

The background of the cover is a photograph of a blue pen resting on a sheet of graph paper. The paper has several rectangular boxes drawn on it, some containing handwritten mathematical formulas. The overall color scheme is a monochromatic blue.

# Caderno de Fórmulas

Termo CCP

Elaboração: Agosto/2018  
Última Atualização: 25/05/2023

[B]<sup>3</sup>

**O** Caderno de Fórmulas tem por objetivo orientar os usuários do Termo de Moedas com CCP, na compreensão da metodologia de cálculo e dos critérios de precisão usados na atualização dos contratos, de suas funcionalidades e de sua liquidação financeira.

**A**s fórmulas contidas neste Caderno aplicam-se aos contratos de Termo de Moedas com CCP.

**C**onstam também neste caderno de fórmulas, as fontes de informações utilizadas na atualização dos Contratos a Termo de Moedas com CCP.

---

**Contratos a Termo de Moedas com CCP**

<b>Contratos a Termo de Moedas com CCP</b> .....	4
Termo .....	5
Cálculo do resultado financeiro no vencimento.....	5
Cálculo de Antecipação .....	7

# **Contratos a Termo de Moedas com CCP**

---

## Termo

O “Termo Simples” é a expressão utilizada para definir um “Termo de Paridade” onde a “Moeda Base” é uma moeda estrangeira e a “Moeda Cotada” é sempre o Real.

### Definições:

Moeda Base: Moeda objeto do Termo

Moeda Cotada: Moeda de referência em que a Moeda Base é cotada, nos Termos com CCP a moeda é sempre o Real.

Por exemplo: Cotação do Euro em Reais – Euro é a Moeda Base e Real é a Moeda Cotada.

Para consultar a relação de moedas disponíveis, tanto como Moeda Base como quanto Moeda Cotada, consultar arquivo “AAAAMMDD\_Indexadores\_CCP.txt”, disponível no módulo Transf. de Arquivos, em Arquivos Públicos.

## Cálculo do resultado financeiro no vencimento

Valor calculado pela diferença financeira entre o valor da “Paridade no Vencimento” e a “Paridade a Termo” contratada, expresso na moeda cotada.

### Liquidação – Comprador

$$Li_{Moeda\ Cotada} = Valor\ Base \times (Paridade\ Vcto - Paridade\ Termo)$$

### Liquidação – Vendedor

$$Li_{Moeda\ Cotada} = Valor\ Base \times (Paridade\ Termo - Paridade\ Vcto)$$

### **Onde:**

$Li_{Moeda\ Cotada}$ : Valor de liquidação na Moeda Cotada, expresso com 2 (duas) casas decimais com arredondamento.

Valor Base: Valor expresso na moeda base informado com 2 (duas) casas decimais. É utilizado o Valor Base remanescente das antecipações, se houver.

Paridade Termo: Cotação da paridade entre a Moeda Base e Moeda Cotada (Moeda Cotada/Moeda Base) contratada no registro do termo, informada com uma precisão máxima de:

---

**Contratos a Termo de Moedas com CCP**

- 6 (seis) casas decimais para o DOLAR DOS EUA
- 8 (oito) casas decimais para o EURO
- 8 (oito) casas decimais para o IENE

LiqReais: Valor Financeiro em Reais, calculado com 2 (duas) casas decimais com arredondamento.

**Obs:** Para o Termo com CCP, a Liquidação na Moeda Cotada já se encontra em Reais, portanto não há a necessidade de transformar a liquidação para Reais.

## Cálculo de Antecipação

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

Este valor deve ser calculado pelo participante e informado no campo “**Valor Financeiro a Antecipar (BRL)**” constante na tela:

CCP > Contrato de Termo > Lançamentos > Antecipação de Contrato



CCP > Contratos Termo > Lançamentos > Antecipação de Contrato

**Antecipação de Contrato**

Código do Contrato: 16J00001152	Meu número: <input type="text"/>
Conta Registradora-Comprador: 02229.00-9	Valor para Antecipação: <input type="text"/>
Conta-Comprador: 02229.20-3	Percentual para Antecipação: <input type="text"/>
Código do PR-Comprador: 90300	Valor Financeiro a Antecipar (BRL): <input type="text"/> , <input type="text"/>
Conta SINCAD- Comprador: 104	Visão Comprador: <input type="text"/>
Conta Registradora-Vendedor: 34170.00-5	Taxa Operacional: <input type="text"/>
Conta -Vendedor	Valor: <input type="text"/> , <input type="text"/>
Código do PR-Vendedor	
Conta SINCAD- Vendedor	
Valor Base Remanescente: 1.000,00	
Data de Antecipação: 29/09/2017	