) por USD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	RUB10,00 por USD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses



<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em rublo russo (RUB) por USD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de rublo russo (RUB) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$PC_t$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de rublo russo por dólar dos Estados Unidos da América na data "t";

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times \frac{TxC_{t-1}}{PC_{t-1}} \times 10.000 \times n$$

058/2024-PRE

Onde

VL = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de RUB por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1";

$PC_{t-1}$  = taxa de câmbio spot das 16h, apurada diariamente pela B3 conforme regras divulgadas, de rublo russo por dólar dos Estados Unidos da América na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados

Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXI do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA POR DÓLAR AUSTRALIANO

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de dólar dos Estados Unidos da América (USD) por dólar australiano (AUD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	AUS
<b>Tamanho do contrato</b>	AUD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em dólar dos Estados Unidos da América (USD) por AUD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	USD0,10 por AUD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo

<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses
<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em dólar dos Estados Unidos da América (USD) por AUD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de dólar dos Estados Unidos da América (USD) por dólar australiano (AUD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação**

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

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times TxC_{T-1} \times 10.000 \times n$$

Onde

VL = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de USD por AUD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1" ;

n = número de contratos;

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.



Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

#### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

#### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA POR DÓLAR DA NOVA ZELÂNDIA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de dólar dos Estados Unidos da América (USD) por dólar da Nova Zelândia (NZD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	NZL
<b>Tamanho do contrato</b>	NZD10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em dólar dos Estados Unidos da América (USD) por NZD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	USD0,10 por NZD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo

<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses
<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em dólar dos Estados Unidos da América (USD) por NZD1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de dólar dos Estados Unidos da América (USD) por dólar da Nova Zelândia (NZD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação**

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

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times TxC_{T-1} \times 10.000 \times n$$

058/2024-PRE

Onde

VL = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de USD por NZD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

#### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

#### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXIII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA POR EURO

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de dólar dos Estados Unidos da América (USD) por euro (EUR), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	EUP
<b>Tamanho do contrato</b>	EUR10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em dólar dos Estados Unidos da América (USD) por EUR1.000,00, com uma casa decimal
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	USD0,10 por EUR1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em dólar dos Estados Unidos da América (USD) por EUR1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing</b>	Taxa de câmbio de dólar dos Estados Unidos da América (USD) por euro (EUR), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação, com movimentação financeira no Dia de Sessão de Negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a sessão de negociação imediatamente anterior ao vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados



**a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação**

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

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$TxC$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

$TM$  = tamanho do contrato;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times TC_{T-1} \times 10.000 \times n$$

Onde

VL = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de USD por EUR na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1";

n = número de contratos

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

#### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

#### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXIV do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE DÓLAR DOS ESTADOS UNIDOS DA AMÉRICA POR LIBRA ESTERLINA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de dólar dos Estados Unidos da América (USD) por libra esterlina (GBP), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	GBR
<b>Tamanho do contrato</b>	GBP10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em dólar dos Estados Unidos da América (USD) por GBP1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	USD0,10 por GBP1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em dólar dos Estados Unidos da América (USD) por GBP1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Preço de ajuste na data de fixing (TD)</b>	Taxa de câmbio de dólar dos Estados Unidos da América (USD) por libra esterlina (GBP), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

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

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

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

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior**

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

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

PO = preço da operação;

TxC = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3;

TM = tamanho do contrato;

n = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto serão liquidadas financeiramente, baseadas no preço de ajuste da data de fixing, de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TD_{T-1} \times TxC_{T-1} \times 10.000 \times n$$

Onde

VL = valor de liquidação, em reais;

$TD_{t-1}$  = taxa de câmbio de USD por GBP na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), para liquidação em 1 (um) dia, apurada e divulgada pela B3 na data "t-1";

n = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se "Feriado Extraordinário" o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário, a captura do fixing será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. Nessa hipótese, a data de vencimento será também postergada para a primeira sessão de negociação subsequente à data de captura da taxa de conversão.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para a primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD) utilizada para o cálculo do resultado financeiro em reais, nesta hipótese, será a taxa divulgada na primeira sessão de negociação subsequente ao Feriado Extraordinário, sendo certo que a data de divulgação da variável para a liquidação será mantida.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.





## Anexo XXV do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR PESO ARGENTINO

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por peso argentino (ARS), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	ARB
<b>Tamanho do contrato</b>	ARS150.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por ARS1.000,00, com uma casa decimal.
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por ARS1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por 1.000,00 pesos argentinos (ARS), com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de peso argentino (ARS) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), divulgada pelo Mercado Abierto Eletrônico, ARS MAE 05 (ARS05), conhecida como a taxa média negociada ou PPN das 3 p.m. de Buenos Aires
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação, com movimentação financeira na sessão de negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

### a) Ajuste da operação realizada no dia

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 150 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 150 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$n$  = número de contratos; e

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente, mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = \left( \frac{TxC_{T-1}}{TP_{T-1}} \right) \times 150.000 \times n$$

Onde:

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TxC_{T-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TP_{T-1}$  = taxa de câmbio de ARS por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$n$  = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de ARS por USD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de ARS por USD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de ARS por USD para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXVI do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE DÓLAR AUSTRALIANO POR REAL BRASILEIRO

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar australiano (AUD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	AUD
<b>Tamanho do contrato</b>	AUD60.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por AUD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por AUD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por AUD1.000,00 dólares australianos, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de dólares dos Estados Unidos da América (USD) por dólares Australianos (AUD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil.

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação, com movimentação financeira no dia útil subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 60 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 60 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente, mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) à das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = (TP_{t-1} \times TxC_{t-1}) \times 60.000 \times n$$

Onde:

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TP_{t-1}$  = taxa de câmbio de USD por AUD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$n$  = número de contratos.



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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de USD por AUD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de USD por AUD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de USD por AUD para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.

## Anexo XXVII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR DÓLAR CANADENSE

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar canadense (CAD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	CAD
<b>Tamanho do contrato</b>	CAD60.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por CAD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por CAD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por CAD1.000,00 dólares canadenses, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de dólar canadense (CAD) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil.

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia da Sessão de Negociação, com movimentação financeira na sessão de negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 60 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 60 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

PO = preço da operação;

n = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = \left( \frac{Tx C_{T-1}}{TP_{T-1}} \right) \times 60.000 \times n$$

058/2024-PRE

Onde:

VL = valor de liquidação, em reais;

TxCt-1 = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

TPt-1 = taxa de câmbio de CAD por USD, na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

n = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de CAD por USD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de CAD por USD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário;

058/2024-PRE

e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de CAD por USD para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.

Anexo XXVIII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

**CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR FRANCO SUÍÇO**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por francos suíços (CHF), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	CHF
<b>Tamanho do contrato</b>	CHF50.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por CHF1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apreço (tick size)</b>	BRL0,1 por CHF1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses



<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por CHF1.000,00 francos suíços, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de Franco Suíço (CHF) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação, com movimentação financeira na sessão de negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

058/2024-PRE

**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 50 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 50 \times n$$

Onde:

 $AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t"; $PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

PO = preço da operação;

n = número de contratos;

 $PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente, mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = \left( \frac{Tx C_{T-1}}{TP_{T-1}} \right) \times 50.000 \times n$$

058/2024-PRE

Onde:

VL = valor de liquidação, em reais;

TxCt-1 = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

TPt-1 = taxa de câmbio de CHF por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

n = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de CHF por USD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de CHF

058/2024-PRE

por USD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de CHF por USD para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXIX do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR PESO CHILENO

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por peso chileno (CLP), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	CLP
<b>Tamanho do contrato</b>	CLP25.000.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por CLP1.000.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por CLP1.000.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por 1.000.000,00 pesos chilenos (CLP), com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de pesos chilenos (CLP) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil.

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação com movimentação financeira na sessão de negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

058/2024-PRE

**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 25 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 25 \times n$$

Onde:

 $AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t"; $PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

PO = preço da operação;

n = número de contratos;

 $PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente, mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = \left( \frac{TxCT_{-1}}{TP_{T-1}} \right) \times 25.000.000 \times n$$

058/2024-PRE

Onde:

VL = valor de liquidação, em reais;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TP_{t-1}$  = taxa de câmbio de CLP por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

n = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de CLP por USD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de CLP por



058/2024-PRE

USD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de CLP por USD para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXX do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR IUAN

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por iuans chineses (CNY), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	CNY
<b>Tamanho do contrato</b>	CNY350.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por CNY10.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por CNY 10.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses
<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por CNY10.000,00 iuans chineses, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários

<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de Iuan Chinês (CNY) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil.

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação, com movimentação financeira no dia de sessão de negociação subsequente. O ajuste diário, para cada mês de vencimento, será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

### a) Ajuste da operação realizada no dia

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 35 \times n$$

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 35 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

PO = preço da operação;

n = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente, mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) à das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = \left( \frac{Tx C_{T-1}}{TP_{T-1}} \right) \times 350.000 \times n$$

Onde:

VL = valor de liquidação, em reais;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TP_{t-1}$  = taxa de câmbio de CNY por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

n = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de CNY por USD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de CNY por USD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de CNY por USD para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXXI do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR EURO

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por euro (EUR), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	EUR
<b>Tamanho do contrato</b>	EUR50.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por EUR 1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por EUR1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por EUR1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de dólares dos Estados Unidos da América (USD) por euro (EUR), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação, com movimentação financeira na sessão de negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.



**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 50 \times N$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 50 \times N$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = conforme o caso, preço de ajuste na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$N$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente, mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TP_{T-1} \times TxC_{T-1} \times 50.000 \times n$$

Onde:

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TP_{T-1}$  = taxa de câmbio de USD por EUR na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{T-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$n$  = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de USD por EUR e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de USD por EUR serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de USD por EUR para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXXII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR LIBRA ESTERLINA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por libras esterlinas (GBP), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	GBP
<b>Tamanho do contrato</b>	GBP35.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por GBP1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por GBP 1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por GBP1.000,00 libras esterlinas, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de dólares dos Estados Unidos da América (USD) por Libra Esterlina (GBP), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação, com movimentação financeira no dia de sessão de negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 35 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 35 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

PO = preço da operação;

n = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente, mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = (TP_{t-1} \times TxC_{t-1}) \times 35.000 \times n$$

058/2024-PRE

Onde:

VL = valor de liquidação, em reais;

TPt-1 = taxa de câmbio de USD por GBP na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

TxCt-1 = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

n = número de contratos.

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

## 5. Condições especiais

### a) Feriado Extraordinário

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de USD por GBP e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de USD

por GBP serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de USD por GBP para a liquidação serão mantidas.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.





## Anexo XXXIII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR IENE

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por ienes japoneses (JPY), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	JPY
<b>Tamanho do contrato</b>	JPY5.000.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por JPY100.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por JPY100.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por 100.000,00 ienes japoneses (JPY), com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de Iene japonês (JPY) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação, com movimentação financeira no Dia de Sessão de Negociação subsequente. O ajuste diário, para cada mês de vencimento, será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 50 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 50 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente, mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) à das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = \left( \frac{TxC_{T-1}}{TP_{T-1}} \right) \times 5.000.000 \times n$$

Onde:

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TP_{t-1}$  = taxa de câmbio de JPY por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$n$  = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3. Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de JPY por USD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de JPY por USD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de JPY por USD para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXXIV do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR PESO MEXICANO

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por peso mexicano (MXN), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	MXN
<b>Tamanho do contrato</b>	MXN750.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por MXN10.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por MXN10.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo.
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por 10.000,00 pesos mexicanos (MXN), com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de pesos mexicanos (MXN) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação com movimentação financeira na sessão de negociação subsequente. O ajuste diário, para cada mês de vencimento, será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 75 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 75 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente, mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = \left( \frac{Tx C_{T-1}}{TP_{T-1}} \right) \times 750.000 \times N$$



058/2024-PRE

Onde:

VL = valor de liquidação, em reais;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TP_{t-1}$  = taxa de câmbio de MXN por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

n = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de MXN por USD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de MXN

058/2024-PRE

por USD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de MXN por USD para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



**Anexo XXXV do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE**  
**CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR DÓLAR DA NOVA**  
**ZELÂNDIA**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por dólares da Nova Zelândia (NZD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	NZD
<b>Tamanho do contrato</b>	NZD75.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por NZD1.000,00, com uma casa decimal
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por NZD1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por 1.000,00 dólares da Nova Zelândia (NZD), com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de dólares dos Estados Unidos da América (USD) por dólar da Nova Zelândia (NZD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil.

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação, com movimentação financeira na sessão de negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

### a) Ajuste da operação realizada no dia

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 75 \times n$$

### b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 75 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

PO = preço da operação;

n = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

## 3. Condições de liquidação no vencimento

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = (TP_{t-1} \times TxC_{t-1}) \times 75.000 \times n$$

Onde:

VL = valor de liquidação, em reais;

TP<sub>t-1</sub> = taxa de câmbio de USD por NZD do na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

TxC<sub>t-1</sub> = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

n = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de USD por NZD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da

taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de USD por NZD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de USD por NZD para a liquidação serão mantidas.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXXVI do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR LIRA TURCA

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por lira turca (TRY), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	TRY
<b>Tamanho do contrato</b>	TRY75.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por TRY1.000,00, com uma casa decimal
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por TRY1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses



<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por 1.000,00 libras turcas (TRY), com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de lira turca (TRY) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação com movimentação financeira na sessão de negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 75 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 75 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;  $n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = \left( \frac{Tx C_{T-1}}{TP_{T-1}} \right) \times 75.000 \times n$$

Onde:

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$Tx C_{t-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TP_{t-1}$  = taxa de câmbio de TRY por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$n$  = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de TRY por USD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de TRY por USD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de TRY por USD para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXXVII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO MÍNIMO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR EURO

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por euro (EUR), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	WEU
<b>Tamanho do contrato</b>	EUR10.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por EUR1.000,00, com uma casa decimal
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por EUR1.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo.
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por EUR1.000,00, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de dólares dos Estados Unidos da América (USD) por euro (EUR), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação, com movimentação financeira na sessão de negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 10 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 10 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;  $n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = TP_{T-1} \times TxC_{T-1} \times 10.000 \times n$$

Onde:

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TP_{t-1}$  = taxa de câmbio de USD por EUR na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$n$  = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de USD por EUR e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de USD por EUR serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de USD por EUR para a liquidação serão mantidas.



**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



## Anexo XXXVIII do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE

### CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR RANDE DA ÁFRICA DO SUL

#### 1. Informações do contrato

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado de taxa de câmbio de reais (BRL) por rande da África do Sul (ZAR), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	ZAR
<b>Tamanho do contrato</b>	ZAR350.000,00
<b>Cotação</b>	Valor expresso em reais (BRL) por ZAR10.000,00, com uma casa decimal
<b>Variação mínima de apregoação (tick size)</b>	BRL0,1 por ZAR10.000,00
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia de Sessão de Negociação do mês de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Data de fixing</b>	Último Dia Útil do mês imediatamente anterior ao mês de vencimento do contrato, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as Condições especiais previstas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por 10.000,00 randes da África do Sul (ZAR), com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de rande da África do Sul (ZAR) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSPOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880, de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação serão ajustadas com base no preço de ajuste (PA) do respectivo Dia de Sessão de Negociação com movimentação financeira na sessão de negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

---

<sup>1</sup> A cotação WM/Reuters Closing Spot Rate é fornecida pela WM em conjunto com a Reuters. A WM não é responsável por erros ou atrasos no fornecimento ou disponibilização dos dados contidos nesse serviço ou por quaisquer decisões tomadas com base nele, salvo se causados diretamente por negligência da WM ou de seus empregados.

**a) Ajuste da operação realizada no dia**

$$AD_t = (PA_t - PO) \times 35 \times n$$

**b) Ajuste das posições em aberto no dia anterior**

$$AD_t = (PA_t - PA_{t-1}) \times 35 \times n$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t", para o respectivo vencimento;

$PO$  = preço da operação;

$n$  = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o respectivo vencimento.

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente mediante o registro de operações de natureza inversa (compra ou venda) às das posições em aberto, na mesma quantidade de contratos, pelo valor de liquidação (VL), apurado de acordo com a seguinte fórmula:

$$VL = \left( \frac{TxC_{T-1}}{TP_{T-1}} \right) \times 350.000 \times n$$

Onde:

$VL$  = valor de liquidação, em reais;

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$TP_{t-1}$  = taxa de câmbio de ZAR por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;

$n$  = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o dia de feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso sobrevenha um Feriado Extraordinário durante a vigência do contrato, o cálculo do ajuste diário será interrompido durante seu respectivo período e retomado na sessão de negociação subsequente ao encerramento do Feriado Extraordinário.

Quando a data de divulgação da variável utilizada para o cálculo do valor de liquidação do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da taxa de câmbio de reais (BRL) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), a data de captura da referida taxa será mantida, assim como a data de captura da taxa de câmbio de ZAR por USD e a data de vencimento, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da referida taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da taxa de câmbio de reais (BRL) por USD e a data de captura da taxa de câmbio de ZAR por USD serão postergadas para primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento, por sua vez, será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente ao dia da captura das taxas de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de vencimento do contrato será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário. A data de captura da taxa de câmbio de BRL por USD e da taxa de câmbio de ZAR por USD para a liquidação serão mantidas.

**b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

**5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

**6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



**Anexo XXXIX do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE**

**CONTRATO FUTURO DE CUPOM CAMBIAL DE DEPÓSITOS  
INTERFINANCEIROS DE UM DIA (DDI)**

**1. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	Futuro padronizado da taxa de juros obtida a partir do cálculo da diferença entre a acumulação da Taxa DI divulgada pela B3 e a variação da taxa de câmbio de dólar dos Estados Unidos da América (USD), negociado em mercado de bolsa da B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3)
<b>Código de negociação</b>	DDI
<b>Tamanho do contrato</b>	Preço unitário (PU), multiplicado pelo valor do ponto, expresso em dólares dos Estados Unidos da América
<b>Cotação</b>	Taxa de juros, expressa em percentual ao ano, linear, base 360 dias corridos, com até três casas decimais
<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	0,001%
<b>Data de vencimento</b>	Primeira sessão de negociação do mês de vencimento do contrato, observadas as condições especiais dispostas na cláusula 4 do contrato
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação (conforme abaixo definido) imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as condições especiais dispostas na cláusula 4 do contrato
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses
<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em PU, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários

058/2024-PRE

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880 de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

## 2. Ajuste diário

As posições em aberto ao final de cada sessão de negociação, depois de transformadas em PU, serão ajustadas com base no preço de ajuste do dia, determinado segundo regras estabelecidas pela B3, com movimentação financeira no Dia de Sessão de Negociação subsequente. O ajuste diário será calculado até a data de vencimento, inclusive, de acordo com as seguintes fórmulas:

### a) Ajuste diário realizado no dia da contratação da operação

$$AD_t = (PA_t - PO) \times M \times TxC_{t-1} \times N$$

### b) Ajuste diário das posições em aberto no dia anterior

$$AD_t = [PA_t - (PA_{t-1} \times FC_t)] \times M \times TxC_{t-1} \times N$$

Onde:

$AD_t$  = valor do ajuste diário, em reais, referente à data "t";

$PA_t$  = preço de ajuste do contrato na data "t" para o vencimento respectivo;

$PO$  = preço (PU) da operação, com duas casas decimais, obtido como segue:

$$PO = \frac{100.000}{\left(i \times \frac{n}{360}\right) + 1}$$

Onde:

$i$  = taxa de juros negociada, expressa em percentual;

$n$  = número de dias corridos compreendido no período entre a data da operação, inclusive, e a data de vencimento, exclusive;

$M$  = valor em dólar de cada ponto de PU, estabelecido pela B3;



058/2024-PRE

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais por dólar dos Estados Unidos da América PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil, verificada na data "t-1", ou seja, no Dia Útil anterior à data a que o ajuste se refere;

N = número de contratos;

$PA_{t-1}$  = preço de ajuste do contrato na data "t-1" para o vencimento respectivo.

$FC_t$  = fator de correção na data "t", definido pela seguinte fórmula:

$$FC_t = \prod_{j=1}^m \frac{(1 + DI_{t-j})^{\frac{1}{252}}}{\left(\frac{TxC_{t-j}}{TxC_{t-j-1}}\right)}$$

Onde:

$DI_{t-j}$  = Taxa DI referente ao j-ésimo Dia Útil anterior à data "t", com até seis casas decimais, expressa em percentual;

m = número de Dias Úteis entre a data "t" e o Dia de Sessão de Negociação anterior à data "t";

$TxC_{t-j}$  = taxa de câmbio de reais por dólar dos Estados Unidos da América PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil verificada no j-ésimo Dia Útil anterior à data "t";

$TxC_{t-j-1}$  = taxa de câmbio de reais por dólar dos Estados Unidos da América PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil verificada no j-ésimo Dia Útil anterior à data "t-1".

Na data de vencimento do contrato, o preço de ajuste será de 100.000 pontos. Se, em determinado dia, a Taxa DI divulgada pela B3, se referir a um período (número de dias) distinto daquele considerado na correção do preço de ajuste, a B3 poderá arbitrar uma taxa, a seu critério, para aquele dia específico.

O valor do ajuste diário ( $AD_t$ ), calculado conforme demonstrado acima, se positivo, será creditado ao comprador da posição em PU (vendedor original em taxa) e debitado ao vendedor da posição em PU (comprador original em taxa).

058/2024-PRE

Caso o valor do cálculo acima seja negativo, será debitado ao comprador da posição em PU e creditado ao vendedor da posição em PU. A liquidação financeira será realizada no Dia de Sessão de Negociação subsequente à data de apuração do valor do ajuste diário.

### **3. Condições de liquidação no vencimento**

Na data de vencimento, as posições em aberto, após o último ajuste, serão liquidadas financeiramente pela B3, mediante o registro de operação de natureza inversa (compra ou venda) à da posição, na mesma quantidade de contratos, pela cotação (PU) de 100.000 pontos. Os resultados financeiros da liquidação serão movimentados no Dia de Sessão de Negociação subsequente à data de vencimento.

### **4. Condições especiais**

#### **a) Feriados Extraordinários**

Considera-se Feriado Extraordinário o feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso o(s) dia(s) de Feriado Extraordinário corresponda(m) a dia(s) anteriormente considerados Dia(s) útil(eis) e sua ocorrência se dê durante a vigência do contrato, se houver divulgação da Taxa DI e da PTAX, o PU será corrigido normalmente conforme descrito na cláusula 2 do contrato. Caso não haja divulgação da Taxa DI ou da PTAX, o PU não será corrigido.

Quando a data de divulgação da PTAX utilizada para o valor de liquidação na data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da referida taxa, a data de vencimento será mantida, conforme descrito na cláusula 1 do contrato. Caso não haja divulgação da taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data de captura da PTAX de liquidação será postergada para o primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente à data de captura da PTAX de liquidação.

058/2024-PRE

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de captura da PTAX de liquidação será mantida e a data de vencimento será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

Em qualquer caso, na data de vencimento, o preço de ajuste permanecerá 100.000 pontos, conforme descrito na cláusula 2 do contrato, e o  $PA_{t-1}$  será corrigido apenas com as Taxas DI e PTAX divulgadas até o Dia Útil anterior à data original do vencimento, não sendo consideradas para fins de cálculo as Taxas DI e PTAX divulgadas a partir da data original do vencimento, inclusive.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **5. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **6. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.



**Anexo XL do OFÍCIO CIRCULAR 058/2024-PRE**  
**CONTRATO DE SWAP CAMBIAL COM AJUSTE PERIÓDICO BASEADO EM**  
**OPERAÇÕES COMPROMISSADAS DE UM DIA (SCS)**

## **1. Definições**

**Posição atualizada do dia:** saldo líquido atualizado de todos os contratos negociados, para a mesma série, pelo mesmo cliente, por intermédio do mesmo participante e compensados pelo mesmo membro de compensação.

**Ponta valor final:** saldo líquido dos valores finais de todos os contratos negociados para a mesma série.

**Ponta cupom:** saldo líquido dos valores cupom atuais de todos os contratos negociados para a mesma série.

**Série(s):** data(s) de vencimento estabelecida(s) pela B3 para liquidação final de posição(ões).

**2. Informações do contrato**

<b>Objeto</b>	O diferencial entre a taxa de juro efetiva e a variação cambial, definidas para esse efeito como: a) taxa de juro efetiva dos financiamentos diários apurados no Sistema Especial de Liquidação e de Custódia para títulos federais (Taxa Selic), definida para esse efeito pela acumulação das taxas médias diárias para o período compreendido entre a data da operação, inclusive, e a data de vencimento, exclusive b) variação cambial, medida pela taxa de câmbio de reais por dólar dos Estados Unidos da América PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil, verificada entre o dia útil anterior à data da operação, inclusive, e a data de vencimento, exclusive
<b>Código de negociação</b>	SCS
<b>Valor final</b>	US\$ 50.000,00 (cinquenta mil dólares dos Estados Unidos da América)
<b>Cotação</b>	Taxa de juros, denominada cupom cambial, representativa da diferença entre as taxas definidas no item "Objeto" e expressa em taxa linear anual, base 360 dias corridos, com até três casas decimais nos negócios diretos e no registro primário do contrato, e com até três casas decimais, nas apregoações

<b>Varição mínima de apregoação (tick size)</b>	0,001 ponto de taxa
<b>Data de vencimento</b>	Primeiro Dia Útil do mês de vencimento do contrato. Cada data autorizada caracterizará uma série
<b>Último dia de negociação</b>	Dia de Sessão de Negociação imediatamente anterior à data de vencimento, observadas as condições especiais dispostas na cláusula 4, abaixo
<b>Meses de vencimento</b>	Todos os meses

Para fins deste contrato, considera-se (i) "Dia Útil" o dia para fins de operações praticadas no mercado financeiro nacional, de acordo com o significado atribuído na Resolução 4.880 de 23 de dezembro de 2020, do Conselho Monetário Nacional, conforme alterada de tempos em tempos; e (ii) "Dia de Sessão de Negociação", quaisquer dos dias em que houver sessão de negociação na B3, conforme calendário divulgado pela B3.

### 3. Cálculo do Valor Inicial de um contrato negociado

A apuração do Valor Inicial de cada contrato será realizada de acordo com a seguinte fórmula:

$$VI = \left[ \frac{VF}{\left( \frac{i_0}{360 \times 100} \times n \right) + 1} \right]$$

Onde:

VI= Valor Inicial por contrato;

VF= valor final do contrato;

$i_0$ = taxa de cupom cambial da operação, negociada entre as partes, conforme definida na cláusula 2 do contrato;

$n$ = número de dias corridos, compreendido entre a data da operação, inclusive, e a data de vencimento do contrato, exclusive.

#### 4. Atualização diária da posição

Todos os negócios realizados no mesmo pregão, considerando-se os negócios do mesmo cliente, por intermédio do mesmo participante e sob a responsabilidade do mesmo membro de compensação, para a mesma série, serão consolidados, o mesmo ocorrendo com os Valores Iniciais, gerando-se assim a PLD (Posição Líquida dos Negócios do Dia), para a série respectiva.

A Posição do Dia Anterior Atualizada para o Dia (PDAA<sub>t</sub>), será definida conforme a fórmula abaixo:

$$(PDAA_t) = PDA_{t-1} \times \left( \frac{FC_t}{\frac{TxC_{t-1}}{TxC_{t-2}}} \right)$$

Onde:

PDAA<sub>t</sub> = posição do dia anterior atualizada para o dia

PDA<sub>t-1</sub> = posição atualizada do dia anterior

FC<sub>t</sub> = fator de correção do dia "t", definido pela seguinte fórmula:

$$FC_t = \prod_{j=1}^m \left( 1 + \frac{SELIC_{t-j}}{100} \right)^{1/252}$$

Onde:

SELIC<sub>t-j</sub> = Taxa Selic, referente ao j-ésimo dia útil anterior ao dia "t", com até seis casas decimais;

m = número de saques-reserva entre o dia "t" e a data do pregão anterior;

TxC<sub>t-1</sub> = taxa de câmbio de reais por dólar dos Estados Unidos da América, definida na cláusula 2 do contrato e observada na data "t-1";

TxC<sub>t-2</sub> = taxa de câmbio de reais por dólar dos Estados Unidos da América, definida na cláusula 2 do contrato e observada na data "t-2".

As Posições Líquidas dos Negócios do Dia e do Dia Anterior Atualizadas para o Dia (PLD e PDAA) serão consolidadas mediante a compensação das respectivas pontas valor final e cupom. Esse procedimento gerará a Posição Atualizada do Dia, conforme a cláusula 1 do contrato, e será repetido até a data de vencimento da série.

Se, em determinado dia, a taxa divulgada pelo Bacen referir-se a um período (número de dias) distinto daquele a ser considerado na correção da ponta cupom, a B3 poderá arbitrar uma taxa, a seu critério, para aquele dia específico.

## 5. Ajuste diário

As posições de cada cliente (Posição Atualizada do Dia) serão ajustadas diariamente com base na Taxa Referencial B3 Selic x dólar (criada especificamente para o ajuste das posições), ajustada para o prazo a decorrer da série. Os valores relativos ao ajuste diário deverão ser liquidados financeiramente no dia útil subsequente ao dia do ajuste, sendo apurados de acordo com a seguinte fórmula:

$$AP_t = \left[ CC_t - \frac{VF}{\left( \frac{i_s}{360 \times 100} \times n \right) + 1} \right] \times TxC_{t-1} \times \left( \frac{i_a}{100} + 1 \right)$$

Onde:

$AP_t$  = valor do ajuste da posição, referente ao dia "t";

$CC_t$  = valor da ponta Cupom da Posição Atualizada do Dia (Posição Líquida dos Negócios do Dia consolidada com a Posição do Dia Anterior Atualizada para o Dia), referente à série respectiva;

VF = valor da ponta valor final;

$i_s$  = Taxa Referencial B3 para operações Selic x dólar, criada pela B3 especificamente para o ajustamento das posições, expressa na forma linear em bases anuais para 360 dias corridos e relativa ao dia do ajuste, para o prazo a decorrer da posição;

n = prazo para o vencimento da posição, em dias corridos, contados a partir do dia de cálculo do ajuste, inclusive, até a data de vencimento, exclusive;



058/2024-PRE

$TxC_{t-1}$  = taxa de câmbio de reais por dólar dos Estados Unidos da América, definida na cláusula 2 do contrato;

$i_a$  = Taxa Selic relativa ao dia do ajuste

O valor do ajuste diário apurado acima, se positivo, será creditado ao comprador, e debitado ao vendedor. Ocorrendo o contrário, o valor do ajuste diário será creditado ao vendedor e debitado ao comprador. Após o cálculo do ajuste, o valor da ponta cupom da posição passará a ser o valor da ponta valor final descontado conforme a fórmula abaixo:

$$CC_a = \frac{VF}{\left(\frac{i_s}{360 \times 100} \times n\right) + 1}$$

Onde:

$CC_a$  = valor da ponta cupom após o cálculo do ajuste diário;

$VF, i_s$  e  $n$  = conforme definidos acima

No caso de os valores das pontas cupom e valor final, após o procedimento para o cálculo do ajuste diário, tornarem-se iguais a zero, a posição será automaticamente encerrada, e a B3 emitirá documento comprobatório desse encerramento.

## 6. Condições de liquidação no vencimento

Na data de vencimento, após a última atualização da posição, esta deverá ser liquidada financeiramente, junto à B3, pelo cliente por intermédio do participante e do membro de compensação. O valor de liquidação da posição será a diferença entre o valor da ponta cupom e o valor da ponta valor final, multiplicada pela taxa de câmbio definida na **alínea b)** do Objeto descrito na cláusula 2 do contrato e relativa ao dia anterior. Se o valor da ponta cupom for superior ao valor da ponta valor final, o valor de liquidação será creditado ao comprador, e debitado ao vendedor. Ocorrendo o contrário, o valor de liquidação será creditado ao vendedor e debitado ao comprador. Os resultados financeiros da liquidação serão movimentados no Dia da Sessão de Negociação subsequente à data de vencimento.

## **7. Registro primário de contratos**

A B3 poderá autorizar o registro especial de posições neste contrato, provenientes de leilões realizados pelo Banco Central do Brasil. As condições desse registro serão estabelecidas pela B3 por meio de Ofício Circular. As posições criadas sob tais condições poderão ser livremente negociadas, de acordo com estas especificações, a partir do dia autorizado pela B3.

## **8. Critérios de arredondamento**

Todos os cálculos relativos à apuração do Valor Inicial de um contrato, da Posição Líquida dos Negócios do Dia, da Posição Atualizada do Dia Anterior e da Posição Atualizada do Dia serão realizados e mantidos com até sete casas decimais. Os valores demonstrados diariamente para as posições, bem como os valores a serem liquidados, serão arredondados, pelo critério universal, para duas casas decimais.

## **9. Condições especiais**

### **a) Feriado Extraordinário**

Considera-se Feriado Extraordinário o feriado não previsto no calendário nacional, estadual, municipal ou local e não refletido no calendário divulgado pela B3, instituído por autoridade competente, e sem possibilidade de haver sessão de negociação na B3.

Caso o(s) dia(s) de Feriado Extraordinário corresponda(m) a dia(s) anteriormente considerados Dia(s) útil(eis) e sua ocorrência se dê durante a vigência do contrato, se houver divulgação da Taxa Selic e PTAX, as posições serão corrigidas normalmente conforme descrito na cláusula 4 do contrato. Caso não haja divulgação da Taxa Selic, as posições não serão corrigidas.

Quando a data de divulgação da PTAX utilizada para o valor de liquidação na data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário e se, ainda assim, houver divulgação da referida taxa, a data de vencimento será mantida, conforme descrito na cláusula 2 do contrato. Caso não haja divulgação da taxa, ocorrerá o seguinte: (i) a data

058/2024-PRE

de captura da PTAX de liquidação será postergada para o primeiro Dia Útil subsequente ao Feriado Extraordinário; e (ii) a data de vencimento será postergada para o Dia de Sessão de Negociação subsequente à data de captura da PTAX de liquidação.

Quando a data de vencimento do contrato for um Feriado Extraordinário, a data de captura da PTAX de liquidação será mantida e a data de vencimento será postergada para o primeiro Dia de Sessão de Negociação subsequente ao Feriado Extraordinário.

Em qualquer caso, na data de vencimento, o valor final conforme descrito na cláusula 2 do contrato, e a  $PDA_{t-1}$  será corrigida apenas com as Taxas Selic e PTAX divulgadas até o Dia Útil anterior à data original do vencimento, não sendo consideradas para fins de cálculo as Taxas Selic e PTAX divulgadas a partir da data original do vencimento, inclusive.

#### **b) Outras situações não previstas**

Na hipótese de situações não previstas neste instrumento, inclusive, sem limitação, aquelas decorrentes de atos emanados de entes governamentais, autoridades reguladoras ou órgãos competentes, ou de quaisquer outros fatos, que impactem, direta ou indiretamente, a formação, a maneira de apuração, a representatividade, a divulgação, a disponibilidade ou a continuidade do ativo-objeto ou de quaisquer das variáveis deste contrato, a B3 tomará as medidas que julgar necessárias, a seu exclusivo critério, visando a liquidação, a continuidade ou a prorrogação do contrato em bases equivalentes.

### **10. Lei de regência**

Este instrumento é regido e interpretado de acordo com as leis em vigor na República Federativa do Brasil.

### **11. Aplicação de normas e regulamentos da B3**

Aplicam-se a este instrumento todas as normas, regulamentos, regras e procedimentos divulgados pela B3.