

MANUAL DE OPERAÇÕES

SWAP SEM CCP

Selecione o tipo de SWAP desejado

CALCULADO

NÃO CALCULADO - VCP

ESTRATÉGIA

SUMÁRIO

REGISTRO DE CONTRATOS

1	Registro – Contrato Pagamento Final	4
2	Registro – Contrato Fluxo Constante.....	22
3	Registro – Fluxo Não Constante.....	25
4	Registro – Curva Não Calculada (Vcp).....	33
5	Informações Necessárias – Curvas Não Calculadas	37
6	Registro – Estratégia	60
7	Atualização De Pu/Fator	62
8	Registro – Taxas De Juros Do Mercado Internacional	68

FUNCIONALIDADES

9	Registro – Fluxo De Datas De Verificação	71
10	Registro – Pagamento De Prêmio	73
11	Registro – Parâmetros Para Disparo De Reset	75
12	Registro De Reset	80
13	Registro – Registro De Curvas Marcadas A Mercado.....	84
14	Registro – Fluxo De Datas De Verificação	86
15	Antecipação.....	89
16	Cessão	93
17	Alteração – Pagamento Final	98
18	Alteração – Fluxo Constante.....	109
19	Alteração – Fluxo Constante.....	113
15	Alteração – Fluxo Constante.....	116
16	Alteração De Fluxo De Data De Verificação.....	120
17	Alteração De Pagamento De Prêmio	123
18	Cancelamento De Contrato	127

19	Exercício Da Opção	129
20	Intermediação.....	132
21	Consulta Característica Do Contrato	134
22	Consulta - Agenda De Eventos	137
23	Consulta – Fluxo Não Constante	140
24	Consulta – Histórico De Parâmetros Para Disparo No Reset	141
25	Consulta – Histórico De Curvas Marcadas A Mercado.....	142
26	Consulta – Histórico De Reset	143
27	Consulta – Resumo De Contratos	144
28	Consulta – Contratos Opção Com Arrependimento	145
29	Consulta – Contratos De Swaption/ Compound.....	146
30	Consulta – Histórico De Alteração De Contrato.....	147
31	Informações Adicionais.....	149
32	Atualização Da Versão.....	169

1 REGISTRO – CONTRATO PAGAMENTO FINAL

Esta função permite efetuar o registro dos contratos de Pagamento Final:

FORMAS DE LANÇAMENTO	FUNCIONALIDADES
<p>Tela: Menu Swap > Lançamentos > Registro de Contrato – Fluxo Constante</p> <p>Arquivo: 4.2.1.Registro de Contrato com Pagamento Final 4.2.2. Registro de Contrato com Pagamento Final Versão 00002</p> <p>Mensageria: CTP9001 – SWAP – Registro de Contrato Pagamento Final</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Barreiras (Knock In, Knock Out Knock In/Out) • Swaption • Compound • Opção de Arrependimento • Swap com Prêmio • Knock In com Opção • Knock Out com Opção • Limitadores
<p>PRAZO: Conta 00 x Conta 00 – O registro deve ser realizado em D0 da contratação Conta 00 x Conta 10 ou 20 – É permitido o registro em até D+2 da contratação do derivativo</p>	

Tela de Registro

Registro de Contrato - Pagamento Final			
Parte	Contraparte	CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
Meu Número			
	Comissão Parte		Comissão Contraparte
Características			
Data Início	Data Vencimento	Valor Base	
Funcionalidades	Adesão a Contrato	Agenda de Prêmio	Reset
Observação	Amortiza sem troca de diferencial	Código Identificador	Código Estratégia
Exclusivo para Contrato à Termo			
Data Operação	Índice Termo	Perc. Termo	
Se Índice Termo			
PU Inicial/Cupom Limpo	Data de Cotação Final - Termo	Tipo/Classe	Denominação
Curvas para Atualização			
Parte	Contraparte		
Percentual	Percentual	Curva	Curva
TR Escolhida	TR Escolhida	Juros(% aa)	Juros(% aa)
Lim. Inferior (Floor)	Lim. Inferior (Floor)	Lim. Superior (Cap)	Lim. Superior (Cap)
Torceta Curva			
Parte/Contraparte	Cupom Limpo	Percentual	Curva
		Juros(% aa)	Limitador
Se Curva(s) – "VCP":			
Parte	Contraparte		
PU	PU	Tipo/Classe	Tipo/Classe
Denominação	Denominação		
Cupom Limpo/Data Cotação			
Parte	Contraparte		
Cupom Limpo	Cupom Limpo	Data de Cotação	Data de Cotação
Exclusivo para curva "Libor"			
Parte	Contraparte		
Data de Cotação - Libor	Varição Cambial	Data de Cotação - Libor	Varição Cambial
Tipo Classe	Data da Cotação - Varição Cambial	Tipo Classe	Data da Cotação - Varição Cambial
Cupom Limpo / Outros - Cotação	Aliquota IR	Cupom Limpo / Outros - Cotação	Aliquota IR
Limite Inferior (Floor) - Perc.	Limite Superior (Cap) - Perc.	Limite Inferior (Floor) - Perc.	Limite Superior (Cap) - Perc.

Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato - Pagamento Final

Registro de Contrato - Pagamento Final			
Parte <input type="text"/>	Contraparte <input type="text"/>	CPF/CNPJ Cliente Parte <input type="text"/>	CPF/CNPJ Cliente Contraparte <input type="text"/>
Meu Número <input type="text"/>		Comissão Parte <input type="text"/>	Comissão Contraparte <input type="text"/>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte	Código da conta do Participante para quem está sendo lançado o contrato.	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
Contraparte	Código da conta da outra parte envolvida no contrato	Obrigatório	Tipo: Numérico (Campos com 5, 2 e 1 inteiros)
CPF/CNPJ Cliente Participante		Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	-	Condicional	Preenchimento obrigatório quando envolver clientes. O CPF/CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Não é permitida a realização de negócios entre pontas com mesmo CPF/CNPJ para Parte e Contraparte. Tipo: Numérico (Se for CPF são 11 inteiros, se for CNPJ são 14 inteiros)
Meu Número	Número de identificação do lançamento indicado pelo participante ou contraparte. Proporciona o controle interno dos seus próprios lançamentos. Não é necessário que o número de controle interno seja o mesmo da contraparte, pois o sistema confronta outros dados para que a operação seja efetuada.	Obrigatório	Tipo: Numérico (até 10 inteiros)

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Comissão Parte	Valor percentual que será aplicado sobre o Valor Base inicial da operação, sob a forma de comissão a ser paga a Parte.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Tipo: Numérico (até 2 inteiros e 8 decimais).
Comissão Contraparte	Valor percentual que será aplicado sobre o Valor Base inicial da operação, sob a forma de comissão a ser paga a Parte.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Tipo: Numérico (até 2 inteiros e 8 decimais).

Características

Data Início

Valor Base

Observação

Data Vencimento

Agenda de Prêmio

Amortiza sem troca de diferencial

Adesão a Contrato

Código Estratégia

Código Identificador

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data de Início	Data em que o participante contratou a operação. Data de início do contrato.	Obrigatório	Pode ser informada em até D-2 útil anterior à data do sistema, quando a contraparte na operação é de um conta de seus clientes (tipo de conta 1). Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato.	Obrigatório	A data de vencimento do contrato pode ser indicada em feriados, porém não pode ser indicado um final de semana. Caso o ajuste caia em dia não útil, o sistema irá gerar o ajuste para o próximo dia útil conhecido. O período máximo é de 9.999 dias úteis a partir da data informada em “Data Início”. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Adesão ao Contrato	Indica se o contrato registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos	Obrigatório	Obrigatório, quando disponível essa opção Tipo: Domínio (CGD; CGD/CSA; CSA; SEM ADESÃO)

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Valor Base	Valor base ou quantidade do contrato expresso na moeda de referência.	Opcional	Tipo: Numérico (limite de 14 inteiros e 2 decimais). Quando casas decimais não preenchidas, o sistema preenche com zeros
Agenda de Prêmio	Indica se no contrato que está sendo registrado existirá um fluxo de pagamento de prêmio.	Obrigatório	Tipo: Domínio (SIM e NÃO).
Código Estratégia	Campo de preenchimento obrigatório para registro de uma estrutura VCP-Estratégia. IMPORTANTE: o código da estratégia deve estar habilitado para a conta do Participante.	Condicional	Informar o código da estratégia previamente habilitado: Ex.: (SWP00XXXXXX)
Observação		Opcional	Tipo: Texto com 100 caracteres de preenchimento opcional.
Amortiza sem troca de diferencial	Indicar quando o contrato previr ajuste com apenas troca de juros	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Quando Selecionada a opção Sim, se uma das curvas for moeda ou índice de preços registrar a(s) mesma(s) como VCP. Tipo: Domínio (SIM e NÃO).
Código Identificador		Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Tipo: Numérico (até 10 inteiros)

Exclusivo para Contrato à Termo			
Data Operação	Índice Termo	Perc. Termo	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Se Índice Termo			
PU Inicial/Cupom Limpo	Data de Cotação Final - Termo	Tipo/Classe	Denominação
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data Operação	Data em que o contrato terá sua Taxa a Termo formada	Condicional	Não há limite de prazo para o período a termo. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Índice Termo	Indica o parâmetro com o qual deve ser atualizado o Valor Base inicial, a partir da Data Operação até a data de efetivação do termo (Data Início), exclusive.	Condicional	<p>Se este campo não for preenchido, o sistema considera que o Valor Base não será corrigido, a partir da Data Operação (que deve estar preenchida) até a Data Início. Os participantes pactuam um único índice para atualização do Valor Base.</p> <p>Indexadores permitidos para atualização do Valor Base, quando contrato a termo: DI, SELIC, DOLAR, EURO/COM.EUROPEIA, EURO-BCE, IENE, LIBRA, FRANCO SUICO, PESO MEXICANO, OURO, TR, TJLP, FRANCO SUIÇO BCE e VCP.</p> <p>Observações:</p> <ul style="list-style-type: none"> ➤ No registro retroativo de contrato a termo com conta de cliente 1, não é permitido índice termo quando data de registro maior que data de início do contrato. ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978) ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUIÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
Perc. Termo	Valor percentual do Índice Termo que corrige o Valor Base inicial da operação a partir da Data Operação até a data de efetivação do termo (Data Início).	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório se o Índice Termo for preenchido.</p> <p>Tipo: Numérico(até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais).</p>
Se Índice Termo			
PU Inicial/ Cupom limpo		Condicional	Campo de preenchimento obrigatório apenas na data de

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
	<p>PU inicial para atualização do Valor Base. Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser 00 - VCP.</p> <p>Cupom Limpo, exclusivo para utilização em caso de índice Termo = dólar.</p> <p>Utilizado para informar o valor da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor inicial para valorização da curva do contrato quando código de registro igual a Dólar (Cupom Limpo).</p>		<p>registro do Swap. Caso não seja preenchido, o Valor Base é atualizado pelo Fator (campo abaixo).</p> <p>No caso de Swap à Termo, só deve ser preenchido quando Índice Termo for VCP, DOLAR ou EURO.</p>
Data de Cotação Final – Termo	Utilizado para informar o deslocamento da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor final para valorização da curva do contrato quando índice termo for moeda.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório para quando o campo “Índice termo” seja qualquer moeda disponível em seu domínio.</p> <p>Possíveis valores: (01) D-1; (02) D-2; (03) D-3; (04) D-4; (05) D-5;</p>
Tipo/Classe	Tipo do Índice VCP que atualiza o Valor Base do contrato a termo.	Obrigatório	<p>Caixa de Seleção com as opções descritas no tópico Consulta de Tipo de Classe. Não é permitida a indicação de Tipo/Classe 73 (Estratégia).</p>
Denominação	Descrição do parâmetro escolhido como VCP para atualização do Valor Base do contrato a termo. Texto livre com 320 posições.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório no caso do Termo = VCP</p> <p>Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo “Tipo/Classe”. Para maiores consultar a seção “Consulta Tipo Classe”.</p>

Curvas para Atualização							
Parte				Contraparte			
Percentual	Categoria	Curva		Percentual	Categoria	Curva	
TR Escolhida	+/-	Juros(% aa)		TR Escolhida	+/-	Juros(% aa)	
Lim. Inferior (Floor)		Lim. Superior (Cap)		Lim. Inferior (Floor)		Lim. Superior (Cap)	
Terceira Curva							
Parte/Contraparte	Cupom Limpo	Percentual	Curva	+/-	Juros(% aa)	Limitador	
Se Curva(s) = "VCP":							
Parte				Contraparte			
PU	Tipo/Classe			PU	Tipo/Classe		
Denominação				Denominação			
Cupom Limpo/Data Cotação							
Parte				Contraparte			
Cupom Limpo	Data de Cotação			Cupom Limpo	Data de Cotação		

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Percentual	Valor percentual do parâmetro com que o participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva.	Obrigatório	<p>O percentual pode ser menor, igual ou maior que 100%, com exceção da curva Libor, havendo ou não taxa de juros. Curvas iguais ou diferentes, inclusive VCP:</p> <p>Se os campos "Curva", "Percentual" e "Juros %a.a." forem idênticos -> Uma das pontas do contrato deve ter um Limitador Fator; e.</p> <p>Se os campos "Curva" forem iguais e contrato sem Limitador Fator -> Os campos "Percentual" e/ou "Juros %a.a." deverão ser diferentes.</p> <p>Informado com até 3 (três) inteiros e 2 (dois) decimais.</p>
Categoria	Indicar qual a classe de ativo em que a curva utilizada se encontra.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: ACOES, COMMODITIES, INDICES, INDICES DE PREÇOS, JUROS, JUROS INTERNACIONAIS, TAXAS DE CÂMBIO E VCP.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Curva	Indicar qual será o ativo subjacente da curva Parte	Obrigatório	A caixa de opções abrirá de acordo com a categoria escolhida. A relação de curvas por categoria pode ser consultada no arquivo público "Indexadores Swap".
TR Escolhida	Indicar qual será a TR vigente	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Tipo: Data (DDMMAAAA).
Sinal + / -	Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Preencher em conjunto com Juros. Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, DI 360 d, SELIC, Prefixado 252 d, Prefixado 360 d, Dólar, Dólar Com. Exp., Franco Suíço, Franco Suíço WMR, EURO/COM.EUROPEIA, Euro-BCE, Euro-WMR, Iene, Peso Mexicano, LIBOR, TJMI e Ibovespa Liquidação e Ibovespa Liquidação Contínuo (exclusivo para contrato com funcionalidade que envolva trigger). Aceitam taxas de juros negativas.</p> <p>Observações:</p> <ul style="list-style-type: none"> ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978) ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) ➤ EURO-WMR = Paridade USD/EUR (WMR) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			➤ FRANCO SUÍÇO WMR = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (WMR) / Paridade USD/EUR (WMR)]
Juros % a.a.	É a taxa de remuneração que, agregada ao parâmetro, atualiza o Valor Base.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher em conjunto com Sinal . Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.
Lim. Inferior (Floor)	Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o módulo usa o limite para corrigir a curva.	Opcional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”. Não é permitido o uso Limitadores para o registro de contrato caso Categoria e Curva for ACOES. Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais.
Lim. Superior (Cap)	Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o módulo usa o limite para corrigir a curva.	Opcional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais. Para maiores informações sobre a possibilidade de utilizar limitador superior e/ou inferior, consultar item “Contratos com limitador”, em “Informações Adicionais”. Não é permitido o uso Limitadores para o registro de contrato caso Categoria e Curva for ACOES.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Terceira Curva						
Parte/Contraparte	Cupom Limpo	Percentual	Curva	+/-	Juros(% aa)	Limitador
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Terceira Curva – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.			
Parte/ Contraparte		Condicional	Caixa de Seleção com as opções: Parte e Contraparte.
Cupom Limpo	Na utilização de Terceira Curva, exclusivamente para os parâmetros baseados em Moeda e Ibovespa de Liquidação, de comum acordo entre as partes, que o módulo usa como valor inicial para valorização da curva do contrato	Condicional	Informado com até 8 (oito) números inteiros e 7 (sete) decimais.
Percentual	Valor percentual do parâmetro de atualização da Terceira Curva do Swap, usada como Limite Inferior ou Superior.	Condicional	Informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais.
Curva	Na utilização de Terceira Curva que o módulo necessita para atualização do contrato.	Condicional	Caixa de Seleção com as opções: DI, Selic, Dólar, Dólar Com. Exponencial, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, Franco Suíço, Iene, Peso Mexicano, IGP-M, IGP-DI, INPC, TR, TJLP e Ouro. Observações: <ul style="list-style-type: none"> ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			<ul style="list-style-type: none"> ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
+ / -	Indica se o juro a ser agregado ao parâmetro de atualização é positivo ou negativo.	Condicional	<p>Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, SELIC, Dólar, Dólar Com. Exp., Franco Suíço, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, Iene e Peso Mexicano, aceitam taxas de juros negativas.</p> <p>Observações:</p> <ul style="list-style-type: none"> ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978) ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)].
Juros (% aa)		Condicional	Taxa de Juros que, agregada ao parâmetro escolhido para terceira curva, atualiza o valor base. Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Limitador	Informar se a terceira curva conta com limitador de variação de valorização do contrato.	Condicional	Caixa de Seleção com as opções: Limite Inferior e Limite Superior.

Cupom Limpo/Data Cotação			
Parte		Contraparte	
Cupom Limpo	Data de Cotação	Cupom Limpo	Data de Cotação
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cupom Limpo	Campo utilizado para Índice Ibovespa, Moedas e VCP. Cotação inicial informada pelas partes para valorização da curva do contrato.	Condicional	<p>Caso não seja informada a cotação inicial, será utilizada a cotação capturada automaticamente pelo Módulo conforme indicado no campo "Data de Cotação".</p> <p>Nos casos em que a cotação inicial será diferente daquela capturada automaticamente pelo Módulo, esta deve ser indicada exclusivamente por meio deste campo, não devendo ser informada no campo "Denominação".</p> <p>Tipo: Numérico (até 6(seis) inteiros e 8(oito) decimais)</p>
Data de Cotação	Data de Cotação a ser utilizada no início e no vencimento do contrato.		<p>Para curvas calculadas, são permitidas 3 (três) opções de datas de cotação: D-1, D-2 e D-3. Não preencher se curva escolhida for IPCA.</p> <p>Para curvas VCP, são permitidas 5 (cinco) opções de datas de cotação: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.</p> <p>Caso a Data de Cotação seja D0, indicar esta informação no campo "Denominação", não sendo permitido a indicação no campo "Data de Cotação".</p>

Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional"			
Parte		Contraparte	
Taxa Juros [] , []	Variação Cambial []	Taxa Juros [] , []	Variação Cambial []
Tipo Classe []	Cupom Limpo / Outros - Cotação [] , []	Tipo Classe []	Cupom Limpo / Outros - Cotação [] , []
Aliquota IR [] , []	Limite Inferior (Floor) - Perc. [] , []	Aliquota IR [] , []	Limite Inferior (Floor) - Perc. [] , []
Limite Superior (Cap) - Perc. [] , []		Limite Superior (Cap) - Perc. [] , []	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
EXCLUSIVO PARA TAXA JUROS MERCADO INTERNACIONAL - Parte/Contraparte - <i>Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Taxa Juros Mercado Internacional.</i>			
Taxa Juros	Taxa de Juros informada para o período determinado no campo Troca de Fluxo .	Obrigatório	Informar com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.
Variação Cambial	São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à TJMI. As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA e VCP .
Tipo Classe		Obrigatório	Caixa de seleção com as opções: US\$ Austrália, US\$ Canada e Franco Suíço.
Cupom Limpo / Outros - cotação	Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes.	Obrigatório	Somente deve ser preenchido: Se desejar utilizar o Cupom Limpo para uma das opções de variação cambial: DÓLAR, EURO, IENE ou LIBRA ; Cotação inicial da moeda quando indicada a opção VCP para variação cambial.
Alíquota IR	Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros ou vencimento do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Informar com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.
Limite Inferior (Floor) - Perc.	Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.
Limite Superior (Cap) - Perc.	Taxa arbitrada como Limite Superior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.

Exclusivo para Commodity e Ação			
Parte		Contraparte	
Cotação Inicial	Código da Commodity/Ação	Cotação Inicial	Código da Commodity/Ação
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Média Asiática Verificação	Data da Cotação para Ajuste	Média Asiática Verificação	Data da Cotação para Ajuste
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Tipo de Cotação	Spread	Tipo de Cotação	Spread
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
EXCLUSIVO PARA COMMODITY E AÇÃO - Parte/Contraparte			
Cotação Inicial	Cotação Inicial da Parte/Contraparte	Opcional	Informar 7(sete) inteiros e 4(quatro) decimais.
Código da Commodity/Ação	Código da Commodity ou Ação da Parte/Contraparte.	Obrigatório	Esse campo deverá ser preenchido através do RIC. Esta informação está disponível nos arquivos públicos relacionados à Mercadorias_Indexadores.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Média Asiática Verificação	Indica o tipo de média para a cotação para liquidação do contrato	Opcional	Caixa de seleção com as opções: Branco (quando opção não for Asiática), SIMPLES ou PONDERADA.
Data da Cotação para Ajustes	Data de Cotação para Ajuste da Parte/Contraparte.	Condicional	Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 5 (D-5). Dentre as opções disponíveis, a que for selecionada também será considerada para o cálculo da cotação da moeda atrelada à mercadoria.
Tipo de Cotação		Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando Categoria e Curva for ACOES. Caixa de Seleção com as Opções: "Ajuste", "Fechamento", "Máximo", "Médio" e "Mínimo".
+/-		Opcional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
Spread	É o valor do Spread a ser aplicado na cotação final para liquidação.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preencher em conjunto com Sinal . Informado com até 6 (seis) números inteiros e 4 (quatro) decimais.

Funcionalidades				
Trigger in			Trigger out	
Parte/Contraparte	Fator/Valor/Taxa	Verificação	Parte/Contraparte	Fator/Valor/Taxa
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Titular da Funcionalidade/Prêmio		Prêmio(1) de Funcionalidade		Prêmio(2) de Funcionalidade
Titular	Valor R\$	Rebate R\$	Valor R\$	Data Exercício
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
	Liquidação do Rebate	Dias Úteis após o Trigger Out		
	<input type="text"/>	<input type="text"/>		

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Funcionalidades - Campos exclusivos Trigger in / Trigger out – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.			
Parte / Contraparte	Define a Parte/Contraparte do Trigger.	Condicional	Caixa de Seleção com as Opções: Parte e Contraparte.
Fator / Valor / Taxa	Magnitude do parâmetro que determina a efetivação (Trigger In) ou rescisão (Trigger Out) do Swap.	Condicional	<p>Informado com até 8 (oito) inteiros e 8 (oito) decimais.</p> <p>Fator - informar com 8 (oito) casas decimais, se parâmetro informado for IGP-M, IGP-DI, INPC, TR ou qualquer outro parâmetro aceito como trigger, cuja verificação seja final.</p> <p>Taxa - informar com 2 (duas) casas decimais, se parâmetro informado for DI, SELIC ou TJLP.</p> <p>Valor - informar com 4 (quatro) casas decimais, se parâmetro informado for Dólar, Dólar Comercial Exponencial ou Ouro. Informar com 5 (cinco) decimais, se parâmetro informado for Franco Suíço ou Euro. Informar com 6 (seis) decimais, se parâmetro informado for Iene ou Peso Mexicano. Informar com 8 (oito) decimais, se parâmetro informado for Ibovespa de Liquidação.</p>
Verificação	Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.	Condicional	Caixa de Seleção com as opções: Diária e Final. Consulte Capítulo Informações Adicionais – Item <i>Contratos com Funcionalidades</i> .
Titular da Funcionalidade / Prêmio – Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.			

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Titular	Define se o titular é a Parte ou a Contraparte. Indica o Participante que pagará o prêmio.	Condicional	Caixa de Seleção com as opções: Parte e Contraparte.
Prêmio (1) de Funcionalidade – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.			
Valor (R\$)	Valor do prêmio.	Condicional	Pode ser informado como “0” (zero).
Rebate (R\$)	Define o valor da devolução do prêmio, pago no registro, ao titular do contrato, caso o contrato vença e não seja efetivado ou rescindido. O valor do rebate pode ser menor, igual ou maior que o valor do prêmio de funcionalidade.	Condicional	Pode ocorrer desde que, até a data de vencimento, não dispare o Trigger de Knock In ou dispare o Trigger de Knock Out . Válido somente para as funcionalidades: Knock In; Knock Out; Knock In-Out; e Knock Out com Opção de Arrependimento.
Liquidação do Rebate		Condicional	Caixa de Seleção com as opções Vencimento, Trigger Out e Após Número de Dias.
Dias Úteis Após o Trigger Out	Identifica a quantidade de dias úteis, após ocorrer o Knock Out, que é pago o Rebate.	Condicional	Não pode ultrapassar o dia do vencimento original do Swap.
Prêmio (2) de Funcionalidade – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.			
Valor (R\$)	Valor do prêmio.	Condicional	Pode ser informado como “0” (zero).
Data Exercício	Data em que o titular paga prêmio para exercer a opção de permanência no contrato.	Condicional	Preencher somente para a modalidade Compound Swaption.

Exclusivo para Curva de INDICES DE PRECOS	
Parte	Contraparte
Data de Fixing IPCA ▼	Data de Fixing IPCA ▼
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
EXCLUSIVO PARA CURVA DE ÍNDICE DE PREÇOS - Parte/Contraparte			
Data de Fixing IPCA		Opcional	<p>Caso não seja preenchido o sistema considerará M-1 já na tela de confirmação.</p> <p>Campo tipo domínio com as opções: "M-1" e "M-2",</p>

Observações:

- O campo **Juros (% aa)**, quando a curva selecionada for **Prefixada 252 d** ou **Prefixada 360 d** permite o preenchimento com a informação menor, igual ou maior que zero.
- As solicitações de cadastramento para novas opções de informações nos campos tipo "Combo Box" devem ser enviadas para a Área Operacional da B3 através do op.derivativosbalcao@b3.com.br
- É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.
- Não é permitido utilizar a Terceira Curva quando Categoria e Curva for ACOES.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

2 REGISTRO – CONTRATO FLUXO CONSTANTE

Através desta função, o Participante pode registrar um contrato de fluxo de pagamentos periódicos:

FORMAS DE LANÇAMENTO	FUNCIONALIDADES
Tela: Menu Swap > Lançamentos > Registro de Contrato – Fluxo Constante	<ul style="list-style-type: none"> Limitadores
Arquivo: 4.2.3. Registro de Contrato de Fluxo Constante	
Mensageria: Não disponível	
PRAZO: Conta 00 x Conta 00 – O registro deve ser realizado em D0 da contratação Conta 00 x Conta 10 ou 20 – É permitido o registro em até D+2 da contratação do derivativo	

Observação: Para as curvas Prefixado 252du, Prefixado 360 d, DI, TJMI e Libor há a possibilidade de indicação de limitadores, inferior e superior, para cada uma das datas de pagamento de diferencial para os contratos de Swap Fluxo de Caixa Constante e Não Constante.

Tela de Registro

Registro de Contrato - Fluxo de Caixa Constante			
Parte	Contraparte	CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Meu Número <input type="text"/>			
Características			
Data Início	<input type="text"/>	Data Vencimento	<input type="text"/>
Valor Base	<input type="text"/>	Agenda de Prêmio	<input type="text"/>
Observação	<input type="text"/>	Amortiza sem troca de diferencial	<input type="text"/>
		Adesão a Contrato	<input type="text"/>
		Código Estratégia	<input type="text"/>
		Código Identificador	<input type="text"/>
Exclusivo para Contrato à Termo			
Data Operação	<input type="text"/>	Índice Termo	<input type="text"/>
		Perc. Termo	<input type="text"/>
Se Índice Termo			
PU Inicial/Cupom Limpo	<input type="text"/>	Data de Cotação Final - Termo	<input type="text"/>
		Tipo/Classe	<input type="text"/>
		Denominação	<input type="text"/>
FLUXO DE JUROS e AMORTIZAÇÕES			
Juros a cada	<input type="text"/>	Período	<input type="text"/>
Amort a cada	<input type="text"/>	Período	<input type="text"/>
		Data Início Pagto Juros	<input type="text"/>
		Data Início Pagto Amort.	<input type="text"/>
		Tipo Amortização	<input type="text"/>

Descrição dos Campos da Tela Registro de Contrato – Fluxo Constante

As características para registro do contrato são semelhantes em suas maiorias, contudo com a inclusão. Abaixo seguem as diferenças existentes.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Juros a cada	Periodicidade do pagamento de juros, expressa no formato definido no campo Período .	Obrigatório	Campo numérico com até 10 dígitos numéricos.
Período		Obrigatório	<p>Prazo mínimo em dias úteis - 1 dia. Prazo mínimo em dias corridos - 5 dias.</p> <p>Caixa de Seleção com 3 formatos de informação: Dias Úteis, Dias Corridos e Meses.</p>
Data Início Pagto Juros	Define a data do primeiro pagamento de juros.	Obrigatório	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Pode ter ocorrido antes do registro do contrato. Tendo como data limite anterior 01/01/2004.</p>
Amortização a cada	Periodicidade da amortização, expressa no formato definido no campo Período .	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Até 10 dígitos numéricos.</p>
Período	Prazo mínimo em dias úteis - 1 dia. Prazo mínimo em dias corridos - 5 dias.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Dias Úteis, Dias Corridos, Meses, Na Data de Vencimento e Sem troca de amortização.</p>

Data Início Pagto Amort.	Define a Data da primeira troca de amortização. Será efetuado primeiramente o cálculo dos juros, e somente depois o cálculo das amortizações.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Embora admitidos fluxos diferentes entre troca de principal e de juros, as datas dos eventos de troca de principal, quando houver, devem ser coincidentes com as datas de trocas de juros. Tipo: Data(DDMMAAAA)
Tipo Amortização	Indica o tipo de amortização escolhido.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa de Seleção com as opções: Vazio, Sobre valor Base original (valor base da data do início do contrato) ou Sobre valor Base Remanescente (valor base original decrescido das amortizações já efetuadas).

Ao selecionar o botão **Enviar**, o sistema exibe uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Após clicar no botão **Confirmar**, o sistema aprova os dados e exibe uma tela informando que o contrato está aguardando lançamento da contraparte. Nesta tela são exibidos os botões **Prosseguir**, que dá continuidade ao registro, e **Desistir**, que cancela a operação.

3 REGISTRO – FLUXO NÃO CONSTANTE

Através desta função, o Participante pode registrar um contrato de fluxo de pagamentos não periódicos:

FORMAS DE LANÇAMENTO	FUNCIONALIDADES
<p>Tela: Menu Swap > Lançamentos > Registro de Contrato – Fluxo Não Constante</p> <p>Arquivo: 4.2.4. Registro de Contrato de Fluxo Não Constante 4.2.5. Registro de Contrato de Fluxo Não Constante Versão 0002 4.2.6. Registro de Contrato de Fluxo Não Constante</p> <p>Mensageria: Não disponível</p>	<ul style="list-style-type: none">Limitadores
<p>PRAZO: Conta 00 x Conta 00 – O registro deve ser realizado em D0 da contratação Conta 00 x Conta 10 ou 20 – É permitido o registro em até D+2 da contratação do derivativo</p>	

Observação: Para as curvas Prefixado 252du, Prefixado 360 d, DI 360d, DI, TJMI e Libor há a possibilidade de indicação de limitadores, inferior e superior, para cada uma das datas de pagamento de diferencial para os contratos de Swap Fluxo de Caixa Constante e Não Constante.

Tela de Registro de Fluxo Não Constante

Registro Fluxo de Caixa - Não Constante						
Contrato						
Código IF 21K00000897	Data Inicio 03/11/2021	Data Vencimento 06/12/2021				
Código Parte 10020.00-1	Código Contraparte 05000.00-5	Meu Número (Oper Original) 972724				
Parte (Nome Simplificado) LEMEBM	Contraparte (Nome Simplificado) RIOBM	Papel <input type="text"/>				
Curva Parte SOFR2	Curva Contraparte IPCA					
Tipo Amortização <input type="text"/>	Meu Número <input type="text"/>					
Fluxo Não Constante Ponta 1						
Data <input type="text"/>	+/- <input type="text"/>	Juros(% aa) <input type="text"/>	Taxa Amortização <input type="text"/>			
Data 06/12/2021	+/- <input type="text"/>	Juros(% aa) <input type="text"/>	Taxa Amortização <input type="text"/>			
Fluxo Não Constante Ponta 2						
Data <input type="text"/>	+/- <input type="text"/>	Juros(% aa) <input type="text"/>	Data Inicio Composição da Taxa <input type="text"/>	Data Final Composição da Taxa <input type="text"/>	Data Fixing Moeda <input type="text"/>	Taxa Amortização <input type="text"/>
Data 06/12/2021	+/- <input type="text"/>	Juros(% aa) <input type="text"/>	Data Inicio Composição da Taxa <input type="text"/>	Data Final Composição da Taxa <input type="text"/>	Data Fixing Moeda <input type="text"/>	Taxa Amortização <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>						

As características para registro do contrato são semelhantes em suas maiorias ao registro de Pagamento Final, contudo com a inclusão. Abaixo seguem as diferenças existentes.

Tela de Registro de Fluxo Não Constante – TERM SOFR

Exclusivo para curva "TERM SOFR"			
Parte		Contraparte	
Variação Cambial	Cotação Inicial Moeda	Variação Cambial	Cotação Inicial Moeda
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
EXCLUSIVO PARA TERM SOFR - Parte/Contraparte - Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por TERM SOFR.			
Variação Cambial	São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à Taxa Term Sofr.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: DÓLAR . As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda, conforme a "Data da Cotação – Variação Cambial" indicada na tela do Fluxo de Caixa não Constante.
Cotação Inicial Moeda	Deverá ser indicada a cotação da inicial da moeda, se necessário	Opcional	Tipo: Numérico (8 (oito) inteiros e 7(sete) decimais).
Dados para preenchimento no registro do Fluxo de Caixa – Não Constante			
Data da Cotação – Term Sofr	Deverá ser indicada a Data para a captura da Cotação da Term Sofr.	Obrigatório	Tipo: Data (DD/MM/AAAA)
Data da Cotação – Variação Cambial	Deverá ser indicada a Data para a captura da Cotação da Moeda Estrangeira para cálculo da Term Sofr	Obrigatório	Tipo: Data (DD/MM/AAAA)
Limite Inferior	Taxa arbitrada como Limite Inferior da Term Sofr apurada para o evento de juros/amortização.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
			Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.
Limite Superior (Cap) - Perc.	Taxa arbitrada como Limite Superior da Term Sofr apurada para o evento de juros/amortização.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.

Exclusivo para curva "Juros Internacionais Overnight"			
Data Liquidação ▼			
Parte		Contraparte	
Cotação Inicial Moeda ,	Expressão Juros ▼	Cotação Inicial Moeda ,	Expressão Juros ▼
Metodologia de composição da taxa ▼	Alíquota IR (em %) ,	Metodologia de composição da taxa ▼	Alíquota IR (em %) ,
Deslocamento da taxa ▼		Deslocamento da taxa ▼	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
EXCLUSIVO PARA "JUROS INTERNACIONAIS OVERNIGHT" - Parte/Contraparte - <i>Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por SOFR.</i>			
Data Liquidação	Indica a data da liquidação dos eventos intermediários do vencimento das duas curvas do Swap.	Obrigatório	Tipo: Domínio com as opções: (D+0), (D+1), (D+2), (D+3), (D+4) e (D+5)

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cotação Inicial Moeda	Cotação inicial da moeda do ativo subjacente (USD DOLAR se Curva = SOFR). As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda.	Opcional	Se não informada, o sistema considera a cotação de D0 da Data de Início do contrato. Tipo: Numérico (8 (oito) inteiros e 7(sete) decimais).
Expressão Juros	Indica a metodologia de cálculo do cupom indicado no campo "Juros (em % a.a)."	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Vazio, Linear act/360 Para mais informações, consultar o Caderno de Fórmula – Curva Calculada de SOFR.
Metodologia de composição da taxa	Indica a metodologia de cálculo para o accrual da taxa no período indicado nos campos da tela de fluxo "Data Início Composição da Taxa" e "Data Fim Composição da Taxa".	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Vazio, Compounding act/360 Para mais informações, consultar o Caderno de Fórmula – Curva Calculada de SOFR.
Alíquota IR	Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros ou vencimento do contrato.	Não permito	Campo atualmente desabilitado (não permitido o preenchimento)
Deslocamento da taxa	Funcionalidade de Lookback. Indica o deslocamento da taxa para cálculo do accrual diário.	Obrigatório	Campo tipo domínio com as opções: "D-0", "D-1", "D-2", "D-3", "D-4", "D-5", "D-6", "D-7", "D-8", "D-9" e "D-10" Para mais informações, consultar o Caderno de Fórmula – Curva Calculada de SOFR .

Tela Filtro Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

Registro Fluxo de Caixa - Não Constante		
Parte	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Contraparte	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Meu Número (Oper Original)	<input type="text"/>	
Número de Datas de Eventos	<input type="text"/>	
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Todos os campos da tela acima são de **preenchimento obrigatório**.

O número de Datas de Evento tem um **limite de 180 fluxos** (incluindo o vencimento do contrato).

Se o Participante não desejar indicar o fluxo de eventos nesse momento e clicar no botão Desistir, posteriormente deve realizar essa operação através da função Registro de Fluxo de Caixa

Observações:

- 1) As informações das datas do fluxo não constante da Parte devem coincidir, obrigatoriamente, com as datas do fluxo não constante da Contraparte.
- 2) Não é necessário o preenchimento dos campos de "Data" e "Taxa de Amortização" nas duas pontas do contrato. Caso seja informado apenas para a ponta 1, o sistema irá replicar os mesmos dados para a ponta 2 e estará disponível para consulta após a confirmação do contrato.
- 3) Os campos Data Início Composição da Taxa, Data Final Composição da Taxa e Data Fixing Moeda encontram-se disponíveis para preenchimento somente quando uma das pontas do contrato utilizar como parâmetro a curva SOFR.

Descrição dos Campos de Tela Registro Fluxo de Caixa - Não Constante

Registro Fluxo de Caixa - Não Constante		
Contrato		
Código IF 21K00000897	Data Início 03/11/2021	Data Vencimento 06/12/2021
Código Parte 10020.00-1	Código Contraparte 05000.00-5	Meu Número (Oper Original) 972724
Parte (Nome Simplificado) LEMEBM	Contraparte (Nome Simplificado) RIOBM	Papel <input type="text"/>
Curva Parte SOFR2	Curva Contraparte IPCA	
Tipo Amortização <input type="text"/>	Meu Número <input type="text"/>	

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Papel	Indica a ponta que está efetuando a atualização.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Ponta1 ou Ponta2 .
Tipo de Amortização	Informa sobre qual valor incidirá a amortização.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Vazio, Sobre o valor Base original (valor base da data do início do contrato), Sobre o valor Base Remanescente (valor base original decrescido das amortizações já efetuadas), Na Data de Vencimento e Sem Troca de Amortização.
Meu número	Número atribuído a operação de registro de fluxo de caixa não constante.	Obrigatório	Número interno de cada participante identificando o lançamento.

Fluxo Não Constante Ponta 1

Data	+/-	Juros(% aa)	Taxa Amortização
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Data	+/-	Juros(% aa)	Taxa Amortização
06/12/2021	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Fluxo Não Constante Ponta 2

Data	+/-	Juros(% aa)	Data Inicio Composição da Taxa	Data Final Composição da Taxa	Data Fixing Moeda	Taxa Amortização
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Data	+/-	Juros(% aa)	Data Inicio Composição da Taxa	Data Final Composição da Taxa	Data Fixing Moeda	Taxa Amortização
06/12/2021	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data	Data em que ocorrerá o evento.	Obrigatório	Para os contratos em que uma das curvas seja SOFR , não é possível informar uma Data que seja menor ou igual a "Data de Liquidação" do evento anterior. Tipo: Data (DDMMAAAA)

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
+/-	Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa.	Condicional	Preencher em conjunto com Juros . Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, Dólar, Libor e TJMI aceitam taxas de juros negativas.
Taxa Juros	Taxa de Juros informados para o evento.	Condicional	<p>É possível informar taxas de juros diferentes para cada data de evento, independentemente da curva utilizada (calculadas ou VCP). Para isso, o campo “Juros % a.a.” na primeira tela de registro, das características gerais do contrato, não deve ser preenchido (caso preenchido, o sistema irá adotar a taxa informada nele para todos os eventos).</p> <p>Informar com até 3(três) números inteiros e 4(quatro) decimais.</p>
Taxa Amortização	Percentual de amortização a ser aplicado conforme opção escolhida no campo Tipo Amortização .	Condicional	<p>Se o Tipo Amortização escolhida for Sobre o valor Base Original, a soma das taxas informadas deverá ser igual a 100%.</p> <p>Informar com até 3(três) inteiros e 5(cinco) decimais.</p>

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data Início Composição da Taxa	Indica a data em que irá iniciar o <i>accrual</i> da taxa SOFR para o fluxo indicado. Exclusivo para curva SOFR.	Opcional	Funcionalidade de <i>Shift</i> da taxa. Pode ser menor, igual ou maior a data de início do contrato. Deve ser obrigatoriamente menor que a data do evento. Caso não seja informado, no primeiro fluxo será considerado a data de início do contrato e nos demais fluxos, será considerada a “Data Final Composição da Taxa” do fluxo imediatamente anterior.
Data Final Composição da Taxa	Indica a data em que irá finalizar o <i>accrual</i> da taxa SOFR para o fluxo indicado. Exclusivo para curva SOFR.	Opcional	Funcionalidade de <i>Shift</i> da taxa. Deve ser obrigatoriamente menor que a data do evento e maior que a “Data Início Composição da Taxa”. Caso não seja informado, será considerado a data de D-1 da data de evento.
Data fixing Moeda	Indica a data em que será capturada a cotação final da moeda, para cálculo da variação cambial. Exclusivo para curva SOFR.	Opcional	Caso não seja informado, será considerado a data de D-1 da data de evento.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

4 REGISTRO – CURVA NÃO CALCULADA (VCP)

As curvas VCP disponíveis para uso nos módulos de Swap e Opções Flexíveis Sem CCP são curvas de indexadores não calculadas pelo sistema.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Contrato – Pagamento Final (ou) Registro de Contrato – Fluxo (ou) Constante Registro de Contrato – Fluxo Não Constante

Arquivo:

- 4.2.1.Registro de Contrato com Pagamento Final
- 4.2.2. Registro de Contrato com Pagamento Final Versão 00002
- 4.2.3. Registro de Contrato de Fluxo Constante
- 4.2.4. Registro de Contrato de Fluxo Não Constante
- 4.2.5. Registro de Contrato de Fluxo Não Constante Versão 0002
- 4.2.6. Registro de Contrato de Fluxo Não Constante

Mensageria: CTP9001 – SWAP – Registro de Contrato Pagamento Final

PRAZO: Conta 00 x Conta 00 – O registro deve ser realizado em D0 da contratação
Conta 00 x Conta 10 ou 20 – É permitido o registro em até D+2 da contratação do derivativo

FUNCIONALIDADES: Verificar pela classe ativo

Tela de Registro “Se Curva(s) = ‘VCP’”

Se Curva(s) = "VCP":			
Parte		Contraparte	
PU <input type="text"/>	Tipo/Classe <input type="text"/>	PU <input type="text"/>	Tipo/Classe <input type="text"/>
Denominação <input type="text"/>		Denominação <input type="text"/>	
Cupom Limpo/Data Cotação			
Parte		Contraparte	
Cupom Limpo <input type="text"/>	Data de Cotação <input type="text"/>	Cupom Limpo <input type="text"/>	Data de Cotação <input type="text"/>

As curvas VCP disponíveis para uso nos módulos de Swap e Opções Flexíveis Sem CCP são curvas de indexadores não calculadas pelo sistema. Elas podem ser utilizadas nos seguintes casos:

1. indexadores que não estão disponíveis como curvas calculadas, ou
2. para os indexadores que já tenham curvas calculadas, o VCP poderá ser utilizado somente se o critério de apuração da curva pactuado entre as partes do contrato for diferente da metodologia da curva calculada (prevista no caderno de fórmulas e manuais de operação da B3).
3. para contratos com características que não estão habilitadas para os indexadores calculados (p.e. média asiática e barreiras de knock-in e knock-out).

Como funcionam as curvas VCP:

1. No registro da operação: As partes do contrato informam a descrição completa dos parâmetros utilizados para apuração da curva VCP, de modo a possibilitar que a B3, a qualquer tempo, verifique a consistência das metodologias adotadas e dos preços praticados.

2. No vencimento do contrato (liquidação financeira): As partes do contrato são responsáveis por informar no sistema o PU da curva VCP. Com esse lançamento, o sistema calculará o ajuste do contrato, conforme.

As características para registro do contrato são semelhantes em suas maiorias ao registro de Pagamento Final, Fluxo Constante e Fluxo Não Constante contudo com a inclusão de campos. Abaixo seguem as diferenças existentes.

Descrição dos Campos – Registro de Curvas Não Calculadas

Se Curva (s) = VCP - Parte/Contraparte – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
PU	Valor unitário do índice na data de contratação do Swap em que a variação do parâmetro não disponibilizado pela B3 é aplicada. É o PU inicial quando a Curva escolhida for 00 - VCP .	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando curva 00 ou contrato à vista ou decorrido.</p> <p>Pode ser atualizado pela função Atualização de PU / Fator até a data do vencimento.</p>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Tipo/Classe	Tipo do Índice VCP para a(s) curva(s) do(s) Participante e da Contraparte, caso seja(m) do tipo VCP .	Condicional	Caixa de Seleção com as opções descritas no tópico Consulta de Tipo de Classe.
Denominação	Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo "Tipo/Classe".	Condicional	<p>Campo não deve ser preenchido quando a ponta do contrato for Curva VCP e Tipo/Classe 73 (Estratégia).</p> <p>Descrição do parâmetro escolhido como VCP para a(s) curva(s) do(s) Participante e da Contraparte, caso seja(m) do tipo VCP.</p> <p>Texto livre com 320 posições.</p>
Cupom Limpo	<p>Cotação inicial informada pelas partes para valorização da curva do contrato.</p> <p>Campo utilizado para Índice Ibovespa, Moedas e VCP.</p>	Condicional	<p>Caso não seja informada a cotação inicial, será utilizada a cotação capturada automaticamente pelo Módulo conforme indicado no campo "Data de Cotação".</p> <p>Nos casos em que a cotação inicial será diferente daquela capturada automaticamente pelo Módulo, esta deve ser indicada exclusivamente por meio deste campo, não devendo ser informada no campo "Denominação".</p>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Data de Cotação	Data de Cotação a ser utilizada no início e no vencimento do contrato.	Condicional	<p>Para curvas calculadas, são permitidas 3 (três) opções de datas de cotação: D-1, D-2 e D-3. Não preencher se curva escolhida for IPCA.</p> <p>Para curvas VCP, são permitidas 5 (cinco) opções de datas de cotação: D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5.</p> <p>Caso a Data de Cotação seja D0, indicar esta informação no campo "Denominação", não sendo permitido a indicação no campo "Data de Cotação".</p>

O(s) Registrador (es) do Contrato é (são) responsável (eis) por registrar a descrição completa e detalhada do Parâmetro, de modo a possibilitar que a B3, a qualquer tempo, verifique a consistência das metodologias adotadas e dos preços praticados, conforme Comunicado CETIP 126/08 de 04 de Novembro de 2008.

A indicação de uma das opções disponíveis no Módulo para atualização da curva VCP significa, obrigatoriamente, que a atualização toma por base exclusivamente este parâmetro, não existindo outra condição ou critério para a sua apuração, conforme Comunicado B3 130/08 de 17 de novembro de 2008.

Informação obrigatória de dados adicionais

A utilização de curvas do tipo VCP implica aos Participantes a prestação de informações adicionais. As obrigações adicionais estão detalhadas no Comunicado Cetip nº 016/2017 de 13 de março de 2017.

As informações adicionais devem ser informadas no sistema obedecendo os seguintes prazos:

Informação	Curva	Periodicidade	Prazo	Módulo/Função
Marcação a Mercado (MtM)	VCP	Mensal	Do último dia útil do mês de referência até o 4º dia útil do mês subsequente	MID>Marcação a Mercado de IF ou Registro de Informações de Derivativos

Informação	Curva	Periodicidade	Prazo	Módulo/Função
Atualização de PU/Fator	VCP e outras (ver item sobre a função “Atualização de PU/Fator”)	Mensal	No último dia útil do mês	Swap>Atualização de PU/Fator
% Notional Máximo	VCP-73	Mensal	3 dias úteis após o registro do contrato	MID>Marcação a Mercado de IF ou Registro de Informações de Derivativos
% Notional Mínimo	VCP-73	Mensal	3 dias úteis após o registro do contrato	MID>Marcação a Mercado de IF ou Registro de Informações de Derivativos

A ausência de informação no prazo acima estabelecido caracteriza inadimplência regulamentar do Participante, acarretando o pagamento de multa (conforme Tabela de Preços, disponíveis no site da B3).

INFORMAÇÕES NECESSÁRIAS – CURVAS NÃO CALCULADAS

Curvas VCP disponíveis e cadastro de novas curvas

As curvas VCP disponíveis para utilização nos módulos de Swap e Opções Flexíveis sem

Contraparte Central Garantidora podem ser consultadas no arquivo público

AAAAMMDD_Indexadores_Derivativos_VCP, disponível em:

1) <ftp://ftp.cetip.com.br/Public> ou:

2) Sistema NoMe > Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos

Solicitações para inclusão de novos indexadores como curvas VCP podem ser feitas através do email **derivativos@b3.com.br**

A seguir estão detalhadas as informações necessárias para cada categoria de curva VCP.

Informações necessárias

Informar nos respectivos campos do registro do contrato, as informações indicadas na tabela a seguir: **Informações necessárias**

5.1 Moedas

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Sobre o ativo		
Fonte de Informação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	
Tipo de cotação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Compra, Venda, Média
Boletim	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Horário de consulta da cotação
Cotação inicial	<ul style="list-style-type: none"> Cupom Limpo 	Na hipótese de início a termo e a cotação inicial formada por uma média de cotações, informar no campo “Denominação” as datas das cotações para média aritmética, ou informar no campo “Denominação” as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.
Cross Rate	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<ul style="list-style-type: none"> Se houver Cross Rate, informar no campo “Denominação” a cotação inicial da moeda de passagem em relação ao real. Caso a “Data de Cotação” seja D0, indicar esta informação no campo “Denominação” e o combo do campo “Data de Cotação” não deverá ser preenchido.
Fixing para vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data Cotação 	<ul style="list-style-type: none"> Caso o fixing para vencimento seja D0, informar no campo “Denominação”. Na hipótese de utilização de cross rate com “Data de Cotação” distinta entre as moedas, ambas as datas devem ser informadas no campo “Denominação”. Se utilizada a média de cotações: informar no campo “Denominação” as datas das cotações para média aritmética, ou informar no campo “Denominação” as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.
Cupom de Juros/Spread	<ul style="list-style-type: none"> Campos “+/-” e “Juros (% a.a.) 	<p>i. Caso o cupom de juros/spread não seja em % a.a., informar no campo “Denominação” a periodicidade (exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.)</p> <p>a) a base de cálculo do cupom de juros/spread no campo “Denominação”;</p>

		<p>b) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear) no campo “Denominação”.</p> <p>Incidência de juros</p> <p>a) informar caso a incidência seja sobre parcela no campo “Denominação”.</p>
Média aritmética		
Se for simples ou ponderada: Datas da média Pesos, se média ponderada	<ul style="list-style-type: none"> “Datas de Verificação” 	
Limitador e Barreiras		
Limitador de alta ou baixa e Barreira de KI e/ou KO	<ul style="list-style-type: none"> “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)” 	<p>a) deve ser indicado exclusivamente nos campos “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”,</p> <p>i. Caso o limitador informado no campo “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)” seja em valor, mencionar no campo “Denominação”. Caso não seja feita nenhuma menção nesse sentido, será entendido que o limitador está na forma de fator arbitrado.</p> <p>b) informar no campo “Denominação” se o limitador é sobre:</p> <p>i. a variação cambial sobre juros e amortização</p> <p>ii. a variação cambial incidente sobre a amortização, somente</p> <p>iii. a variação cambial incidente sobre os juros, somente.</p> <p>c) Para operações com Cross Rate, caso o limitador incida sobre a paridade entre a moeda da curva e a moeda de passagem, informar no campo “Denominação”. Se não for feita nenhuma menção nesse sentido, será entendido que o limitador incide sobre a paridade entre a moeda da curva e o real.</p>
Verificação de barreiras (Americana/Europeia)	<ul style="list-style-type: none"> Periodicidade de verificação das Barreiras 	A periodicidade Americana assume a verificação de D+1 da data de início até a data de fixing inclusive
Se Verificação de barreiras = Americana, mas com janela de datas de observação, informar também: Janela de verificação das barreiras com a Data de Início (inclusive) e a Data Final (inclusive)	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Informar a janela de verificação das barreiras com a Data de Início (inclusive) e a Data Final (inclusive)
Paridade entre Moedas		

Razão Inicial entre as duas paridades	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	1) Informar a razão inicial entre as duas paridades; data de cotação das duas paridades (d0, d-1, d-2 ou d-3);
---------------------------------------	---	--

Critério de Cálculo de PU ou de Fator

- 1) As curvas de moeda desta categoria se referem à paridade entre a moeda estrangeira da curva e o real (BRL/ME).
- 2) As moedas devem ser utilizadas exclusivamente como fator de correção cambial, contemplando a variação entre a cotação definida para o vencimento e a indicada para a data de início do contrato.
- 3) Permitida a utilização com ou sem cross rate para apuração das cotações para estes códigos de Tipo_Classe.
- 4) A moeda deve ser utilizada exclusivamente como fator de correção cambial, contemplando a variação entre a cotação definida para o vencimento e a indicada para a data de início do contrato.
- 5) Não é permitida a utilização de cross rate para Paridade entre moedas
- 6) O fixing padrão para liquidação será a PTAX-Venda, divulgada pelo Sisbacen. A utilização de dados divulgados pelo EMTA será considerada como fixing para liquidação sob duas condições:
 - a) ausência de divulgação da cotação pelo Sisbacen; ou
 - b) a divulgação da cotação pelo EMTA superar uma variação, em módulo, de 3% em relação à divulgação pelo Sisbacen.

Observação referente à utilização da cotação EMTA nas curvas VCP 327, 343, 5008 e 5630:

- 1) Não estão contempladas neste VCP cláusulas de diferimento de pagamentos da liquidação financeira de eventos e;
- 2) No caso do contrato apresentar condições diferentes das estabelecidas para este VCP, inclusive com relação ao percentual de materialidade, as mesmas devem ser submetidas à apreciação prévia por parte da B3.

5.2 Taxa de Juros Nacionais

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Fonte de Informação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	
Parâmetros De Cálculo	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Parâmetros/Critérios de Cálculos necessários para aferição dos PUs informados.
Percentual da curva	<ul style="list-style-type: none"> Percentual 	Horário de consulta da cotação
Fixing para vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data Cotação 	<ul style="list-style-type: none"> Caso o fixing seja diferente do vencimento, informa-lo no campo "Denominação" (D-1,...,D-5).
Cupom de Juros/Spread	<ul style="list-style-type: none"> Campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" 	i. Caso o cupom de juros/spread não seja em % a.a., informar no campo "Denominação" a periodicidade

		<p>(exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.)</p> <p>a) a base de cálculo do cupom de juros/spread no campo “Denominação”;</p> <p>b) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear) no campo “Denominação”.</p> <p>Incidência de juros</p> <p>a) informar caso a incidência seja sobre parcela no campo “Denominação”.</p> <p>Em caso de Fluxo de Caixa, a opção de variação acumulada e/ou juros entre fluxos, deverá ser indicada no campo “Denominação”.</p>
Exclusivamente para o DI		
Metodologia de Accrual	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>i. Caso a metodologia de accrual do DI seja diferente da padrão (exponencial, base 252) informar no campo “Denominação” a metodologia de cálculo utilizada (exemplo: linear) e a base (exemplo: 360). Na ausência dessa informação, será assumida a metodologia padrão.</p> <p>ii. Caso haja accrual também em dias em que não houver divulgação do DI, informar no campo denominação o tratamento utilizado (exemplo: repetição do último conhecido).</p>
Exclusivamente para TR		
Acúmulo Mensal	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>Caso o acúmulo seja mensal, indicar a data base (dia de aniversário de cada mês).</p> <p>i. Indicar também o mês de referência para o acúmulo mensal (M-0, M-1 ou M-2).</p>
Exclusivamente para UMSELIC:		
Além das informações solicitadas acima, quando aplicáveis, informar também:		
Cotação Inicial da Unidade de Referência	<ul style="list-style-type: none"> Cupom Limpo 	Para conversão do valor base em Reais
Deslocamento para o Vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data da Cotação 	O deslocamento em relação ao vencimento e às datas de evento (D-1, ..., D-5) para captura da cotação utilizada para converter o valor de liquidação em unidade de referência UMSELIC para Reais, no campo “Data de Cotação”.
Exclusivamente para Selic Refis		
Mês de referência (fixing)	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Indicar o Mês de referência (<i>fixing</i>) para a cotação nas datas de evento (M-1, ..., M-5) no campo

		"Denominação", para fins de apuração da taxa acumulada.
--	--	---

Critério de Cálculo de PU ou de Fator

- 1) As curvas devem ser utilizadas como taxa de juros, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.
- 2) TR e TJLP devem ser utilizadas somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.
 - a. Para TR e TJLP é permitida a capitalização de juros. Sendo que para a TJLP, a capitalização deve ser feita pela URTJLP - neste caso, indicar "critério BNDES" no campo "Denominação".
- 3) A curva "UMSELIC 143" (código 10535) deve ser utilizada somente como unidade de referência para fins de cálculo de juros e/ou amortização, conforme modelo adotado pelo BNDES. A liquidação dos respectivos valores deverá ser feita, obrigatoriamente, em reais.
 - i. Obs.: para as curvas que já são calculadas pela B3, a curva VCP deverá ser utilizada somente se o critério de apuração da taxa for diferente dos estabelecidos em cadernos de fórmulas e manuais de operação da B3.
- 4) A utilização da curva "Fator IPCA – BNDES" (código 12227) implica a utilização da metodologia de cálculo do fator IPCA adotada pelo BNDES na composição da TLP (mais informações no site do BNDES: goo.gl/LN89pb) , conforme Resolução Bacen nº 4.600/17.
- 5) A utilização da curva "Selic REFIS" (código 14743) implica a utilização da metodologia de cálculo adotada pela Receita Federal na concessão do REFIS, através do accrual linear da Taxa Selic Mensal (% a.m) apurada e divulgada pela Receita Federal.

5.3 Taxa de Juros Internacionais e Futuro de Taxa de Juros

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Parâmetros De Cálculo	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Parâmetros/Critérios de Cálculos necessários para aferição dos PUs informados.
Fixing para vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data Cotação 	<ul style="list-style-type: none"> Informar o fixing para vencimento da taxa de juros, somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a taxa é cotada no campo "Denominação".
Cotação inicial	<ul style="list-style-type: none"> Cupom Limpo 	Informar o fixing da moeda no campo "Data de Cotação". Caso a "Data de Cotação" seja D0, indicar esta informação no campo "Denominação" e o combo do campo "Data de Cotação" não deverá ser preenchido.

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Cross Rate	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>Caso seja utilizado Cross Rate para apuração da cotação da moeda em que a taxa de juros é expressa, informar: a moeda de conversão; a fonte de informação da moeda de conversão; o horário da moeda de conversão; o tipo da moeda de conversão; o fixing da moeda de conversão no campo "Denominação".</p> <p>Na hipótese de utilização de Cross Rate com datas de fixing diferentes entre as moedas, ambos os fixings devem ser informados no campo "Denominação".</p>
Imposto de Renda	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	
Interpolação de períodos	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<ul style="list-style-type: none"> Mencionar o critério de interpolação de períodos, quando houver, e o respectivo fluxo ao qual incidirá no campo "Denominação".
Cupom de Juros/Spread	<ul style="list-style-type: none"> Campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" 	<p>i. Caso o cupom de juros/spread não seja em % a.a., informar no campo "Denominação" a periodicidade (exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.)</p> <p>a) a base de cálculo do cupom de juros/spread no campo "Denominação";</p> <p>b) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear) no campo "Denominação".</p> <p>Incidência de juros</p> <p>a) informar caso a incidência seja sobre parcela no campo "Denominação".</p> <p>Em caso de Fluxo de Caixa, a opção de variação acumulada e/ou juros entre fluxos, deverá ser indicada no campo "Denominação".</p>
Limitador Inferior ou Superior	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>a) caso o valor/fator do limitador seja "zero", informar no campo "Denominação".</p> <p>b) caso o valor/fator do limitador seja qualquer outro número diferente de "zero", este deve ser indicado exclusivamente nos campos "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)",</p>

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
		<p>i. Caso o limitador informado no campo “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)” seja em valor, mencionar no campo “Denominação”. Caso não seja feita nenhuma menção nesse sentido, será entendido que o limitador está na forma de fator arbitrado.</p> <p>ii. Se o limitador informado no campo “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)” for negativo, informar no campo “Denominação”. Caso não haja nenhuma menção nesse sentido, será entendido que o limitador é positivo.</p> <p>c) informar no campo “Denominação” se o limitador é sobre:</p> <p>i. a taxa de juros</p> <p>ii. a variação cambial</p> <p>iii. a variação cambial incidente sobre a amortização, somente</p> <p>iv. a variação cambial incidente sobre o cupom, somente</p> <p>v. a taxa de juros mais o cupom</p> <p>vi. o PU da curva (que abrange juros, cupom e a variação cambial)</p>
Incidência de juros	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Informar caso a incidência seja sobre parcela no campo “Denominação”.
<i>Exclusivo para taxas de juros overnight (EONIA Index e SOFR Rate Index)</i>		
Metodologia Para Accrual Diário Da Taxa	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>Sobre a metodologia para accrual diário da taxa:</p> <p>(i) informar se será “Compounding” ou “Linear”, conforme definido no Caderno de Fórmulas de Swap – Seção VCP 4.6.</p> <p>(ii) informar a base de dias para accrual (360; 252).</p> <p>(iii) informar se há deslocamento da taxa, em relação a data do accrual, (D-1, D-2 e etc) que será o mesmo para fluxos intermediários (se houver) e vencimento.</p> <p>Caso não sejam informadas, será considerada a metodologia “Compounding” com base “act/360” e “sem deslocamento da taxa”.</p>

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
		<p>b) Informar o fixing (D-1, D-2 e etc) para início e final do accrual da taxa de juros, que será o mesmo para fluxos intermediários (se houver) e vencimento.</p> <p>Caso não seja informado, será assumido que o accrual será da data de início até D-1 data do fluxo e/ou do vencimento do contrato</p>

Critério de Cálculo de PU ou de Fator

As curvas devem ser utilizadas como taxa de juros, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.

Obs.: para as curvas que já são calculadas pela B3, a curva VCP deverá ser utilizada somente se o critério de apuração da taxa for diferente dos estabelecidos em cadernos de fórmulas e manuais de operação da B3.

5.4 Índices de Preço

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Fonte de Informação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	
Fixing para vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data Cotação 	<ul style="list-style-type: none"> Informar o fixing para vencimento da taxa de juros, somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a taxa é cotada no campo "Denominação".
Cotação inicial	<ul style="list-style-type: none"> Cupom Limpo 	<p>A cotação inicial padrão será considerada o último número-índice conhecido em D-1 da data de registro.</p> <p>i. Caso a cotação (número índice) inicial desejada seja diferente da referência padrão, indicá-la exclusivamente no campo "Cupom Limpo".</p> <p>ii. Para operações com início a termo em que o número índice inicial não seja conhecido no momento de registro, informar o mês de referência do número índice inicial no campo "Denominação" (informar o mês de referência no formato M-0, M-1, ..., M-12 do mês de início da operação).</p>

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Data de Aniversário e Parâmetros de atualização	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>a) Informar o dia de aniversário do contrato (de 1 a 31) no campo "Denominação". Na ausência, será entendido o dia do vencimento.</p> <p>b) Periodicidade de atualização da curva (ex: bimestral, semestral, etc) no campo "Denominação". Na ausência, será entendido como mensal.</p> <p>c) Caso haja cálculo de pro rata, informar as referências para o cálculo (ex: "pro rata entre data de divulgação e de aniversário", ou "pro rata entre data de aniversário e de evento") no campo "Denominação".</p>
Variação Acumulada	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Caso seja Fluxo de Caixa, a opção de variação acumulada e/ou juros entre fluxos deverá ser indicada no campo "Denominação".
Percentual	<ul style="list-style-type: none"> Percentual 	O percentual destacado do índice utilizado exclusivamente no campo "Percentual" (caso o "Percentual" informado seja sobre a variação diária, informar "percentual diário").
Cupom de Juros/Spread	<ul style="list-style-type: none"> Campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" 	<p>a) a base de cálculo (360 ou 252 do cupom de juros/spread no campo "Denominação";</p> <p>b) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear) no campo "Denominação".</p>
Limitador Inferior ou Superior	<ul style="list-style-type: none"> Lim. Inferior (Floor) ou Lim. Superior (Cap) 	É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior, este deve ser indicado, na forma de fator arbitrado, exclusivamente no campo "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
Incidência de juros	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>Informar caso a incidência seja sobre parcela no campo "Denominação".</p> <p>Na ausência, será entendido juros sobre o saldo devedor.</p>

Critério de Cálculo de PU ou de Fator

1) Os índices devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação acumulada entre a data de início do contrato e o vencimento.

2) Somente será permitida a utilização de índice com divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.

5.5 Índices Nacionais

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Fonte de Informação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	
Fixing para vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data Cotação 	<ul style="list-style-type: none"> Informar o fixing para vencimento da taxa de juros, somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a taxa é cotada no campo "Denominação".
Tipo de Cotação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<ul style="list-style-type: none"> Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste) que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual (%); data de cotação, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação";
Cotação inicial	<ul style="list-style-type: none"> Cupom Limpo 	<p>A cotação inicial padrão será considerada o último número-índice conhecido em D-1 da data de registro.</p> <p>i. Caso a cotação (número índice) inicial desejada seja diferente da referência padrão, indicá-la exclusivamente no campo "Cupom Limpo".</p> <p>ii. Para operações com início a termo em que o número índice inicial não seja conhecido no momento de registro, informar o mês de referência do número índice inicial no campo "Denominação" (informar o mês de referência no formato M-0, M-1, ..., M-12 do mês de início da operação).</p>
Percentual	<ul style="list-style-type: none"> Percentual 	<p>O percentual destacado do índice utilizado exclusivamente no campo "Percentual" (caso o "Percentual" informado seja sobre a variação diária, informar "percentual diário").</p>
Cupom de Juros/Spread	<ul style="list-style-type: none"> Campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" 	<p>a) a base de cálculo (360 ou 252 do cupom de juros/spread no campo "Denominação";</p>

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
		b) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear) no campo "Denominação".
Limitador Inferior ou Superior	<ul style="list-style-type: none"> Lim. Inferior (Floor) ou Lim. Superior (Cap) 	É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior, este deve ser indicado, na forma de fator arbitrado, exclusivamente no campo "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
Média Aritmética	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Se utilizada a média de cotações: a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.

5.6 Índices Internacionais e Ações Internacionais

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Fonte de Informação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Informar o código do ativo; Fonte de Informação; Bolsa de negociação
Fixing para vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data Cotação 	<ul style="list-style-type: none"> Informar o fixing para vencimento da taxa de juros, somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a taxa é cotada no campo "Denominação".
Tipo de Cotação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<ul style="list-style-type: none"> Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste) que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual (%); data de cotação, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação";
Cotação inicial	<ul style="list-style-type: none"> Cupom Limpo 	<p>A cotação inicial padrão será considerada o último número-índice conhecido em D-1 da data de registro.</p> <p>i. Caso a cotação (número índice) inicial desejada seja diferente da referência padrão, indicá-la exclusivamente no campo "Cupom Limpo".</p>

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
		ii. Para operações com início a termo em que o número índice inicial não seja conhecido no momento de registro, informar o mês de referência do número índice inicial no campo “Denominação” (informar o mês de referência no formato M-0, M-1, ..., M-12 do mês de início da operação).
Variação Quanto	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	No caso de variação Quanto, informar “ausência de variação cambial” ou “variação quanto” no campo “Denominação”.
Variação Cambial	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Se a variação de preços for em reais, informar “variação em reais” no campo “Denominação”. Caso não seja informado será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que o ativo é cotado, com variação cambial.
Percentual	<ul style="list-style-type: none"> Percentual 	O percentual destacado do índice utilizado exclusivamente no campo “Percentual” (caso o “Percentual” informado seja sobre a variação diária, informar “percentual diário”). É permitido utilizar participações de alta e de baixa (em percentual) sobre as curvas. a) Na hipótese de cada curva ter apenas uma participação, esta deve ser informada exclusivamente no campo “Percentual” em “Curvas para Atualização”. b) Caso houver participações de alta e de baixa diferentes sobre as curvas, estas devem ser informadas (em percentual) no campo “Denominação”, e o campo “Percentual” em “Curvas para Atualização” deve ser preenchido como “100”.
Cupom de Juros/Spread	<ul style="list-style-type: none"> Campos “+/-“ e “Juros (% a.a.) 	a) a base de cálculo (360 ou 252 do cupom de juros/spread no campo “Denominação”; b) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear) no campo “Denominação”.

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Limitador Inferior ou Superior	<ul style="list-style-type: none"> Lim. Inferior (Floor) ou Lim. Superior (Cap) 	É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior, este deve ser indicado, na forma de fator arbitrado, exclusivamente no campo “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.
Média Aritmética	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Se utilizada a média de cotações: a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.
Tratamento de Proventos	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>O procedimento para aferição dos contratos levará em consideração a possibilidade de ajustes em função do pagamento de proventos, tais como bonificação, subscrição, juros sobre capital próprio e dividendo.</p> <p>a) As partes deverão indicar os casos em que haja existência (ou não) de cláusulas de proteção contra proventos em dinheiro, e indicar se a proteção contra proventos dar-se-á sobre proventos pagos durante a operação, sobre proventos anunciados e não pagos durante a operação (proventos pagos ex), ou sobre os dois casos.</p> <p>b) Para os proventos em dinheiro, os ajustes serão efetuados pela incorporação dos valores pagos a curva corrigida pela variação do ativo. O montante do provento a ser incorporado levará em consideração a quantidade de ativos passíveis de serem adquiridas na data de início do contrato através do valor base do mesmo ou da quantidade remanescente, para o caso de médias asiáticas, bem como as alterações da quantidade inicial em função de bonificação ou qualquer evento que altere a referida quantidade.</p> <p>i. Informar o indicador de atualização (percentual, taxa de juros e spread) nos casos em que a correção do provento em dinheiro seja por outro indicador diferente da valorização do próprio ativo;</p>

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
		<p>ii. Informar também os casos em que haja cláusula que a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento;</p> <p>ii. Informar também os casos em que haja cláusula que a correção do valor somente ocorrerá a partir data de efetivo pagamento do provento;</p> <p>iii. Informar a taxa utilizada de descapitalização do provento pago ex, se houver este tratamento.</p> <p>iv. Informar em valor o Limitador Inferior ou Superior para os proventos em dinheiro, quando houver.</p> <p>c) Os ajustes relativos à subscrição ou qualquer outro direito de preferência serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela incorporação do valor teórico do direito de subscrição, na curva corrigida pela variação do ativo passível de provento;</p> <p>i. Informar os casos em que não haja previsão de ajuste em função de subscrição ou qualquer outro direito de preferência;</p> <p>d) Para bonificação ou qualquer evento que altere a quantidade de ações os ajustes serão efetuados no primeiro dia ex direito na bolsa, e serão realizados pela correção do preço de referência pelo fator de bonificação.</p>

5.7 Futuros de Índices

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Fonte de Informação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	
Fixing para vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data Cotação 	<ul style="list-style-type: none"> Informar o fixing para vencimento da taxa de juros, somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a taxa é cotada no campo "Denominação".

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Tipo de Cotação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<ul style="list-style-type: none"> Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste) que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual (%); data de cotação, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação";
Cotação inicial	<ul style="list-style-type: none"> Cupom Limpo 	<p>A cotação inicial padrão será considerada o último número-índice conhecido em D-1 da data de registro.</p> <p>i. Caso a cotação (número índice) inicial desejada seja diferente da referência padrão, indicá-la exclusivamente no campo "Cupom Limpo".</p> <p>ii. Para operações com início a termo em que o número índice inicial não seja conhecido no momento de registro, informar o mês de referência do número índice inicial no campo "Denominação" (informar o mês de referência no formato M-0, M-1, ..., M-12 do mês de início da operação).</p>
Percentual	<ul style="list-style-type: none"> Percentual 	O percentual destacado do índice utilizado exclusivamente no campo "Percentual" (caso o "Percentual" informado seja sobre a variação diária, informar "percentual diário").
Cupom de Juros/Spread	<ul style="list-style-type: none"> Campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" 	<p>a) a base de cálculo (360 ou 252 do cupom de juros/spread no campo "Denominação";</p> <p>b) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear) no campo "Denominação".</p>
Limitador Inferior ou Superior	<ul style="list-style-type: none"> Lim. Inferior (Floor) ou Lim. Superior (Cap) 	É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior, este deve ser indicado, na forma de fator arbitrado, exclusivamente no campo "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
Média Aritmética	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>Se utilizada a média de cotações:</p> <p>a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou</p>

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
		b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.

5.8 Ativos

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Fonte de Informação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Informar o código do ativo; Fonte de Informação; Bolsa de negociação
Mês/Ano de Vencimento do papel	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	
Fixing para vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data Cotação 	<ul style="list-style-type: none"> Informar o fixing para vencimento da taxa de juros, somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a taxa é cotada no campo "Denominação".
Tipo de Cotação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<ul style="list-style-type: none"> Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste) que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual (%); data de cotação, indicada exclusivamente no campo "Data de Cotação";
Cotação inicial	<ul style="list-style-type: none"> Cupom Limpo 	A cotação inicial padrão será considerada o último PU/Cota conhecido em D-1 da data de registro.
Cupom de Juros/Spread	<ul style="list-style-type: none"> Campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" 	<p>Informar, quando houver, cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos "+/-" e "Juros (% a.a.)":</p> <p>a) Na base 360 – Ativos Públicos Internacionais e Cotas de Fundos Internacionais;</p> <p>b) Na base 252 – Ativos Privados Nacionais e Cotas Fundos Nacionais</p>
Limitador Inferior ou Superior	<ul style="list-style-type: none"> Lim. Inferior (Floor) ou Lim. Superior (Cap) 	É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior, este deve ser indicado, na forma de fator arbitrado, exclusivamente no campo "Lim. Inferior (Floor)" ou "Lim. Superior (Cap)".
Média Aritmética	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Se utilizada a média de cotações:

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
		a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.
Tratamento de Pagamento de juros do papel	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	a) Caso seja incorporado pagamento de juros do papel à variação do preço do ativo, favor informar no campo “Denominação” b) Se for o caso, informar no campo “Denominação” se o juros incorporados será corrigido pelo %CDI ou CDI + cupom (exemplo: 120% CDI ou CDI+1,00%aa)
Variação de preço	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Caso seja Fluxo de Caixa, informar se será considerada a variação do preço do ativo nos fluxos ou somente no vencimento/amortização.
<i>Exclusivo para Títulos Públicos</i>		
Código ISIN	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	

1) Os indicadores devem ser utilizados somente como fator de correção, contemplando a variação cumulada do PU/Cota do ativo entre a data de início do contrato e o vencimento.

2) Somente será permitida a utilização de ativo cujo PU/Cota tenha divulgação pública, possibilitando a aferição do contrato.

5.9 Cotas de Fundos de Investimentos

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Fonte de Informação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Informar o código do ativo; Fonte de Informação; Bolsa de negociação
Fixing para vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data Cotação 	<ul style="list-style-type: none"> Informar o fixing para vencimento da taxa de juros, somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a taxa é cotada no campo “Denominação”.
Tipo de Cotação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<ul style="list-style-type: none"> Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste) que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual (%); data de cotação, indicada exclusivamente no campo “Data de Cotação”;

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Cotação inicial	<ul style="list-style-type: none"> Cupom Limpo 	<p>A cotação inicial padrão será considerada o último PU/Cota conhecido em D-1 da data de registro.</p> <p>a) Caso a divulgação da cota seja mensal, informar exclusivamente no campo “Denominação” o mês de referência para fixing no formato M-1 ou M-2.</p> <p>b) Caso a divulgação da cota seja semanal, informar exclusivamente no campo “Denominação” a semana de referência para fixing no formato S-1 ou S-2.</p>
Cupom de Juros/Spread	<ul style="list-style-type: none"> Campos “+/-” e “Juros (% a.a.)” 	<p>Informar, quando houver, cupom de juros/spread, exclusivamente nos campos “+/-” e “Juros (% a.a.)”:</p> <p>a) Na base 360 – Ativos Públicos Internacionais e Cotas de Fundos Internacionais;</p> <p>b) Na base 252 – Ativos Privados Nacionais e Cotas Fundos Nacionais</p>
Limitador Inferior ou Superior	<ul style="list-style-type: none"> Lim. Inferior (Floor) ou Lim. Superior (Cap) 	<p>É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior, este deve ser indicado, na forma de fator arbitrado, exclusivamente no campo “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.</p>
Média Aritmética	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>Se utilizada a média de cotações:</p> <p>a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou</p> <p>b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.</p>
Tratamento de Pagamento de juros do papel	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>a) Caso seja incorporado pagamento de juros do papel à variação do preço do ativo, favor informar no campo “Denominação”</p> <p>b) Se for o caso, informar no campo “Denominação” se o juros incorporados será corrigido pelo %CDI ou CDI + cupom (exemplo: 120% CDI ou CDI+1,00%aa)</p>

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Variação de preço	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Caso seja Fluxo de Caixa, informar se será considerada a variação do preço do ativo nos fluxos ou somente no vencimento/amortização.
<i>Exclusivamente para o Fundo de Investimento Imobiliários negociados em Bolsa</i>		
Rendimentos	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<p>a) Caso a curva reflita apenas os rendimentos pagos pelo fundo (desconsiderando a variação do preço da cota), informar “troca somente de rendimentos”;</p> <p>i. Nesse caso, deverá ser informado no campo “Cupom Limpo” o valor de referência do rendimento (e não o valor da cota);</p> <p>ii. O valor de referência da cota deverá ser informado no campo “Denominação”.</p>

5.10 Commodity

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Código do Ativo	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Informar o código do ativo;
Quantidade da commodity	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	
Fonte de Informação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Fonte de Informação; Bolsa de negociação
Fixing para vencimento	<ul style="list-style-type: none"> Data Cotação 	<ul style="list-style-type: none"> Informar o fixing para vencimento da taxa de juros, somente quando este for diferente do fixing da moeda em que a commodity é cotada no campo “Denominação”.
Tipo de Cotação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	<ul style="list-style-type: none"> Tipo de cotação (Média, Máxima, Mínima, Abertura, Fechamento, Ajuste) que será utilizada para a cotação de fixing e para a cotação inicial, se essa for registrada em percentual (%); data de cotação, indicada exclusivamente no campo “Data de Cotação”;
Cotação inicial	<ul style="list-style-type: none"> Cupom Limpo 	<p>A cotação inicial padrão será considerada o último número-índice conhecido em D-1 da data de registro.</p> <p>i. Caso a cotação (número índice) inicial desejada seja diferente da referência padrão, indicá-la exclusivamente no campo “Cupom Limpo”.</p>

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
		ii. Para operações com início a termo em que o número índice inicial não seja conhecido no momento de registro, informar o mês de referência do número índice inicial no campo "Denominação"
Variação Quanto	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	No caso de variação Quanto, informar "ausência de variação cambial" ou "variação quanto" no campo "Denominação".
Variação Cambial	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Se a variação de preços for em reais, informar "variação em reais" no campo "Denominação". Caso não seja informado será considerado que a variação de preços será calculada na moeda em que o ativo é cotado, com variação cambial.
Percentual	<ul style="list-style-type: none"> Percentual 	O percentual destacado do índice utilizado exclusivamente no campo "Percentual" (caso o "Percentual" informado seja sobre a variação diária, informar "percentual diário"). É permitido utilizar participações de alta e de baixa (em percentual) sobre as curvas. a) Na hipótese de cada curva ter apenas uma participação, esta deve ser informada exclusivamente no campo "Percentual" em "Curvas para Atualização". b) Caso houver participações de alta e de baixa diferentes sobre as curvas, estas devem ser informadas (em percentual) no campo "Denominação", e o campo "Percentual" em "Curvas para Atualização" deve ser preenchido como "100".
Cupom de Juros/Spread	<ul style="list-style-type: none"> Campos "+/-" e "Juros (% a.a.)" 	a) a base de cálculo (360 ou 252 do cupom de juros/spread no campo "Denominação"; b) Metodologia de cálculo (ex: exponencial ou linear) no campo "Denominação".

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
Limitador Inferior ou Superior	<ul style="list-style-type: none"> Lim. Inferior (Floor) ou Lim. Superior (Cap) 	É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas. Na hipótese de ser utilizado Limitador Inferior ou Superior, este deve ser indicado, na forma de fator arbitrado, exclusivamente no campo “Lim. Inferior (Floor)” ou “Lim. Superior (Cap)”.
Média Aritmética	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Se utilizada a média de cotações: a) informar as datas das cotações para média aritmética simples; ou b) informar as datas das cotações e seus respectivos pesos para média aritmética ponderada.
Exclusivo para as curvas ATR Total – Consecana, ATR Componente Açúcar e ATR Componente Etanol		
Tipo de ATR	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Informar o tipo de ATR: Mensal ou Acumulado; c) Se a curva ATR Componente Açúcar ou ATR Componente Etanol, deve-se informar: i. Safra e mês de referência para verificação do ATR; * A metodologia de apuração do preço final dessas curvas está disponível no Caderno de Fórmulas de Swap – Seção VCP 4.7.
Mês de Referência	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Informar mês de referência
Exclusivo para Energia Elétrica PLD - CCEE		
Tipo de Cotação	<ul style="list-style-type: none"> Denominação 	Indicar o tipo de cotação (semanal ou média mensal) para o fixing (caso seja semanal, usar S-0, S-1, S-2, etc.; caso seja mensal, usar M0, M-1, M-2, etc.), exclusivamente no campo “Denominação”.5) Indicar a Fonte de Informação, o Submercado (SE/CO, S, NE ou N) e o Patamar de Carga (Pesada, Média ou Leve – para o tipo de cotação média mensal, essa informação não é necessária), exclusivamente no campo “Denominação”.

Informações necessárias	Campo(s)	Observação
		<p>i. Informar as semanas (no formato S-0; S-1, etc.) que se quer utilizar para o cálculo da média aritmética (informar também os respectivos pesos, no caso de média aritmética ponderada); ii. Informar, se houver, limitador inferior e/ou superior sobre a média calculada dos preços (podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial). b) Se o tipo de cotação for mensal: i. Informar o(s) mês (es) (no formato M-0; M-1, etc.) que se quer utilizar para o cálculo da média aritmética (informar também os respectivos pesos, no caso de média aritmética ponderada); ii. Informar, se houver, limitador inferior e/ou superior sobre a média calculada dos preços (podendo ser em valor ou percentual da cotação inicial).</p>

Observações Gerais:

- 1) As Informações necessárias que não estão discriminadas com preenchimento exclusivo nos campos específicos do registro do contrato deverão ser informadas, conforme determinadas acima, no campo Denominação;
- 2) Nas tabelas acima, quando o termo **Vencimento** for mencionado nos campos Critério de Cálculo de PU ou de Fator, está se referindo a:
 - a) **Pagamento Final** – vencimento do contrato; e
 - b) **Fluxo de Caixa** – evento de juros/amortização.
- 3) No caso de contrato no qual o juros incide sobre o valor base remanescente, originado de um evento de amortização que não gera financeiro, as duas curvas deverão ser registradas como VCP e essa informação constar no campo “Denominação” junto as demais características específicas de cada curva.
- 4) Para os contratos registrados com VCP dos grupos “Ativos” ou “Ações”, será considerado pela B3, por ocasião de antecipação, que a quantidade antecipada é dada pela resultante da divisão do valor base antecipado pelo valor inicial do ativo subjacente em Reais.

6 REGISTRO – ESTRATÉGIA

Esta função possibilita aos Participantes informarem os dados de determinada Estratégia de Derivativos viabilizada através dos instrumentos Swap ou Opção Flexível.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Informações de Derivativos > Lançamentos > Registro de Dados de Estratégia

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZO: Conta 00 x Conta 00 – O registro deve ser realizado em D0 da contratação
Conta 00 x Conta 10 ou 20 – É permitido o registro em até D+2 da contratação do derivativo

Observações: 1 - A Estratégia a ser vinculada ao Contrato deve ser primeiramente autorizada e habilitada pela B3 para o Participante que a requisitou; e

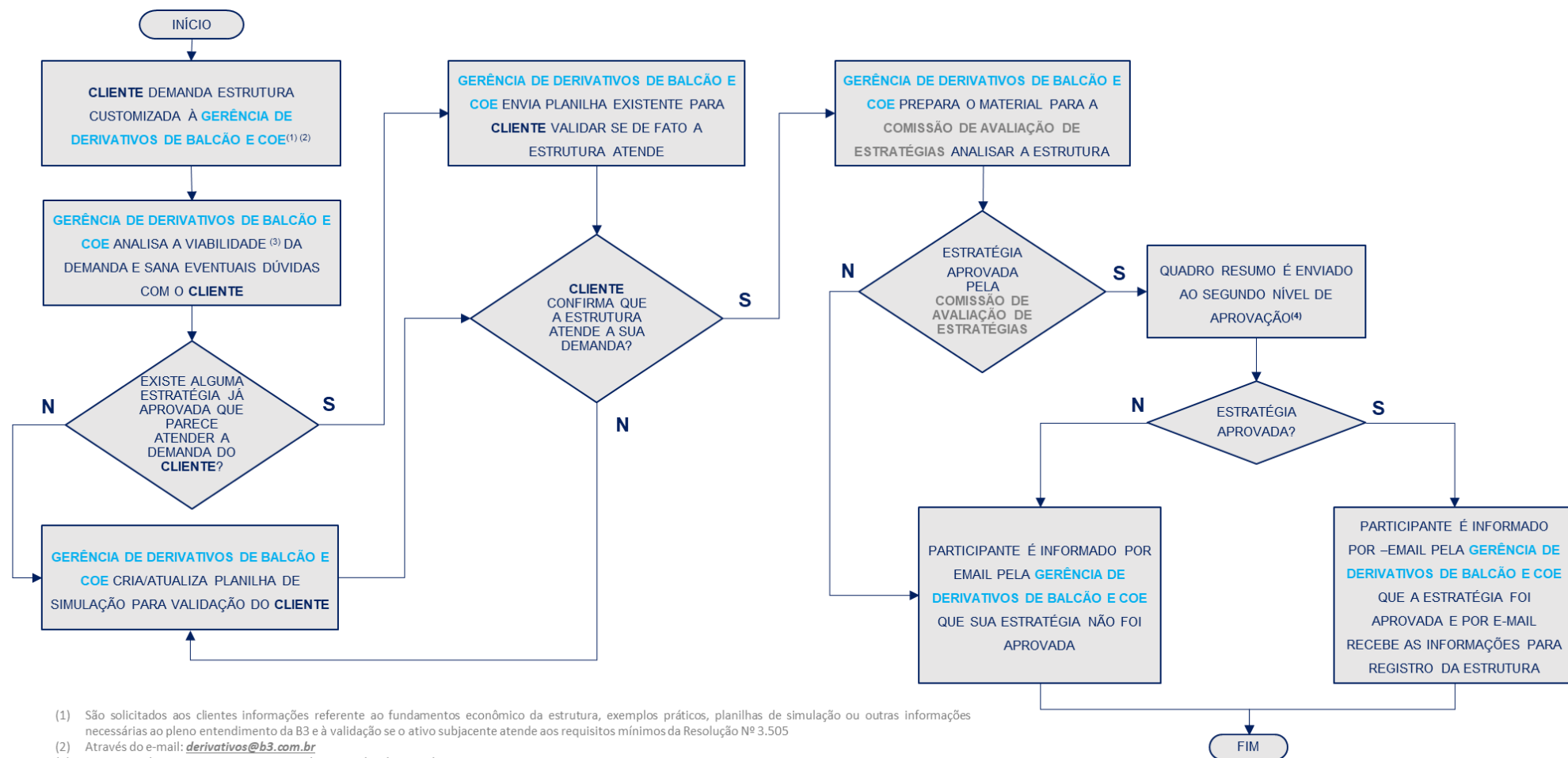
2 - O participante, após registrar o Contrato, com a indicação do Código da Estratégia, no Módulo de Swap ou Opção Flexível, deve informar no MID, na função Registro de Dados de Estratégia os respectivos dados da Estratégia. A informação dos dados deve ser realizada, obrigatoriamente, no mesmo dia do registro do contrato.

Tela de Registro de Dados de Estratégia

Filtro Registro Dados de Estratégia	
Código do Contrato	<input type="text"/>
Ação	INCLUIR ▼
Pesquisar	Limpar Campos Desistir

Para mais informações consultar [Manual de Operações](#) > MID-
Módulo de Informações de Derivativos

FLUXO DE AVALIAÇÃO DE ESTRATÉGIAS



7 ATUALIZAÇÃO DE PU/FATOR

Essa funcionalidade é utilizada para atualização dos contratos de Swap nas seguintes situações:

- Contratos com curvas do tipo VCP;
- Contratos de Libor com variação cambial expressa em **outras moedas**;
- Contratos em que é necessário indicar a variação cambial expressa em **outras moedas** da TJMI;
- Contratos a Termo para indicação da cotação, sendo válido apenas nos lançamentos realizados na data de registro até D-1 do início do contrato; e
- Contratos de Moedas em que é necessário indicar o Cupom Limpo.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Atualização PU/Fator

Arquivo: Registro de Atualização de PU/Fator

Mensageria: CTP9015 –Lançamento de PU/FATOR de Contrato de Derivativo

PRAZO: Entre D+1 do Registro e até D-1 do próximo evento

Tela Filtro Atualização PU/Fator

Atualização PU/FATOR	
Código do Contrato	<input type="text" value="20L00028278"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>

O Participante deve inserir o código do contrato e clicar no botão **Pesquisar** para acessar o contrato no qual deseja atualizar.

Tela de Atualização PU/Fator

Atualização PU/FATOR	
Código do Contrato 22G00294033	Ponta 1 (Nome Simplificado) KEBBC
Ponta 1 07570.00-7	Ponta 2 (Nome Simplificado) ANDBANKBM
Ponta 2 70180.00-8	Tipo de Atualização <input type="text" value="v"/>
Papel PONTA 1	Data PU/FATOR <input type="text" value=""/> <input type="text" value=""/> <input type="text" value=""/>
Curva <input type="text" value="v"/>	PU <input type="text" value=""/> <input type="text" value=""/>
Meu Número <input type="text" value=""/>	FATOR <input type="text" value=""/> <input type="text" value=""/>
<input type="button" value="Enviar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Descrição dos Campos da Tela de Atualização de PU/Fator

INFORMAÇÕES ADICIONAIS	CONSULTAS	INTERMEDIACÃO	EXERCÍCIO DA OPÇÃO	ALTERAÇÃO	CESSÃO	ANTECIPAÇÃO	FUNCIONALIDADES	REGISTRO	SUMÁRIO
------------------------	-----------	---------------	--------------------	-----------	--------	-------------	-----------------	----------	---------

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Curva	Indica qual ponta está ativa na curva a ser atualizada.	Obrigatório	Campo com as opções: Ponta 1 ou Ponta 2.
Meu número	Número atribuído à operação.	Obrigatório	Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.
Tipo de atualização	Define a atualização a ser efetuada.	Obrigatório	Campo com as opções: Contrato a Termo; Cupom Limpo; Curva VCP; Libor - Variação Cambial Outros ou TJMI - Variação Cambial Outros.
Data PU / Fator	Data acordada entre as partes em que ocorrerá a atualização do PU/Fator	Obrigatório	Campo tipo data: DD/MM/AAAA
PU	<p>Preço ou cotação para atualizar a curva definida no campo Curva.</p> <p>Pode ser informado o PU ou Fator para atualização.</p>	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>A atualização informada é utilizada como “PU Final” na atualização do Valor Base (para mais detalhes acessar o Caderno de Fórmulas Swap – Curvas VCP)</p> <p>Para o lançamento de:</p> <ul style="list-style-type: none"> •Pu/Fator de Curva VCP = informar com até 10 inteiros e 8 decimais •Cotação Cupom Limpo = informar com até 3 inteiros e 4 decimais; •Libor - Variação cambial Outros e TJMI - variação cambial Outros = informar com até 3 inteiros e 4 decimais.

Fator	Fator para atualização da curva.	Condicional	Pode ser informado o PU ou Fator para atualização. Campo Tipo Numérico: 2 inteiros e 8 oito casas decimais.
--------------	----------------------------------	-------------	--

Tela confirmação de Atualização PU/FATOR

Atualização PU/FATOR	
Código do Contrato 20L00028278	
Ponta 1 05000.00-5	Ponta 1 (Nome Simplificado) RIOBM
Ponta 2 10020.00-1	Ponta 2 (Nome Simplificado) LEMEBM
Papel PONTA 1	Tipo de Atualização CURVA VCP
Curva PONTA 1	Data PU/FATOR 25/07/2022
Meu Número 1	Data de Início 27/05/2014
Valor Curva 1 7.000,00	Data de Vencimento 06/06/2023
Valor Curva 2 6.600,00	PU 70,00000000
Valor Financeiro 400,00	FATOR
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos Campos da Tela de Confirmação da Atualização de PU/Fator

Campo	Descrição
Código do Contrato	Código do contrato em que está sendo realizada a atualização de PU/Fator
Ponta 1	Ponta 1 do contrato
Ponta 2	Ponta 2 do contrato
Papel	Papel que está realizando a atualização de PU/Fator
Curva	Curva em que está sendo realizada a atualização de PU/Fator
Meu número	Número atribuído pelo participante
Valor Curva 1	Valor da Curva 1 (em reais) atualizada até a data de lançamento do PU/Fator. Caso seja a curva em que está sendo realizada a atualização de PU/Fator, o valor calculado já é sensibilizado pelo lançamento.
Valor Curva 2	Valor da Curva 2 (em reais) atualizada até a data de lançamento do PU/Fator. Caso seja a curva em que está sendo realizada a atualização de PU/Fator, o valor calculado já é sensibilizado pelo lançamento.

Campo	Descrição
Valor Financeiro	Valor Financeiro da diferença das curvas 1 e 2. Caso a atualização de PU/Fator seja realizada indicando uma data de evento (vencimento ou fluxo intermediário), o valor financeiro será o valor gerado para liquidação naquela data.
Ponta 1 (Nome Simplificado)	Nome simplificado da Ponta 1 do contrato
Ponta 2 (Nome Simplificado)	Nome simplificado da Ponta 2 do contrato
Tipo de Atualização	Tipo de atualização que está sendo realizada no contrato
Data PU/Fator	Data do PU/Fator
Data de Inicio	Data de Início do contrato em que está sendo realizada a atualização de PU/Fator
Data de Vencimento	Data de Vencimento do contrato em que está sendo realizada a atualização de PU/Fator
PU	Valor do PU informado na atualização
Fator	Valor do Fator informado na atualização

Obs.: Para contratos a mercado, é possível realizar o *matching* do lançamento de PU através da função de Manutenção de Operações Pendentes (*Operações > Lançamentos > Manutenção de Operações Pendentes*).

Nesses cenários, o **valor financeiro atualizado pelo lançamento do PU** também é apresentado na **tela de lançamento e confirmação** do PU.

Informações sobre grades e cancelamento do lançamento de PU:

Na atualização das curvas do contrato, se no dia do evento, o PU/Fator for informado até o fechamento da grade **Bilateral**, o evento é gerado na modalidade de liquidação **Bilateral**. Obedecendo ao horário de fechamento da grade, o Participante pode lançar quantas vezes forem necessárias e é considerado sempre o último PU/Fator informado. **Após o fechamento dessa grade, o PU/Fator informado não pode ser cancelado.**

No caso de contrato entre um Participante e conta de cliente 1 ou 2 ou entre contas de clientes 1 do mesmo Participante, se no dia do evento o PU/Fator for informado até o fechamento da grade **Sem Liquidação no STR**, o evento é gerado nessa modalidade. Antes de lançar um novo PU/Fator, o Participante deve excluir o último lançamento efetuado utilizando a função **Cancelamento de operações** do produto **Operações**.

Após o fechamento da grade bilateral, o evento que estiver pendente de lançamento de PU/Fator assume a modalidade **Bruta STR**. Se o PU/Fator for informado durante a grade **Bruta STR** e houver necessidade de uma nova atualização, o Participante deve excluir o último lançamento efetuado, utilizando a função **Cancelamento de operações**, acima mencionada e em seguida, efetuar um novo lançamento.

Caso o valor financeiro do evento seja zero, independente das partes, do horário e dos parâmetros, ele assume a modalidade **Sem modalidade**.

A Atualização de Cupom Limpo - Curva Dólar, não gera pendência, pois caso não seja informada a cotação, o sistema utiliza a cotação PTAX800, ponta de venda.

Para efetuar a atualização da variação cambial expressa em **outras moedas** com curva **TJMI**, o Participante deve informar, primeiramente, o registro dessa curva na função **Registro de TJMI**.

Informação obrigatória de dados adicionais

Essa função também deve ser utilizada para cumprimento do disposto no Comunicado B3 nº 016/2017 de 13 de março de 2017, que estabelece a obrigatoriedade do lançamento de PU/Fator para as curvas que necessitam dessa informação para atualização do contrato.

A ausência de lançamento **no último dia de cada mês**, caracteriza a inadimplência regulamentar do registrador do Swap, conforme comunicado citado acima.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

8 REGISTRO – TAXAS DE JUROS DO MERCADO INTERNACIONAL

Através dessa função, o Participante poderá informar a Taxa de Juros Mercado Internacional (TJMI), que foi utilizada por uma das partes envolvidas como parâmetro, em determinada operação.

Quando for utilizada a curva TJMI com variação cambial expressa em outras moedas, o Participante deve informar a TJMI nessa função e depois efetuar a atualização da variação cambial na função Atualização de PU/Fator.

Se no ato do registro do contrato for escolhida a opção: somente na 1ª troca de fluxo, o contrato fica com status Pendente de TJMI. Do 2ª evento em diante será necessária a atualização da taxa.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Taxa de Juros Mercado Internacional

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZO: Entre D+1 do Registro e até D-1 do próximo evento

Tela Filtro Registro de TJMI

Registro de Taxas de Juros Mercado Internacional	
Código do Contrato	<input type="text" value="08B00000748"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>

O Participante deve inserir o código do contrato e clicar no botão **Pesquisar** para acessar o contrato no qual se deseja registrar Taxa de Juros Mercado Internacional.

Tela de Registro de TJMI

Registro de Taxas de Juros Mercado Internacional	
Código do Contrato	08A00002744
Papel	PONTA 1
Ponta 1	10020.00-1
Informar Fluxo Para	PONTA 1
Ponta 2	10020.10-4
Meu Número	<input type="text" value="45"/>
Ponta 1 (Nome Simplificado)	LEMEBM
Data Fluxo	<input type="text" value="22/01/2009"/>
Ponta 2 (Nome Simplificado)	LEMEBM
Taxa Juros	<input type="text" value="3"/> , <input type="text" value="62"/>
Ponta 2 (CPF/CNPJ)	094.261.197-79
<input type="button" value="Enviar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Na atualização das curvas do contrato, se no dia do evento, a TJMI for informada até o fechamento da grade **Bilateral**, o evento é gerado na modalidade de liquidação **Bilateral**. Obedecendo ao horário de fechamento da grade, o Participante pode registrar quantas vezes forem necessárias e é considerada sempre a última TJMI informada. Após o fechamento dessa grade, a TJMI informada não poderá ser cancelada.

No caso de contrato entre um Participante e conta de cliente 1 ou 2 ou entre contas de clientes 1 do mesmo Participante, se no dia do evento, a TJMI for informada até o fechamento da grade **Sem Liquidação no STR**, o evento é gerado nessa modalidade. Antes de registrar uma nova TJMI, o Participante deve excluir o último registro feito utilizando a função **Cancelamento de operações** do produto **Operações**. Após o fechamento da grade bilateral, o evento que estiver pendente de registro de TJMI assume a modalidade **Bruta STR**. Se a TJMI for registrada durante a grade **Bruta STR** e houver necessidade de um novo, o Participante deve excluir o último registro efetuado, utilizando a função **Cancelamento de operações**, acima mencionada e em seguida, efetuar um novo.

Descrição dos Campos da Tela de Registro de TJMI

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu número	Número atribuído à operação.	Obrigatório	Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.
Data Fluxo	Data do evento	Obrigatório	Caixa de Seleção contendo todas as datas de eventos de TJMI do contrato.
Taxa juros	Campo de informação da TJMI para a data selecionada na Caixa de Seleção do campo Data Fluxo.	Obrigatório	

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

CONSULTAS

INTERMEDIACÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

ALTERAÇÃO

CESSÃO

ANTECIPAÇÃO

FUNCIONALIDADES

REGISTRO

SUMÁRIO

9 REGISTRO – FLUXO DE DATAS DE VERIFICAÇÃO

Esta função é utilizada quando for aplicada média asiática (simples ou ponderada) para o cálculo do valor financeiro da operação.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Fluxo de Datas de Verificação

Arquivo:

4.2.6. Registro de Fluxo de Data de Verificação

Mensageria: Não disponível

PRAZO: O registro da datas deve ser realizado em D0 do registro do contrato.

Observação: Existe a limitação de 180 datas de eventos por registro, incluindo o resgate.

Tela de Registro de Data de Verificação

Registro de Data de Verificação	
Parte	<input type="text"/>
ContraParte	<input type="text"/>
Meu Número (Oper Original)	<input type="text"/>
Quantidade de Datas de Verificação Parte	<input type="text"/>
Quantidade de Datas de Verificação ContraParte	<input type="text"/>
<input type="button" value="Confirmar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte	Código da conta que identifica o membro que está acessando o sistema e, consequentemente, registrando o contrato	Obrigatório	
Contraparte	Código da conta que identifica o membro com quem é efetuado o contrato.	Obrigatório	
Meu número (Oper Original)	Número atribuído à operação.	Obrigatório	Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.
Quantidade de Datas de Verificação Parte	Quantidade de Datas de Verificação Parte.	Condicional	Utilizada somente quando for aplicada média asiática. Informado com até 3 (três) inteiros.
Quantidade de Datas de Verificação Contraparte	Quantidade de Datas de Verificação Contraparte.	Condicional	Utilizada somente quando for aplicada média asiática (simples ou ponderada). Informado com até 3 (três) inteiros.

10 REGISTRO – PAGAMENTO DE PRÊMIO

Função para Registro de agenda de pagamentos de prêmio, onde o Participante informa a quantidade de Prêmios, as datas de pagamento e seus valores. Em cada data de evento, deve ser indicado no campo Titular qual das pontas envolvidas no contrato é responsável pelo pagamento do prêmio.

Através desta função o Participante informa a quantidade de prêmios e a forma como serão pagos em um determinado contrato.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Pagamento de Prêmio

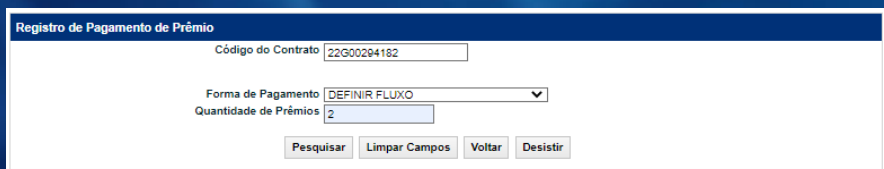
Arquivo:

4.2.9. Registro de Prêmio

Mensageria: Não disponível

PRAZO: O registro da datas deve ser realizado em D0 do registro do contrato.

Tela Filtro Registro de Pagamento de Prêmio



Descrição dos Campos da Tela Filtro Registro de Pagamento de Prêmio

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Código do Contrato	Código do contrato registrado na B3	Obrigatório	Código do Contrato a ser pesquisado.
Forma de Pagamento	Campo para indicação do fluxo do pagamento de prêmio.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Data de Registro, Data de Início, Data de Vencimento e Definir Fluxo.
Quantidade de Prêmio	Número de prêmios a serem agendados pelo participante.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente quando for escolhida a forma de pagamento Definir Fluxo.</p> <p>Tem um limite de 120 datas de prêmio e a quantidade de datas de pagamento deve ser inferior a quantidade de dias úteis do contrato.</p>

Tela Registro de Pagamento de Prêmio

Registro de Pagamento de Prêmio		
Contrato		
Código do Contrato 22G00294187	Data Início 15/07/2022	Data Vencimento 20/07/2022
Ponta 1 07570.00-7	Ponta 2 70180.00-8	
Ponta 1 (Nome Simplificado) KEBBC	Ponta 2 (Nome Simplificado) ANDBANKBM	Meu Número <input type="text"/>
Curva Ponta 1 DI	Curva Ponta 2 PREFIXADO 252D	Papel PONTA 1
Eventos de Prêmio		
Data 15 / 07 / 2022	Valor do Prêmio 500 , <input type="text"/>	Titular PONTA 1 ▼
Data 20 / 07 / 2022	Valor do Prêmio 800 , 00	Titular PONTA 1 ▼
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Descrição dos Campos da Tela Registro

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu Número	Número interno de cada participante identificando o lançamento.	Obrigatório	Número atribuído a operação de registro de fluxo de caixa não constante.
Data	Data em que ocorrerá o pagamento do prêmio.	Obrigatório	Tipo: Data (DDMMAAAA)
Valor do Prêmio	Informar o valor do prêmio.	Obrigatório	Tipo Numérico: 5(cinco) inteiros e 4(quatro) decimais.
Titular	Indicar a ponta que pagará o prêmio.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Ponta1 ou Ponta2 .

Liquidação Financeira de Prêmios

Liquidação de prêmio na data de registro:

Quando o registro do contrato for efetuado até o horário de encerramento da grade CTP12: Registro de Operações - Bilateral realizada na modalidade de Liquidação Bilateral; e

Quando o registro do contrato for efetuado após o encerramento do horário da grade CTP12, acima mencionada, realizada na modalidade de Liquidação Bruta STR.

Liquidação de prêmio em data posterior a do registro:

Realizada na Modalidade de Liquidação Bilateral

Liquidação de prêmio fora do âmbito da B3 (Sem Modalidade de Liquidação), independente da data de pagamento:

Quando se tratar de contratos entre o Participante e conta de cliente do tipo 1 ou 2;

Ou entre contas de clientes 1 de um mesmo Participante

11 REGISTRO – PARAMÊTROS PARA DISPARO DE RESET

Caso o Participante não tenha informado os parâmetros para disparo de Reset no momento do Registro de Contrato com Pagamento Final, ele pode informar através dessa função.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Arquivo:

4.2.14. Registro de Reset

Mensageria: Não disponível

PRAZO: Até D-1 do evento.

Observação: Se no registro de um determinado contrato de Swap o Participante informar que há Reset, mas não informá-lo até o horário de fechamento da grade Sem Modalidade neste mesmo dia, o registro deste contrato é cancelado.

Tela Filtro Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Código do Contrato

Forma de Disparo ▼

Quantidade de Datas

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Descrição dos Campos da Tela Filtro Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Código do Contrato		Obrigatório	Campo para indicação do contrato.
Forma de Disparo	Indica a forma de disparo do Reset.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Data, Valor, Data ou Valor e Data e Valor.
Quantidade de Datas		Condicional	Se forma de Disparo envolver o parâmetro Data com limitação de 120 datas de eventos por registro. Se indicado no campo Forma de Disparo a opção: Data, Data e Valor ou Data ou Valor, aqui deve ser informado o número de datas nas quais ocorrerá possibilidade de Reset.

Formas de Disparo

Por Data:

O ajuste ocorre quando chegar à data (dia útil) informada pelo Participante. O Participante, ao escolher esta opção, deve determinar as datas específicas em que ocorrerão os ajustes. Formato: DD/MM/AAAA.

Por Valor:

Ao determinar um valor o Participante está indicando um limite máximo para uma possível diferença financeira entre as curvas do contrato em questão, marcadas a mercado. Dessa forma, a partir da informação de marcação a mercado dada pelo contratante, o sistema apura e compara o resultado com o valor informado neste campo. Se o diferencial das curvas marcadas a mercado, informado pelo Participante, for maior que o valor informado neste parâmetro, ocorre o disparo. Formato com 10 (dez) inteiros e 2 (duas) casas decimais.

Por Data ou Valor:

Nesse tipo de disparo, um dos dois parâmetros deve ser acionado para que ocorra o disparo.

Podem ocorrer vários disparos por valor, antes ou após as datas informadas, tantas quantas forem as informações das curvas marcadas a mercado e houver ou não a liquidação financeira de ajuste e por conseguinte alteração dos parâmetros de disparo.

Por Data e Valor:

Esta opção permite a utilização conjunta dos parâmetros. Sua utilização consiste em acionar o ajuste a partir de data(s) específica(s) e a partir de um valor. Na data especificada o valor deve ser ultrapassado para ocorrer o disparo.

Tela Registro de Parâmetros para Disparo de Reset

Registro de Parâmetros para Disparo de Reset		
Contrato		
Código do Contrato 14K00079320	Data Início 14/11/2014	Data Vencimento 14/12/2014
Ponta 1 05000.00-5	Ponta 2 10020.00-1	
Ponta 1 (Nome Simplificado) RIOBM	Ponta 2 (Nome Simplificado) LEMEBM	Meu Número 3456
Curva Ponta 1 DI	Curva Ponta 2 DOLAR DOS EUA	Papel PONTA 1
Permissibilidade para Registros		
Curvas Marcadas a Mercado PONTA 1	Reset PONTA 1	
Condição de Disparo		
Forma de Disparo DATA OU VALOR	Credor PONTA 1	
Disparo por Valor		
Valor 1000 ,		
Datas de Disparo		
21 / 11 / 2014		
28 / 11 / 2014		

Selecionando a opção: **PONTA 1** ou **PONTA 2**, o valor informado para ajuste não tem necessidade de duplo comando para matching, já optando por **AMBOS**, há a necessidade do mesmo.

Uma vez indicados os responsáveis por informar a Curva Marcada a Mercado, Reset e Credor, esses não poderão mais ser modificados. Serão os mesmos até o fim do contrato.

Descrição dos Campos da Tela de Registro

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu Número	Número interno de cada participante identificando o lançamento.	Obrigatório	Número atribuído a operação de registro de fluxo de caixa não constante.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Papel	Indica a ponta que está efetuando a atualização.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Ponta1 ou Ponta2 .
Curvas Marcadas a Mercado	Indica qual dos Participantes deve informar as Curvas Marcadas a Mercado.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: AMBOS, PONTA 1 ou PONTA 2 .
Reset	Indica qual dos Participantes deve registrar o Reset.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: AMBOS, PONTA 1 ou PONTA 2 .
Credor	Indica a condição de disparo de Reset. A ponta indicada define quem pode ser credor na liquidação financeira do Reset.	Obrigatório	Se após a informação das Curvas Marcadas a Mercado, a ponta credora não for a indicada, o Reset não é disparado. Caixa de Seleção com as opções: PONTA 1 OU PONTA 2, PONTA 1 ou PONTA 2 .
Valor	Parâmetro que define o valor limite do diferencial das Curvas Marcadas a Mercado.	Obrigatório	A diferença das Curvas Marcadas a Mercado deve ser maior que o parâmetro indicado para ocorrer o disparo do Reset. Tipo: Numérico (10(dez) inteiros e 2(dois) decimais).
Datas de Disparo	Datas com possibilidade de ocorrer Reset.	Obrigatório	Formato: DD/MM/AAAAA.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

CONSULTAS

INTERMEDIACÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

ALTERAÇÃO

CESSÃO

ANTECIPAÇÃO

FUNCIONALIDADES

REGISTRO

SUMÁRIO

12 REGISTRO DE RESET

Através desta função, o Participante pode registrar, após o disparo, o Reset de um contrato pagamento final que tenha esta previsão, indicando se há ou não liquidação financeira. Havendo liquidação, o Participante pode definir se há ou não continuidade do contrato e alterações decorrentes do Reset.

Essa função só pode ser utilizada quando for disparado o Reset, esta condição pode ser consultada em:

- Módulo Operações / Menu Consulta / itens Operações / Operações Pendentes; ou
- Módulo Swap / Consulta / Histórico de Curvas Marcadas a Mercado.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Reset

Arquivo:

4.2.12. Registro de Reset

Mensageria: Não disponível

PRAZO: A partir de D+1 do registro do contrato.

Tela Filtro Registro de Reset

Registro de Reset

Código do Contrato

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Nesta tela o Participante deve informar o código do contrato objeto de registro de Reset.

Tela Registro de Reset

Contrato		
Código do Contrato	Data Inicio	Data Vencimento
14K00080928	17/11/2014	21/11/2014
Ponta 1	Ponta 2	
05000.00-5	05000.10-8	
Ponta 1 (Nome Simplificado)	Ponta 2 (Nome Simplificado)	Meu Número
RIOBM	RIOBM	<input type="text" value="12478"/>
Curva Ponta 1	Curva Ponta 2	Papel
DI	DOLAR DOS EUA	PONTA 1

Curvas Marcadas a Mercado	
Ponta 1	Ponta 2
1,01000000	1,02000000
Diferencial das Curvas	Credor
10,00	PONTA 2
Liquidação do Reset	Continuidade do Contrato
<input type="text" value="SIM"/>	<input type="text" value="SIM"/>

Alteração no Contrato		
Altera Contrato		
<input type="text" value="SIM"/>		
Altera Parâmetros Reset	Forma de Disparo	Quantidade Datas Reset
<input type="text" value="NAO"/>	<input type="text" value="VALOR"/>	<input type="text" value="1"/>

Opções para fixar o momento do Reset:

1. **Valor:** Em R\$. Ocorre a possibilidade de ajuste se o valor a mercado do Swap (diferença entre as curvas marcadas a mercado) for superior ao valor do limite informado.
2. **Data:** Ocorre a possibilidade de ajuste em determinadas datas.
3. **Data e Valor:** Ocorre a possibilidade de ajuste em determinadas datas se o valor do diferencial entre as curvas marcadas a mercado do Swap for superior ao valor do limite informado.
4. **Data ou Valor:** Ocorre a possibilidade de ajuste em determinadas datas ou se o valor a mercado do Swap for superior ao valor do limite informado, o que ocorrer primeiro. Os ajustes ou Resets permitem aos contratantes desta modalidade de Swap avaliar periodicamente a evolução de cada uma das curvas de atualização do contrato, confrontando-as com as expectativas futuras de taxa de juros (marcação a mercado de taxa de juros futura).

Na ocorrência de registro de Reset com liquidação financeira e:

1. **Continuidade do Contrato** - o sistema utiliza para atualização da curva contábil, da data do Reset em diante, o valor base atualizado.
2. **Não Continuidade do Contrato** - o sistema antecipa totalmente o contrato em decorrência do reset.
3. Selecionando **NÃO, para Liquidação do Reset**, obrigatoriamente no campo **Continuidade do Contrato** deve ser indicada a opção **SIM**, e neste caso o sistema utilizará, para atualização da curva contábil, a data de emissão ou a data do último reset liquidado em diante.

Se for selecionada a opção **SIM**, para os campos **Liquidação do Reset** e **Altera Contrato**, a liquidação financeira é realizada, nas modalidades: **Bruta STR**, **Bilateral** ou **Sem Modalidade**, após a alteração do contrato;

Descrição dos Campos de Tela Registro

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu Número	Número interno de cada participante identificando o registro.	Obrigatório	Número atribuído a operação de registro de Reset.
Papel		Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções Ponta1 , Ponta2 .

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Liquidação de Reset	Informa se existe a liquidação financeira ou não do ajuste periódico.	Obrigatório	<p>Optando pela liquidação do ajuste, a modalidade de liquidação pode ser Bilateral ou Bruta, conforme horário da janela de liquidação ou Sem modalidade.</p> <p>Optando por não liquidar o contrato, não é permitida qualquer alteração nos parâmetros.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções Sim e Não.</p>
Continuidade de Contrato	Nesse campo, o participante pode optar pela continuação do contrato até o próximo ajuste, vencimento ou antecipação total decorrente do reset.	Obrigatório	<p>Optando por liquidá-lo, a modalidade de liquidação pode ser Bilateral ou Bruta, conforme horário da janela de liquidação ou Sem modalidade.</p> <p>Optando por não dar continuidade, não é permitida qualquer alteração nos parâmetros do contrato.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções Sim e Não.</p>
Altera Contrato	Informa se existirá alteração ou não no contrato decorrente do Reset.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório se a opção Continuidade de Contrato = SIM.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções Sim e Não.</p>
Altera Parâmetros Reset	Informa se existirá alteração nos parâmetros de Reset.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório se a opção Altera Contrato = SIM.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções Sim e Não.</p>
Forma de Disparo	Nesse campo é escolhida a forma de disparo do ajuste periódico.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório se a opção Altera Parâmetros = SIM.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções Data, Valor, Data e Valor e Data ou Valor.</p>

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Quantidade Datas de Reset	Nesse campo deve ser informado o número de datas, nas quais ocorrerá o Reset.	Condicional	Se indicado no campo Forma de Disparo a opção: Data , Data e Valor ou Data ou Valor .

13 REGISTRO – REGISTRO DE CURVAS

MARCADAS A MERCADO

Nessa função o Participante pode informar diariamente as Curvas Marcadas a Mercado (MTM - Mark-To-Market) de cada contrato com Reset registrado por ele. Com isso possibilita que o sistema consiga apurar o diferencial das Curvas Marcadas a Mercado e se o contrato ultrapassou o valor limite quando indicado. Se o Participante não informar essas curvas de marcação o contrato não tem o ajuste acionado.

Não é permitida a alteração das informações prestadas se já tiver ocorrido o ajuste utilizando os parâmetros anteriormente informados. Nesta condição, o Participante deve optar por não liquidá-lo e somente após este procedimento retornar a essa função para que sejam fornecidos novos parâmetros.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Arquivo:

4.2.12. Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Mensageria: Não disponível

PRAZO: É necessário lançar MtM até o 4º(quarto) dia útil de cada mês.

Tela Filtro Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Registro de Informação de Derivativos

Código do Contrato

O Participante deve inserir o código do contrato e clicar no botão **Pesquisar** para abrir a tela de registro de curvas marcadas a mercado.

Tela de Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Contrato

Código do Contrato	Data Início	Data Vencimento
14K00079311	14/11/2014	14/12/2014
Ponta 1	Ponta 2	
05000.00-5	05000.10-8	
Ponta 1 (Nome Simplificado)	Ponta 2 (Nome Simplificado)	Meu Número
RIOBM	RIOBM	<input type="text" value="125"/>
Curva Ponta 1	Curva Ponta 2	Papel
DOLAR DOS EUA	DI	PONTA 1

Curvas Marcadas a Mercado

Ponta 1	Ponta 2
<input type="text" value="1"/> , <input type="text" value="10000000"/>	<input type="text" value="1"/> , <input type="text" value="20000000"/>

Descrição do Campo da Tela Registro de Curvas Marcadas a Mercado

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu Número	Número interno de cada Participante identificando o registro.	Obrigatório	Número atribuído a operação de registro de Curvas Marcadas a Mercado.
Ponta 1	Indica qual é o fator da Curva Marcada a Mercado desejado pela Ponta 1.	Obrigatório	Informado com até 6 (seis) números inteiros e 8 (oito) decimais.
Ponta 2	Indica qual é o fator da Curva Marcada a Mercado desejado pela Ponta 2.	Obrigatório	Informado com até 6 (seis) números inteiros e 8 (oito) decimais.

14 REGISTRO – FLUXO DE DATAS DE VERIFICAÇÃO

Esta função é utilizada quando for aplicada média asiática (simples ou ponderada) para o cálculo do valor financeiro da operação.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Fluxo de Datas de Verificação

Arquivo:

4.2.7. Registro de Fluxo de Data de Verificação

Mensageria: Não disponível

PRAZO: A partir de D0 do registro

Tela de Registro de Data de Verificação

Registro de Data de Verificação		
Parte	<input type="text"/>	<input type="text"/>
ContraParte	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Meu Número (Oper Original)	<input type="text"/>	
Quantidade de Datas de Verificação Parte	<input type="text"/>	
Quantidade de Datas de Verificação ContraParte	<input type="text"/>	
<input type="button" value="Confirmar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/>	<input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Descrição dos Campos da Tela Registro de Data de Verificação

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte	Código da conta que identifica o membro que está acessando o sistema e, consequentemente, registrando o contrato.	Obrigatório	
Contraparte	Código da conta que identifica o membro com quem é efetuado o contrato.	Obrigatório	
Meu número (Oper Original)	Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.	Obrigatório	Número atribuído à operação.
Quantidade de Datas de Verificação Parte/ Contraparte	Quantidade de Datas de Verificação Parte/ Contraparte	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Utilizada somente quando for aplicada média asiática (simples ou ponderada).</p> <p>Informado com até 3 (três) inteiros.</p>

Após confirmação, aparece a tela abaixo onde o participante coloca as **datas** e **pesos**.

Registro de Data de Verificação		
Contrato		
Código IF 22G00294185	Data Início 15/07/2022	Data Vencimento 20/07/2022
Código Parte 07570.00-7	Código Contraparte 70180.00-8	Meu Número (Oper Original) 4
Parte (Nome Simplificado) KEBBC	Contraparte (Nome Simplificado) ANDBANKBM	Papel PONTA 1
Curva Parte COMMODITIES	Curva Contraparte DI	Meu Número 5
Ponta 1		Ponta 2
Data da Verificação 20/07/2022		
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Descrição dos Campos da Tela Registro de Data de Verificação

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu Número	Número atribuído à operação.	Obrigatório	
Data de Verificação	É exibido na tela as datas de referência para avaliação e posterior apuração do valor financeiro do SWAP.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando for escolhido Média Asiática.</p> <p>A data de verificação deve ser maior que o início do contrato e menor ou igual ao vencimento do contrato.</p> <p>Tipo: Data (DD/MM/AAAA)</p>
Pesos (%)	Indica a porcentagem do Valor Base que a cotação apurada na data de verificação irá representar para apuração final da taxa média aritmética ponderada.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando a média asiática for ponderada.</p> <p>Caso a média seja simples, os campos de peso não aparecem para preenchimento.</p> <p>Campo: Numérico</p>

15 ANTECIPAÇÃO

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

A antecipação não é permitida para contratos com a situação: “AGUARDANDO LIQUIDAÇÃO EVENTO” ou seja, contrato em que pelo menos uma das curvas é SOFR e seja indicada uma “Data Liquidação” diferente de D-0.

O valor da antecipação deve refletir as condições de mercado na ocasião de seu lançamento.

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

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Registro de Pagamento de Prêmio

Arquivo:

4.2.8. Registro de Antecipação de Contrato

Mensageria: CTP9011 – SWAP – Antecipação de Resgate de Contrato de Swap

PRAZO: A partir de D+1 do registro

Tela Filtro Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato	
Código do Contrato	<input type="text"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Tela Registro de Antecipação de Contrato

Antecipação de Contrato	
Código do Contrato	23J00031007
Ponta 1	02666.00-2
Ponta 2	02666.10-5
Ponta 1 (Nome Simplificado)	GEPENBM
Ponta 2 (Nome Simplificado)	GEPENBM
Valor Base Remanescente	10.000,00
Cesta de Garantias (Ponta 1)	
Cesta de Garantias (Ponta 2)	
Papel	PONTA 1
Meu Número	<input type="text"/>
Fator para Antecipação (Ponta 1)	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Fator para Antecipação (Ponta 2)	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Data de Antecipação	<input type="text"/>
Valor para Antecipação	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Mantém Prêmios	<input type="text"/>
Liquidação Financeira	
Modalidade	
Sem Modalidade	
<input type="button" value="Enviar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Na necessidade de antecipação de contrato com Reset nas datas de liquidação de Reset o Participante deve registrar a operação por meio da função “Registro de Reset”.

Na operação de antecipação são informados os fatores para atualização do Valor Base remanescentes e valor a antecipar, cuja diferença é o último resultado financeiro do contrato. É calculado conforme as fórmulas abaixo:

- **Valor Antecipação total** = (Valor Base remanescente * Fator Participante) - (Valor Base remanescente * Fator Contraparte), onde valor base remanescente = valor base original decrescido das amortizações já efetuadas.

A Antecipação total é realizada quando as partes quitam a dívida original e para que isto seja refletido no Swap, é necessário que o Valor Base seja antecipado totalmente, terminando o contrato.

- **Valor Antecipação parcial** = (Valor a antecipar * Fator para Antecipação - Participante) - (Valor a antecipar * Fator para Antecipação - Contraparte), onde valor a antecipar = valor informado pelo Participante / contraparte que deve ser menor ou igual ao valor base remanescente do contrato e Fator para Antecipação = fator de atualização do valor base a antecipar.

Descrição dos Campos da Tela Antecipação de Contrato

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu Número		Obrigatório	Número atribuído pelo participante, que estiver realizando a operação de antecipação.
Fator para Antecipação (Ponta 1)	Se Antecipação Total: fator para atualização do Valor Base remanescente, compondo o financeiro da ponta do Participante. Se Antecipação Parcial: fator para atualização do valor a ser antecipado (informado no campo “Valor para Antecipação”), compondo o financeiro da ponta do Participante.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preenchido com 10 (dez) inteiros e 8 (oito) casas decimais.

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Fator para Antecipação (Ponta 2)	<p>Se Antecipação Total: fator para atualização do Valor Base remanescente, compondo o financeiro da ponta da Contraparte.</p> <p>Se Antecipação Parcial: fator para atualização do valor a ser antecipado (informado no campo "Valor para Antecipação"), compondo o financeiro da ponta da Contraparte.</p>	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Preenchido com 10 (dez) inteiros e 8 (oito) casas decimais.</p>
Data de Antecipação	Data de antecipação do contrato.	Obrigatório	<p>Caixa de Seleção utilizado apenas se, no filtro, uma das contas for de cliente 1. Neste caso pode ser preenchido com a data atual ou com D-2. Se não houver conta de cliente 1, a caixa vem protegida com Data Atual.</p>
Valor para Antecipação	Valor total ou parcial a antecipar do contrato.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Preenchido com 14 inteiros e 2 casas decimais.</p>

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Mantém Prêmios		Obrigatório	<p>Em caso de antecipação total, esse campo não deve ser considerado ficando o mesmo com a opção Vazio. Em caso de antecipação parcial:</p> <p>Se informado Sim, indica que os pagamentos de prêmios agendados após a data da antecipação parcial devem ser mantidos.</p> <p>Se informado Não, indica que os pagamentos de prêmios agendados após a data de antecipação parcial serão cancelados automaticamente pelo sistema.</p> <p>Caixa de Seleção com as opções: Vazio, SIM e NÃO.</p>

▪ **Observações:**

Contratos com Fluxo de Caixa – Antecipação Parcial:

- 1) Quando o contrato tiver previsão de amortização do “Tipo 0” – percentuais incidentes sobre o Valor Base Original – será aplicado um fator de ajuste sobre os percentuais de amortização a decorrer (eventos futuros) originalmente informados, para que os mesmos passem a refletir a antecipação efetuada.
- 2) Caso haja previsão de amortização do “Tipo 1” – percentuais incidentes sobre Valor Base Remanescente não haverá ajuste dos percentuais de amortização a decorrer (eventos futuros).

Contratos de Swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito

- 1) O registro de antecipação total de contrato vai gerar antecipação de agenda de redutor de risco de crédito com liquidação financeira do saldo pela mesma modalidade de liquidação da operação do contrato original. Para esses casos também é gerado um novo evento na agenda do DRRC indicando seu tipo e sua situação.
- 2) As antecipações parciais também vão gerar operações de antecipação de agenda de redutor de risco de crédito, nesse caso o saldo do redutor de risco de crédito liquidado será proporcional ao percentual antecipado do contrato original. Para esses casos também é gerado um novo evento na agenda do DRRC indicando seu tipo e sua situação. Para maiores detalhes a respeito da metodologia de cálculo aplicada para esses casos, consulte o “Cadernos de Fórmulas – DRRC” disponível no site <http://www.b3.com.br>.

16 CESSÃO

Funcionalidade disponível para realizar a transferência de titularidade de uma das partes do derivativo a um terceiro, desde que com anuência da contraparte e mediante pagamento de financeiro.

Nessa funcionalidade apenas a cessão parcial do contrato é possível de ser lançada. A cessão do contrato a termo é possível da data de registro até a data de vencimento, exclusive. É permitida a cessão de contratos envolvendo contas de cliente 1 e 2.

O lançamento da cessão de contrato é efetuado pelo Cedente e Adquirente com a necessidade de confirmação do Anuente, sendo essa confirmação efetuada pela função **Manutenção de Operações Pendentes** do produto **Operações**, através da opção **confirmar**.

A cessão de contrato com pagamento de prêmio é concretizada simultaneamente à respectiva liquidação financeira.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Cessão de Contrato

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZO: A partir de D+1 do registro e até D-1 do vencimento.

Tela de Cessão de Contrato

Cessão de Contrato	
Cedente	<input type="text"/>
Adquirente	<input type="text"/>
CPF/CNPJ (Adquirente)	<input type="text"/>
Código do Contrato	<input type="text"/>
Contrato Inadimplente	NAO ▼
Meu Número	<input type="text"/>
Papel	▼
Anuente	<input type="text"/>
Valor do Prêmio	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Titular do Prêmio	▼
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Observação 1: A cessão de contrato que envolva conta de cliente 1 obedece aos seguintes critérios:

- 1) A conta de cliente 1 pode ser cedente na operação de cessão;
- 2) A conta de cliente 1 pode ser adquirente somente quando a conta própria for anuente da operação cessão;
- 3) A conta de cliente 1 não pode ser anuente da operação de confirmação de cessão; e
- 4) Não é permitida informação de prêmio.

Observação 2: Não é permitida a cessão de contrato de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.

Observação 3: Não é permitida a cessão parcial de contrato de swap.

Observação 4: Não é permitida a cessão de contrato pendente de liquidação de evento.

Descrição dos Campos da Tela de Cessão de Contrato

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Cedente	Código da conta que identifica o membro que cede o contrato.	Obrigatório	Conta B3.
Adquirente	Código da conta que identifica quem adquire o contrato.	Obrigatório	Conta B3
CPF / CNPJ (Adquirente)		Condicional	Campo de preenchimento obrigatório no caso de operações que envolvam clientes.
Código do Contrato	Número do contrato gerado pelo sistema quando foi realizado o registro da operação de Swap.	Obrigatório	
Contrato Inadimplente	Indica se o contrato em questão está inadimplente ou não	Obrigatório	Caixa de seleção: SIM e NÃO

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Meu número	Número atribuído ao contrato de cessão.	Obrigatório	
Papel	Indica quem está efetuando a operação.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções CEDENTE , ADQUIRENTE .
Anuente	Código da conta que identifica o membro que está mantendo a operação original de Swap.	Obrigatório	
Valor do Prêmio	Valor do prêmio a ser pago.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Não é necessário que o valor do prêmio seja o mesmo pago na operação original.</p> <p>Caso o campo não seja preenchido as partes não se obrigam, ou seja, apenas realizam a cessão do contrato.</p>
Titular do Prêmio	Indica a ponta que pagará o prêmio, se houver.	Condicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório se for preenchido o campo Valor do Prêmio.</p>

Após preencher com as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação e **a necessidade de confirmação pela Contraparte**.

Confirmação de Cessão de Contrato (Cedente ou Adquirente)

Após o lançamento da cessão de contrato efetuado pelo Cedente, o Adquirente também deve lançar a operação, sendo esse lançamento efetuado pela função Manutenção de Operações Pendentes no **Módulo Operações**, através da opção **Confirmar**. Caso o Adquirente tenha realizado o registro primeiro, o Cedente que deve confirmar o lançamento, na forma descrita acima.

Cessão de Contrato	
Cedente 05000.00-5	Cedente (Nome Simplificado) RIOBM
Adquirente 01409.00-2	Adquirente (Nome Simplificado) FLORIDAINV
CPF/CNPJ (Adquirente)	
Código do Contrato 14K00202512	Contrato Inadimplente NAO
Meu Número 132468	Papel CEDENTE
Anuente 10020.00-1	Anuente (Nome Simplificado) LEMEBM
Valor do Prêmio	Titular do Prêmio
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Após preencher as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação e a **necessidade de confirmação de cessão pelo Anuente**.

Confirmação de Cessão de Contrato (pelo Anuente)

Para que a operação de Cessão de Contrato seja finalizada, o Anuente deve acessar a função **Manutenção de Operações Pendentes** no **Módulo Operações**, selecionar o contrato desejado e selecionar a opção **Confirmar**.

Cessão de Contrato	
Cedente 05000.00-5	Cedente (Nome Simplificado) RIOBM
Adquirente 01409.00-2	Adquirente (Nome Simplificado) FLORIDAINV
CPF/CNPJ (Adquirente)	
Código do Contrato 14K00202512	Contrato Inadimplente NAO
Meu Número <input type="text" value="8742"/>	Papel ANUENTE
Anuente 10020.00-1	Anuente (Nome Simplificado) LEMEBM
Valor do Prêmio	Titular do Prêmio
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Após preencher as informações requeridas e clicar no botão **Enviar**, é exibida uma tela de confirmação, onde o Participante pode conferir os dados inseridos, com a possibilidade de confirmação, correção, retorno ou desistência. Ao clicar em **Confirmar**, o sistema retorna mensagem informando o sucesso da operação. **A Situação de Contrato fica com status Transferido**.

Efetuada a operação, os direitos ou obrigações do cedente nos pagamentos de prêmios agendados no registro do contrato anterior a cessão devem ser transferidos para o adquirente.

Caso o Anuente não confirme a cessão, até o encerramento do horário estabelecido para lançamentos na modalidade LBTR, no caso de cessão com prêmio ou na sem modalidade, quando sem prêmio, a mesma não é processada, permanecendo o contrato com suas condições originais.

Existindo prêmio, a operação de prêmio somente é gerada após lançamento da operação de confirmação de cessão pelo anuente.

Existe a possibilidade de cancelamento das operações de cessão e confirmação de cessão.

- **Se operação de cessão sem prêmio** - é permitido o cancelamento antes e após casamento das operações; e
- **Se operação de cessão com prêmio** - é permitido o cancelamento somente se operação de prêmio não tiver sido finalizada.

17 ALTERAÇÃO – PAGAMENTO FINAL

Esta função permite ao Participante alterar informações registradas em determinado contrato, nos prazos especificados abaixo:

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:
Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Contrato – Pagamento Final

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

		PRAZOS		
Tipo de Swap	Tipo de Contrato	D0	Até D+3	D+4
Pagamento Final	Mercado x Cliente (00x10, 10x10, 00x20 própria)	Sim	Sim	Sim*
	Mercado x Mercado (00x00, 00x20 mercado, 20x20 mercado)	Não	Não	Não
Fluxo de Caixa - Não Constante	Mercado x Cliente	Não	Sim	Não
	Mercado x Mercado	Não	Não	Não
Fluxo de Caixa - Não Constante	Mercado x Cliente	Não	Sim	Não
	Mercado x Mercado	Não	Não	Não

*: A alteração de contratos a cliente, a partir de D+4 do registro, segue o fluxo descrito abaixo: “Alteração com aprovação B3”

**:: Para solicitar alterações fora do prazo atualmente permitido pelo sistema ou marcadas como “Não”, contatar a área de atendimento operacional de Derivativos de Balcão.

Tela Filtro Alteração de Contrato - Pagamento Final

Alteração de Contrato - Pagamento Final

Código do Contrato

Ação CORREÇÃO

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Tela de Registro de Alteração de Contrato - Pagamento Final

Alteração de Contrato - Pagamento Final

Parte 05000.00-5
Meu Número

Contraparte 05000.10-8
Código do Contrato 22L00022405

CPF/CNPJ Cliente Parte

CPF/CNPJ Cliente Contraparte 012.345.678-90

Comissão Parte

Comissão Contraparte

Características

Data de Registro 23/12/2022

Data Início 17/1/2023

Data Vencimento 23/12/2024

Valor Base 2000

Valor Total Antecipado 0

Valor Base Atual 10000

Valor Total Amortizado 0

Funcionalidades SEM FUNCIONALIDADE

Adesão a Contrato SEM ADESAO

Agenda de Prêmio NAO

Reset NAO

Código Estratégia

Amortiza sem troca de diferencial

Código Identificador

Exclusivo para Contrato à Termo

Data Operação 23/12/2022

Índice Termo

Perc. Termo

Se Índice Termo

PU Inicial/Cupom Limpo

Data de Cotação Final - Termo

Tipo/Classe

Denominação

Curvas para Atualização

Parte

Contraparte

Percentual 100

Categoria JUROS

Curva DI

TR Escolhida

Juros(% aa)

Lim. Inferior (Floor)

Lim. Superior (Cap)

Terceira Curva

Parte/Contraparte

Cupom Limpo

Percentual

Curva

+

Juros(% aa)

Limitador

Se Curva(s) = "VCP":

Parte

Contraparte

PU

Tipo/Classe

PU

Tipo/Classe

Denominação

Denominação

Cupom Limpo/Data Cotação

Parte

Contraparte

Cupom Limpo

Data de Cotação

Cupom Limpo 5

Data de Cotação 1230000

Data de Cotação D-2

Regras gerais para Alteração de Contrato a partir de D+4 da data de registro:

- As alterações realizadas a partir de D+4 passam pelo fluxo de aprovação B3 para que seja efetivada a alteração.
- No momento da Alteração, deve ser informado no campo **Motivo** a justificativa da alteração.
- O prazo para aprovação/rejeição da Alteração pela B3 é de até 3 dias úteis.
- Após o lançamento da alteração, o contrato passa para o status de: “**PENDENTE APROVAÇÃO B3**”, que indica que a alteração será analisada pela B3.
- Enquanto o contrato está nesse status (máximo de 3 dias), os lançamentos abaixo **não poderão ser realizados**:
 - Antecipação
 - Nova Alteração
 - Aceleração
 - Cancelamento de Contrato
 - Cessão
 - Registro de Reset - Alterações
 - Intermediação
 - Registro de Taxa de Juros do Mercado Internacional
 - Exercício de Opção
- Caso seja necessário realizar alguma operação descrita acima, enquanto o contrato estiver “**PENDENTE APROVAÇÃO B3**”, a alteração deve ser cancelada pelo Participante.
- Os demais lançamentos, detalhados abaixo, **podem ser feitos normalmente** enquanto o contrato está com o status de “**PENDENTE APROVAÇÃO B3**”
 - Atualização de PU/Fator
 - Lançamento de MtM
 - Inclusão de Agente Acelerador
 - Inclusão de Agenda do DRRC
 - Inclusão de Agente de Cálculo
 - Lançamento de MtM para DRRC

Seguem abaixo somente os campos passíveis de alteração:

Tela de Registro de Alteração de Contrato - Pagamento Final

Campo	Descrição	Regras
Data de Início	Data em que o participante contratou a operação. Data de início do contrato.	Não pode ser menor do que a Data de Registro, exceto quando operação realizada com conta cliente 1, limitado a D-2. Para alterações realizadas a partir de D+4 do registro, é possível alterar a “Data de Início” do contrato para datas menores que a data de registro (sem limitação de D-2) ou maiores. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Data de Vencimento	Data de vencimento do contrato.	A data de vencimento do contrato pode ser indicada em feriados, porém não pode ser indicado um final de semana. Caso o ajuste caia em dia não útil, o sistema irá gerar o ajuste para o próximo dia útil conhecido. O período máximo é de 9.999 dias úteis a partir da data informada em “Data Início”. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Adesão ao Contrato	Indica se o contrato registrado é amparado pelo Contrato Global de Derivativos	Obrigatório, quando disponível essa opção Tipo: Domínio (CGD; CGD/CSA; CSA; SEM ADESAO)
Valor Base	Valor base ou quantidade do contrato expresso na moeda de referência.	No caso de contratos à vista, o sistema desconsidera a atualização das curvas, sendo apresentadas com os novos valores no dia seguinte, atualizados desde a data de início, sobre o novo Valor Base . Tipo: Numérico (limite de 10(dez) inteiros e 2 (dois) decimais). Quando casas decimais não preenchidas, o sistema preenche com zeros
Código Estratégia	IMPORTANTE: o código da estratégia deve estar habilitado para a conta do Participante.	Para alterações realizadas a partir de D+4, não é possível alterar o código da estratégia. Informar o código da estratégia previamente habilitado: Ex.: (SWP00XXXXXX)
Amortiza sem troca de diferencial	Indicar quando o contrato previr ajuste com apenas troca de juros	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Quando Seleccionada a opção Sim, se uma das curvas for moeda ou índice de preços registrar a(s) mesma(s) como VCP. Tipo: Domínio (SIM e NÃO).

Campo	Descrição	Regras
Código Identificador		Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Tipo: Numérico (até 10 inteiros)
Data Operação	Data em que o contrato terá sua Taxa a Termo formada	Somente para dia útil. Em D-2 útil ou D+0 da data do registro do contrato. Data de quando a operação foi pactuada a termo, ou seja, ainda não teve início. Se for contrato a termo COM previsão de índice de atualização do Valor Base, a data somente pode ser alterada se ainda não estiver iniciado. Se for contrato a termo SEM previsão de índice de atualização, a data pode ser alterada, mesmo que este já tenha iniciado. Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)
Índice Termo	Indica o parâmetro com o qual deve ser atualizado o Valor Base inicial, a partir da Data Operação até a data de efetivação do termo (Data Início), exclusive.	É permitida a alteração, se contrato ainda não iniciado. Altera a atualização para o dia seguinte ao de alteração (caso haja troca de índice ou inclusão de índice).
Perc. Termo	Valor percentual do Índice Termo que corrige o Valor Base inicial da operação a partir da Data Operação até a data de efetivação do termo (Data Início).	Campo de preenchimento obrigatório se o Índice Termo for preenchido. Tipo: Numérico(até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais).
PU Inicial/ Cupom limpo	PU inicial para atualização do Valor Base. Exclusivo para utilização em caso de Índice Termo ser 00 - VCP . Cupom Limpo, exclusivo para utilização em caso de índice Termo = dólar. Utilizado para informar o valor da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor inicial para valorização da curva do contrato quando código de registro igual a Dólar (Cupom Limpo).	É permitida a alteração, se o contrato ainda não tiver sido iniciado. A atualização é realizada para o dia seguinte da alteração. Obs.: Na utilização do Índice Termo = dólar, a cotação que é utilizada pelo sistema B3 é D-1; Para cotação do dólar de correção do termo for diferente de D-1 utilizar Índice termo = VCP.

Campo	Descrição	Regras
Data de Cotação Final – Termo	Utilizado para informar o deslocamento da taxa de câmbio, de comum acordo entre as partes, que deve ser utilizado como valor final para valorização da curva do contrato quando índice termo for moeda.	Campo de preenchimento obrigatório para quando o campo “Índice termo” seja qualquer moeda disponível em seu domínio. Possíveis valores: (01) D-1; (02) D-2; (03) D-3; (04) D-4; (05) D-5;
Tipo/Classe	Tipo do Índice VCP que atualiza o Valor Base do contrato a termo.	Caixa de Seleção com as opções descritas no tópico Consulta de Tipo de Classe. Não é permitida a indicação de Tipo/Classe 73 (Estratégia).
Denominação	Descrição do parâmetro escolhido como VCP para atualização do Valor Base do contrato a termo. Texto livre com 320 posições.	Nesse campo devem ser informadas condições permitidas de acordo com o indexador escolhido no campo “Tipo/Classe”. Para maiores consultar a seção “Consulta Tipo Classe”.
Percentual	Valor percentual do parâmetro com que o participante e a sua contraparte desejam remunerar cada curva.	A curva é atualizada para o próximo dia útil. O percentual pode ser menor, igual ou maior que 100%, com exceção da curva Libor, havendo ou não taxa de juros. Curvas iguais ou diferentes, inclusive VCP: Se os campos "Curva", "Percentual" e "Juros %a.a." forem idênticos -> Uma das pontas do contrato deve ter um Limitador Fator; e. Se os campos "Curva" forem iguais e contrato sem Limitador Fator -> Os campos "Percentual" e/ou "Juros %a.a." deverão ser diferentes. Informado com até 3 (três) inteiros e 2 (dois) decimais.
Curva	Indicar qual será o ativo subjacente da curva Parte	Parâmetro para atualização das curvas do contrato.
TR Escolhida	Indicar qual será a TR vigente	Tipo: Data (DDMMAAAA).
Sinal + / -	Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa.	A curva é atualizada para o próximo dia útil.

Juros % a.a.	É a taxa de remuneração que, agregada ao parâmetro, atualiza o Valor Base.	A curva é atualizada para o próximo dia útil. Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.
Lim. Inferior (Floor)	Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o módulo usa o limite para corrigir a curva.	Não é permitido o uso Limitadores para o registro de contrato caso Categoria e Curva for ACOES. Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais.
Lim. Superior (Cap)	Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o módulo usa o limite para corrigir a curva.	Não é permitido o uso Limitadores para o registro de contrato caso Categoria e Curva for ACOES. Informado com até 8 (oito) números inteiros e 8 (oito) decimais.

Campo	Descrição	Regras
Parte/ Contraparte		Caixa de Seleção com as opções: Parte e Contraparte.
Cupom Limpo	Na utilização de Terceira Curva, exclusivamente para os parâmetros baseados em Moeda e Ibovespa de Liquidação, de comum acordo entre as partes, que o módulo usa como valor inicial para valorização da curva do contrato	Informado com até 8 (oito) números inteiros e 7 (sete) decimais.
Percentual	Valor percentual do parâmetro de atualização da Terceira Curva do Swap, usada como Limite Inferior ou Superior.	Informado com até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais.
Curva	Na utilização de Terceira Curva que o módulo necessita para atualização do contrato.	Caixa de Seleção com as opções: DI, Selic, Dólar, Dólar Com. Exponencial, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, Franco Suíço, Iene, Peso Mexicano, IGP-M, IGP-DI, INPC, TR, TJLP e Ouro. Observações: ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)

Campo	Descrição	Regras
		<ul style="list-style-type: none"> ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
+ / -	Indica se o juro a ser agregado ao parâmetro de atualização é positivo ou negativo.	<p>Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, SELIC, Dólar, Dólar Com. Exp., Franco Suíço, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, Iene e Peso Mexicano, aceitam taxas de juros negativas.</p> <p>Observações:</p> <ul style="list-style-type: none"> ➤ EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978) ➤ EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) ➤ FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL /USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)].
Juros (% aa)		Taxa de Juros que, agregada ao parâmetro escolhido para terceira curva, atualiza o valor base. Informado com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.
Limitador	Informar se a terceira curva conta com limitador de variação de valorização do contrato.	Caixa de Seleção com as opções: Limite Inferior e Limite Superior.
Cupom Limpo	Campo utilizado para Índice Ibovespa, Moedas e VCP. Cotação inicial informada pelas partes para valorização da curva do contrato.	Condicional
Data de Cotação	Data de Cotação a ser utilizada no início e no vencimento do contrato.	
Data de Cotação - Libor	Data de referência para captura da Libor	São as opções disponíveis para captura da Taxa Libor.

		Caixa de Seleção com 5 opções de datas: Data do Evento, D-1, D-2, D-3, D-4 e D-5 do evento.
Variação Cambial	São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à Taxa Libor.	Caixa de Seleção com as opções: DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA e VCP . Preenchimento obrigatório.
Tipo Classe		Caixa de seleção com as opções: US\$ Austrália, US\$ Canada e Franco Suíço.
Data de Cotação – Variação Cambial	Data da Cotação - Variação Cambial da Parte.	As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda. Possíveis Valores: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 , (D-3), 04 (D-4), 05 (D-5).
Cupom Limpo/Outros - Cotação	Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes.	Somente deve ser preenchido: Se desejar utilizar o Cupom Limpo para uma das opções de variação cambial: DÓLAR, EURO, IENE ou LIBRA ; Cotação inicial da moeda quando indicada a opção VCP para variação cambial.
Alíquota IR	Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros ou vencimento do contrato.	Tipo: Numérico (até 3(três) inteiros e 5(cinco) decimais)
Limite Inferior (Floor)	Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.	Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.
Limite Superior (Cap)	Taxa arbitrada como Limite Superior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.	Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.
Taxa Juros	Taxa de Juros informada para o período determinado no campo Troca de Fluxo .	Informar com até 3 (três) números inteiros e 4 (quatro) decimais.

Variação Cambial	São as opções de variação cambial possíveis, para agregar à TJMI. As cotações são obtidas do Sisbacen, transação PTAX800, ponta de venda.	Caixa de Seleção com as opções: DÓLAR, EURO, IENE, LIBRA e VCP .
Tipo Classe		Caixa de seleção com as opções: US\$ Austrália, US\$ Canada e Franco Suíço.
Cupom Limpo / Outros - cotação	Informação de cotação, para atualização, acordada entre as partes.	Somente deve ser preenchido: Se desejar utilizar o Cupom Limpo para uma das opções de variação cambial: DÓLAR, EURO, IENE ou LIBRA ; Cotação inicial da moeda quando indicada a opção VCP para variação cambial.
Alíquota IR	Taxa do Imposto de Renda para utilização no pagamento de juros ou vencimento do contrato.	Informar com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.
Limite Inferior (Floor) - Perc.	Taxa arbitrada como Limite Inferior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.	Caso o parâmetro de atualização varie abaixo desse fator mínimo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.
Limite Superior (Cap) - Perc.	Taxa arbitrada como Limite Superior, referente à valorização total de uma ou de ambas as curvas, aplicáveis em cada contrato. É aplicado quando do vencimento do contrato.	Caso o parâmetro de atualização varie acima desse fator máximo, o sistema usa o limite para corrigir a curva. Informado com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais.

Campo	Descrição	Regras
Cotação Inicial	Cotação Inicial da Parte/Contraparte	Informar 7(sete) inteiros e 4(quatro) decimais.
Código da Commodity/Ação	Código da Commodity ou Ação da Parte/Contraparte.	Esse campo deverá ser preenchido através do RIC. Esta informação está disponível nos arquivos públicos relacionados à Mercadorias_Indexadores.
Média Asiática Verificação	Indica o tipo de média para a cotação para liquidação do contrato	Caixa de seleção com as opções: Branco (quando opção não for Asiática), SIMPLES ou PONDERADA.
Data da Cotação para Ajustes	Data de Cotação para Ajuste da Parte/Contraparte.	Possíveis valores da Contraparte: 01 (D-1), 02 (D-2), 03 (D-3), 04 (D-4), 5 (D-5).
Tipo de Cotação		Caixa de Seleção com as Opções: "Ajuste", "Fechamento", "Máximo", "Médio" e "Mínimo".
Parte / Contraparte	Define a Parte/Contraparte do Trigger.	Caixa de Seleção com as Opções: Parte e Contraparte.
Fator / Valor / Taxa	Magnitude do parâmetro que determina a efetivação (Trigger In) ou rescisão (Trigger Out) do Swap.	<p>Informado com até 8 (oito) inteiros e 8 (oito) decimais.</p> <p>Fator - informar com 8 (oito) casas decimais, se parâmetro informado for IGP-M, IGP-DI, INPC, TR ou qualquer outro parâmetro aceito como trigger, cuja verificação seja final.</p> <p>Taxa - informar com 2 (duas) casas decimais, se parâmetro informado for DI, SELIC ou TJLP.</p> <p>Valor - informar com 4 (quatro) casas decimais, se parâmetro informado for Dólar, Dólar Comercial Exponencial ou Ouro. Informar com 5 (cinco) decimais, se parâmetro informado for Franco Suíço ou Euro. Informar com 6 (seis) decimais, se parâmetro informado for Iene ou Peso Mexicano. Informar com 8 (oito) decimais, se parâmetro informado for Ibovespa de Liquidação.</p>
Verificação	Determina a periodicidade de checagem do comportamento do parâmetro do trigger.	Caixa de Seleção com as opções: Diária e Final. Consulte Capítulo Informações Adicionais – Item <i>Contratos com Funcionalidades</i> .

Campo	Descrição	Regras
Dias Úteis Após o Trigger Out	Identifica a quantidade de dias úteis, após ocorrer o Knock Out, que é pago o Rebate.	Não pode ultrapassar o dia do vencimento original do Swap.
Valor (R\$)	Valor do prêmio.	Pode ser informado como “0” (zero).
Data Exercício	Data em que o titular paga prêmio para exercer a opção de permanência no contrato.	Preencher somente para a modalidade Compound Swaption.
Motivo Alteração	Informar o motivo da alteração dos dados do contrato.	Para alterações realizadas antes de D+4 do registro, o campo não é exibido. Para alterações realizadas a partir de D+4 do registro, o campo é de preenchimento obrigatório. Campo tipo texto, de até 300 caracteres.

18 ALTERAÇÃO – FLUXO CONSTANTE

Esta função permite ao Participante alterar informações registradas em determinado contrato, nos prazos especificados abaixo:

FORMAS DE LANÇAMENTO
Tela: Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Contrato – Fluxo Constante
Arquivo: Não disponível
Mensageria: Não disponível

		PRAZOS		
Tipo de Swap	Tipo de Contrato	D0	Até D+3	D+4
Fluxo de Caixa - Constante	Mercado x Cliente	Não	Sim	Não
	Mercado x Mercado	Não	Não	Não

*: A alteração de contratos a cliente, a partir de D+4 do registro, segue o fluxo descrito abaixo: "Alteração com aprovação B3"

**:: Para solicitar alterações fora do prazo atualmente permitido pelo sistema ou marcadas como "Não", contatar a área de atendimento operacional de Derivativos de Balcão.

Tela Filtro Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Código do Contrato 14K00079312

Ação CORREÇÃO

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Observação:**Contratos de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.**

A alteração de contrato de swap que afete a agenda de redutor de risco de crédito não vai gerar alteração de agente de redutor de risco de crédito periódico, tais alterações deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

Tela de Registro de Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante			
Parte	Contraparte	CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
10020 10 4	10020 10 4	67.931.972/0001-70	93.896.397/0012-85
Meu Número	Código do Contrato		
	08D00003009		
Características			
Data de Registro	Data Inicio	Data Vencimento	
30 4 2008	30 5 2008	30 5 2018	
Adesão a Contrato	Valor Base	Valor Total Antecipado	
	1000000000 ,	100 ,	
Valor Base Atual	Valor Total Amortizado	Agenda de Prêmio	
1008766750 ,	521194068 , 90	NAO	
Código Estratégia		Amortiza sem troca de diferencial	
Código Identificador			
Exclusivo para Contrato à Termo			
Data Operação	Índice Termo	Perc. Termo	
30 4 2008	SELIC	100 ,	
Se Índice Termo			
PU Inicial/Cupom Limpo	Data de Cotação Final - Termo	Tipo/Classe	Denominação
FLUXO DE JUROS e AMORTIZAÇÕES			
Juros a cada	Período	Data Inicio Pagto Juros	
1	Meses	30 6 2008	
Amort a cada	Período	Data Inicio Pagto Amort.	Tipo Amortização
1	Meses	30 6 2008	Sobre valor Base Original

(continua)

Curvas para Atualização

Parte

Contraparte

Percentual

100

,

Curva

PREFIXADO 252D

+/-

+

Juros(% aa)

12

,

Lim. Inferior (Floor)

,

Lim. Superior (Cap)

,

Percentual

100

,

Curva

LIBOR IENE 01M

+/-

Juros(% aa)

,

Lim. Inferior (Floor)

,

Lim. Superior (Cap)

,

Se Curva(s) = "VCP":

Parte

Contraparte

PU

,

Tipo/Classe

Denominação

PU

,

Tipo/Classe

Denominação

Cupom Limpo/Data Cotação

Parte

Contraparte

Cupom Limpo

,

Data Informação Cupom Limpo

Data de Cotação

Cupom Limpo

,

Data Informação Cupom Limpo

Data de Cotação

Exclusivo para curva "Libor"

Parte

Contraparte

Data de Cotação - Libor

Variação Cambial

Tipo Classe

Cupom Limpo / Outros - Cotação

,

Limite Inferior (Floor) - Perc.

,

Data de Cotação - Libor

D

Variação Cambial

LIBRA

Tipo Classe

Cupom Limpo / Outros - Cotação

,

Limite Inferior (Floor) - Perc.

,

Data da Cotação - Variação Cambial

Aliquota IR

,

Limite Superior (Cap) - Perc.

,

Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional"

Parte

Contraparte

Taxa Juros

,

Variação Cambial

Cupom Limpo / Outros - Cotação

,

Limite Inferior (Floor) - Perc.

,

Troca de Fluxo

Tipo Classe

Aliquota IR

,

Limite Superior (Cap) - Perc.

,

Taxa Juros

,

Variação Cambial

Cupom Limpo / Outros - Cotação

,

Limite Inferior (Floor) - Perc.

,

Troca de Fluxo

Tipo Classe

Aliquota IR

,

Limite Superior (Cap) - Perc.

,

Exclusivo para Commodity

Parte

Contraparte

Cotação Inicial

,

Codigo da Commodity

Data da Cotação para Ajuste

Cotação Inicial

,

Codigo da Commodity

Data da Cotação para Ajuste

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

(fim)

As características para registro do contrato são semelhantes em suas maiorias, contudo com a inclusão de campos. Abaixo seguem as diferenças existentes.

Campo	Descrição	Regras
Juros a cada	Periodicidade do pagamento de juros, expressa no formato definido no campo Período.	É necessário refazer o fluxo e a agenda de eventos. Campo numérico com até 10 dígitos numéricos.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Período		É permitida a alteração desde que não tenha existido operação de troca de juros/amortização. É refeito o fluxo e a agenda de eventos.
Data Início Pagto Juros	Define a data do primeiro pagamento de juros.	Importante: Pode ser informada uma data passada (qualquer data), mesmo não sendo com conta de cliente 1.
Amortização a cada	Periodicidade da amortização, expressa no formato definido no campo Período .	É necessário refazer o fluxo e a agenda de eventos. Até 10 dígitos numéricos.
Período	Prazo mínimo em dias úteis - 1 dia. Prazo mínimo em dias corridos - 5 dias.	É permitida a alteração desde que não tenha existido operação de troca juros/amortização. Será refeito o fluxo e a agenda de eventos.
Data Início Pagto Amort.	Define a Data da primeira troca de amortização. Será efetuado primeiramente o cálculo dos juros, e somente depois o cálculo das amortizações.	Se informada, a data deve combinar com uma data de pagamento de juros, ou seja, deve ser em data que também exista pagamento de juros. Tipo: Data (DDMM AAAA)
Tipo Amortização	Indica o tipo de amortização escolhido.	Caixa de Seleção com as opções: Vazio, Sobre valor Base original (valor base da data do início do contrato) ou Sobre valor Base Remanescente (valor base original decrescido das amortizações já efetuadas).

19 ALTERAÇÃO – FLUXO CONSTANTE

Esta função permite ao Participante alterar informações registradas em determinado contrato, nos prazos especificados abaixo:

FORMAS DE LANÇAMENTO
Tela: Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Contrato – Fluxo Não Constante
Arquivo: Não disponível
Mensageria: Não disponível

		PRAZOS		
Tipo de Swap	Tipo de Contrato	D0	Até D+3	D+4
Fluxo de Caixa - Não Constante	Mercado x Cliente	Não	Sim	Não
	Mercado x Mercado	Não	Não	Não

*: A alteração de contratos a cliente, a partir de D+4 do registro, segue o fluxo descrito abaixo: "Alteração com aprovação B3"

**:: Para solicitar alterações fora do prazo atualmente permitido pelo sistema ou marcadas como "Não", contatar a área de atendimento operacional de Derivativos de Balcão.

Tela Filtro Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Alteração de Fluxo de Caixa - Não Constante	
Código do Contrato	<input type="text"/>
Ação	<input type="text" value="CORREÇÃO"/>
Alterar Número de Datas de Eventos	<input type="text" value="v"/>
Número de Datas de Eventos	<input type="text"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Observação:**Contratos de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.**

A alteração de contrato de swap que afete a agenda de redutor de risco de crédito não vão gerar alteração de agente de redutor de risco de crédito periódico, tais alterações deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

Tela de Registro de Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Não Constante

Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Não Constante			
Parte 05000,00,5	Contraparte 05000,10,8	CPF/CNPJ Cliente Parte	CPF/CNPJ Cliente Contraparte 987.654.321-00
Meu Número	Código do Contrato 21100001441		
Características			
Data de Registro 21/9/2021	Data Início 21/9/2021	Data Vencimento 21/9/2022	
Adesão a Contrato ▼	Valor Base 1000000,00	Valor Total Antecipado 0,00	
Valor Base Atual 1000000,00	Valor Total Amortizado 0,00	Agenda de Prêmio SIM	
Código Estratégia	Observação	Amortiza sem troca de diferencial ▼	
Código Identificador			
Exclusivo para Contrato à Termo			
Data Operação	Índice Termo	Perc. Termo	
	▼		
Se Índice Termo			
PU Inicial/Cupom Limpo	Data de Cotação Final - Termo	Tipo/Classe	Denominação
	▼	▼	
Curvas para Atualização			
Parte		Contraparte	
Percentual 100,00	Categoria JUROS INTERNACIONAIS ▼	Percentual 110,00	Categoria ÍNDICES DE PREÇOS ▼
Curva SOFR2 ▼	+/- ▼	Curva IPCA ▼	+/- ▼
Juros(% aa) 0,00	Lim. Inferior (Floor) 0,00	Juros(% aa) 0,00	Lim. Inferior (Floor) 0,00
Lim. Superior (Cap) 0,00		Lim. Superior (Cap) 0,00	
Se Curva(s) = "VCP":			
Parte		Contraparte	
PU	Tipo/Classe	PU	Tipo/Classe
	▼		▼
Denominação		Denominação	
Cupom Limpo/Data Cotação			
Parte		Contraparte	
Cupom Limpo	Data Informação Cupom Limpo	Cupom Limpo	Data Informação Cupom Limpo
Data de Cotação		Data de Cotação	
▼		▼	

(continua)

Exclusivo para curva "Libor"

Parte		Contraparte	
Data de Cotação - Libor <div></div>	Variação Cambial <div></div>	Data de Cotação - Libor <div></div>	Variação Cambial <div></div>
Tipo Classe <div></div>	Data da Cotação - Variação Cambial <div></div>	Tipo Classe <div></div>	Data da Cotação - Variação Cambial <div></div>
Cupom Limpo / Outros - Cotação <div></div>	Aliquota IR <div></div>	Cupom Limpo / Outros - Cotação <div></div>	Aliquota IR <div></div>
Limite Inferior (Floor) - Perc. <div></div>	Limite Superior (Cap) - Perc. <div></div>	Limite Inferior (Floor) - Perc. <div></div>	Limite Superior (Cap) - Perc. <div></div>

Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional"

Parte		Contraparte	
Taxa Juros <div></div>	Troca de Fluxo <div></div>	Taxa Juros <div></div>	Troca de Fluxo <div></div>
Variação Cambial <div></div>	Tipo Classe <div></div>	Variação Cambial <div></div>	Tipo Classe <div></div>
Cupom Limpo / Outros - Cotação <div></div>	Aliquota IR <div></div>	Cupom Limpo / Outros - Cotação <div></div>	Aliquota IR <div></div>
Limite Inferior (Floor) - Perc. <div></div>	Limite Superior (Cap) - Perc. <div></div>	Limite Inferior (Floor) - Perc. <div></div>	Limite Superior (Cap) - Perc. <div></div>

Exclusivo para curva "Juros Internacionais Overnight"

Data Liquidação

D+0

Parte		Contraparte	
Cotação Inicial Moeda <div></div>	Expressão Juros <div>Linear act/360</div>	Cotação Inicial Moeda <div></div>	Expressão Juros <div></div>
Metodologia de composição da taxa <div>Compounding act/360</div>	Aliquota IR (em %) <div></div>	Metodologia de composição da taxa <div></div>	Aliquota IR (em %) <div></div>
Deslocamento da taxa <div>D-1</div>		Deslocamento da taxa <div></div>	

Exclusivo para Commodity e Ação

Parte			Contraparte		
Cotação Inicial <div></div>	Codigo da Commodity/Ação <div></div>	Data da Cotação para Ajuste <div></div>	Cotação Inicial <div></div>	Codigo da Commodity/Ação <div></div>	Data da Cotação para Ajuste <div></div>

Dados de Operações

Existem operações nesse contrato entre as datas de inicio e de correção/aditamento?

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

(fim)

As características para registro do contrato são semelhantes em suas maiorias, contudo com a inclusão de campos. Abaixo seguem as diferenças existentes.

Descrição dos Campos da Tela de Registro de Alteração de Contrato- Fluxo de Caixa Não Constante

Campo	Descrição	Regras
Valor Total Antecipado	Valor total antecipado.	Tipo: Numérico.
Valor Base Atual	Valor base atualizado.	Tipo: Numérico.
Valor Total Amortizado	Valor total amortizado.	Tipo: Numérico.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

15 ALTERAÇÃO – FLUXO CONSTANTE

Esta função permite ao Participante alterar informações registradas em determinado contrato, nos prazos especificados abaixo:

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Contrato – Fluxo Não Constante

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

Tela Filtro Alteração de Contrato - Fluxo de Caixa Constante

Alteração de Fluxo de Caixa - Não Constante

Código do Contrato

Ação

 ▼

Alterar Número de Datas de Eventos

Número de Datas de Eventos

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Observação:**Contratos de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.**

A alteração de contrato de swap que afete a agenda de redutor de risco de crédito não vão gerar alteração de agente de redutor de risco de crédito periódico, tais alterações deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

Descrição do campo da Tela de Filtro Alteração de Fluxo de Caixa

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Código do Contrato		Obrigatório	Código do Contrato a ser pesquisado.
Alterar Número de Datas de Eventos	Indica se o número de datas de eventos será alterado.	Obrigatório	Caixa de Seleção com as opções: Vazio , SIM e NÃO .
Número de Datas de Eventos		Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, se no campo Alterar Número de Datas de Eventos for selecionada a opção SIM . Número desejado de datas de eventos para o fluxo.

Tela de Registro Alteração de Fluxo de Caixa - Não Constante

Registro Fluxo de Caixa - Não Constante			
Contrato			
Código IF 21K00000897	Data Início 03/11/2021	Data Vencimento 06/12/2021	
Código Parte 10020.00-1	Código Contraparte 05000.00-5	Meu Número (Oper Original) 972724	
Parte (Nome Simplificado) LEMEBM	Contraparte (Nome Simplificado) RIOBM	Papel <input type="text"/>	
Curva Parte SOFR2	Curva Contraparte IPCA		
Tipo Amortização <input type="text"/>	Meu Número <input type="text"/>		
Fluxo Não Constante Ponta 1			
Data <input type="text"/>	+/- <input type="text"/>	Juros(% aa) <input type="text"/>	Taxa Amortização <input type="text"/>
Data 06/12/2021	+/- <input type="text"/>	Juros(% aa) <input type="text"/>	Taxa Amortização <input type="text"/>
Fluxo Não Constante Ponta 2			
Data <input type="text"/>	+/- <input type="text"/>	Juros(% aa) <input type="text"/>	Data Início Composição da Taxa <input type="text"/>
Data 06/12/2021	+/- <input type="text"/>	Juros(% aa) <input type="text"/>	Data Início Composição da Taxa <input type="text"/>
			Data Final Composição da Taxa <input type="text"/>
			Data Fixing Moeda <input type="text"/>
			Taxa Amortização <input type="text"/>
			Taxa Amortização <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Descrição dos Campos da Tela de Registro de Alteração de Fluxo de Caixa

Campo	Descrição	Regras
Tipo de Amortização	Informa sobre qual valor incidirá a amortização.	Se alterado, o valor desse campo é criticado em conjunto com o campo Taxa Amortização .
Meu número	Número atribuído a operação de registro de fluxo de caixa não constante.	Não é permitida alteração quando número de eventos não for alterado. Ao efetuar uma alteração que não seja sobre o número de eventos, deve ser informado um novo número para a operação.
Data Último Pagto. Juros		Disponível para preenchimento somente quando uma das pontas do contrato utilizar como parâmetro a curva Libor.
Data	Data em que ocorrerá o evento.	Tipo: Data (DDMMAAAA)

Campo	Descrição	Regras
+/-	Indica se a taxa de remuneração (juros) a ser agregada ao parâmetro de atualização é positiva ou negativa.	Preencher em conjunto com Juros . Somente os registros de contratos pactuados com base no DI, Dólar, Libor e TJMI aceitam taxas de juros negativas.
Taxa Juros	Taxa de Juros informados para o evento.	Informar com até 3(três) números inteiros e 4(quatro) decimais.
Taxa Amortização	Percentual de amortização a ser aplicado conforme opção escolhida no campo Tipo Amortização .	Os valores atribuídos a esse campo serão criticados em conjunto com o campo Tipo Amortização. Informar com até 3(três) inteiros e 5(cinco) decimais.
Data Início Composição da Taxa	Indica a data em que irá iniciar o <i>accrual</i> da taxa SOFR para o fluxo indicado. Exclusivo para curva SOFR.	Possibilidade de alteração a depender das informações incluídas no contrato original deste fluxo.
Data Final Composição da Taxa	Indica a data em que irá finalizar o <i>accrual</i> da taxa SOFR para o fluxo indicado. Exclusivo para curva SOFR.	Possibilidade de alteração a depender das informações incluídas no contrato original deste fluxo.
Data fixing Moeda	Indica a data em que será capturada a cotação final da moeda, para cálculo da variação cambial. Exclusivo para curva SOFR.	Possibilidade de alteração a depender das informações incluídas no contrato original deste fluxo.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

16 ALTERAÇÃO DE FLUXO DE DATA DE VERIFICAÇÃO

Esta função permite ao Participante alterar informações registradas em determinado contrato, nos prazos especificados abaixo:

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Fluxo de Data de Verificação

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

Tela Filtro Alteração de Fluxo de Data de Verificação

Alteração de Fluxo de Data de Verificação

Código do Contrato

Alterar Número de Datas de Verificação

Quantidade de Datas de Verificação Parte

Quantidade de Datas de Verificação ContraParte

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Descrição dos Campos da Tela Alteração de Fluxo de Data de Verificação

Campo	Descrição	Regras
Código do Contrato	Número atribuído à operação.	Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.
Alterar Número de Datas de Verificação		Caixa com as opções: SIM e NÃO.
Quantidade de Datas de Verificação Parte	Quantidade de Datas de Verificação Parte.	Utilizada somente quando for aplicada média asiática. Informado com até 3 (três) inteiros.
Quantidade de Datas de Verificação Contraparte	Quantidade de Datas de Verificação Contraparte.	Utilizada somente quando for aplicada média asiática (simples ou ponderada). Informado com até 3 (três) inteiros.

Após confirmação, aparece a tela abaixo onde o participante coloca as novas datas e pesos.

Tela Alteração de Fluxo de Data de Verificação

Alteração de Fluxo de Data de Verificação		
Contrato		
Código IF	Data Início	Data Vencimento
14K00202544	19/11/2014	28/11/2014
Código Parte	Código Contraparte	
05000.00-5	10020.00-1	
Parte (Nome Simplificado)	Contraparte (Nome Simplificado)	
RIOBM	LEMEBM	
Curva Parte	Curva Contraparte	
COMMODITIES	DI	
Meu Número		
1421		
Ponta 1	Ponta 2	
Data da Verificação 20/11/2014		
Data da Verificação 21/11/2014		
Confirmar	Corrigir	Voltar Desistir

Descrição dos Campos da Tela Registro de Data de Verificação

Campo	Descrição	Regras
Meu número (Oper Original)	Número atribuído à operação.	Número interno de cada Participante, identificando o lançamento.
Data de Verificação Parte	Campo de preenchimento obrigatório quando for escolhido Média Asiática.	É exibido na tela as datas de referência para avaliação e posterior apuração do valor financeiro do SWAP. Devem ser indicadas, pelo menos, duas datas de verificação.
Pesos (%)	Preencher quando a média asiática for ponderada. Caso a média seja simples, os campos de peso não aparecem para preenchimento.	Indica a porcentagem do Valor Base que a cotação apurada na data de verificação irá representar para apuração final da taxa média aritmética ponderada. Informado com até 3 (três) inteiros.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIAÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

17 ALTERAÇÃO DE PAGAMENTO DE PRÊMIO

Esta função permite ao Participante alterar informações registradas em determinado contrato, nos prazos especificados abaixo:

FORMAS DE LANÇAMENTO
Tela: Menu Swap > Lançamentos > Alteração de Fluxo de Data de Verificação
Arquivo: Não disponível
Mensageria: Não disponível
PRAZOS: <ul style="list-style-type: none">• Na data do registro do contrato (D-0), é permitida a alteração da agenda de prêmios, quantas vezes forem necessárias.• A partir de D+1 útil do registro e até em D+3 útil do registro, inclusive, em contratos entre conta própria e seus clientes ou entre clientes, é permitida a alteração da agenda de prêmios, sendo permitido, no máximo, uma alteração por dia.• Até D-1 do vencimento.

Tela Filtro Alteração de Pagamento de Prêmio

Alteração de Pagamento de Prêmio

Código do Contrato

Quantidade de Prêmios

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Tela de Registro de Alteração de Pagamento de Prêmio

Alteração de Pagamento de Prêmio

Contrato

Código do Contrato	Data Início	Data Vencimento
14K00079310	14/11/2014	14/12/2014
Ponta 1	Ponta 2	
05000.00-5	05000.10-8	
Ponta 1 (Nome Simplificado)	Ponta 2 (Nome Simplificado)	Meu Número
RIOBM	RIOBM	3339
Curva Ponta 1	Curva Ponta 2	Papel
DOLAR DOS EUA	DI	PONTA 1

Eventos de Prêmio

Data	Valor do Prêmio	Titular
17/11/2014	5,00	PONTA 1
Data	Valor do Prêmio	Titular
19 / 11 / 2014	5 ,	PONTA 1 ▼

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Tela de Registro de Alteração de Pagamento de Prêmio

Campo	Descrição	Regras
Meu Número	Número interno de cada participante identificando o lançamento.	Número atribuído a operação de registro de fluxo de caixa não constante.
Papel	Indica a ponta que está efetuando a atualização. Caixa de Seleção com as opções: Ponta1 ou Ponta2.	Campo de preenchimento obrigatório.
Data	Data em que ocorrerá o pagamento do prêmio.	Tipo: Data (DDMMAAAA)
Valor do Prêmio	Informar o valor do prêmio.	Tipo Numérico: 5(cinco) inteiros e 4(quatro) decimais.
Titular	Indicar a ponta que pagará o prêmio.	Caixa de Seleção com as opções: Ponta1 ou Ponta2 .

Seguem os campos da tela de registro e as observações cabíveis quanto à possibilidade de alteração.

Tipo da Operação	Prazos para alterações
À vista , com contrato registrado em D ; data de início em D , agenda de prêmios para D+n	Se não existe operação de pagamento de prêmio para D : <ul style="list-style-type: none"> Permitida alteração (inclusões e exclusões) da agenda de prêmios das datas D até D+n.
À termo , com contrato registrado em D ; data de início em D+n , agenda de prêmios para D+n	
À vista , com contrato registrado em D ; data de início em D , agenda de prêmios para D+n , operação de pagamento de prêmio em D e D+1	Se operação de pagamento de prêmio com status Pendente de Liquidação Financeira: <ul style="list-style-type: none"> É permitida alteração da agenda de prêmios somente para os prêmios futuros; Não é permitida alteração do prêmio da data de registro, se houver essa necessidade o participante deve cancelar a operação de pagamento de prêmio, assim o sistema cancela automaticamente a agenda de prêmios e retorna o status do contrato para Pendente de Agenda de Prêmios para nova definição do fluxo de pagamentos de prêmio.
À termo , com contrato registrado em D ; data de início em D+n , agenda de prêmios para D+n , operação de pagamento de prêmio em D e D+1	
Contrato com clientes próprios e entre clientes	
À vista , com contrato registrado em D , Data de Início em D , Agenda de Prêmios para D+n	Se não existe operação de pagamento de prêmio para D : <ul style="list-style-type: none"> É permitida alteração (inclusões e exclusões) da agenda de prêmios das datas D até D+n.
À termo , com contrato registrado em D , Data de Início em D+n , Agenda de Prêmios para D+n	Se existe operação de pagamento de prêmio: <ul style="list-style-type: none"> É permitida alteração da agenda de prêmios somente para os prêmios futuros.
À vista , com contrato registrado em D , Data de Início em D , Agenda de Prêmios para D+n , operação de prêmio em D e D+n	Se operação de pagamento de prêmio com status Finalizado: <ul style="list-style-type: none"> É permitida alteração da agenda de prêmios somente para os prêmios futuros; Para alteração do prêmio da data de registro, é necessário primeiramente o cancelamento da operação de pagamento de prêmio, o sistema cancela automaticamente a agenda de prêmios e retorna o status do contrato para Pendente de Agenda de Prêmios para nova definição do fluxo de pagamentos de prêmio.
À termo , com contrato registrado em D , Data de Início em D+n , Agenda de Prêmios para D+n , operação de prêmio em D e D+n	

Observação1: Para incluir os prêmios deve ser informado um número maior do que o registrado, assim como para excluir o valor informado deve ser menor, desde que fique no mínimo, com pagamento registrado.

Observação2:

Contratos de swap com Agenda de Redutor de Risco de Crédito.

A alteração de contrato de swap que afete a agenda de redutor de risco de crédito não vai gerar alteração de agente de redutor de risco de crédito periódico, tais alterações deverão ser registradas no Módulo de Informação de Derivativos- MID por meio de Redutor de Risco de Crédito Extraordinário.

18 CANCELAMENTO DE CONTRATO

Por meio desta função, o participante pode realizar o cancelamento de contrato de swap

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Cancelamento de Contrato

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZOS:

- No prazo máximo de até 3 dias úteis da data de registro do contrato, independentemente de ter sido realizado com outro participante ou com a sua conta de cliente 1 ou 2.
- A partir do 4º dia útil da data de registro do contrato até D-1 da data de vencimento, apenas para contratos realizados entre a sua conta própria e sua conta de cliente 1 ou 2. Nesses casos, é obrigatório informar justificativa plausível, cabendo a B3 eventuais questionamentos.
 - As solicitações de cancelamento do contrato devem ser realizadas até as 18h.
 - Após o lançamento da solicitação:
 - A exclusão ficará pendente de aprovação pela B3 e será avaliada no dia da solicitação.

O contrato assume o status “**EM MANUTENÇÃO**” e as seguintes operações ficam bloqueadas: Correção de Contrato, Antecipação, Cessão e Aceleração

Tela Filtro Cancelamento

Cancelamento de Contrato	
Parte	<input type="text"/>
Contraparte	<input type="text"/>
Código do Contrato	<input type="text"/>
Meu Número	<input type="text"/>
Justificativa	<input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Para solicitações fora do prazo e/ou condições acima mencionadas, fica a critério da B3 analisar pedidos de exclusão que não sejam sistêmicos (mediante envio de carta com o de acordo dos representantes que possuem outorga perante a instituição).

Descrição dos Campos da Tela Filtro Cancelamento

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regra
Parte	Código da conta que identifica o membro que registrou o contrato.	Obrigatório	Conta B3
Contraparte	Código da conta que identifica o membro com quem foi efetuado o contrato.	Obrigatório	Conta B3
Código do Contrato	Código do Contrato a ser cancelado.	Obrigatório	
Meu Número	Número atribuído pelo Participante, que estiver realizando a operação de cancelamento.	Obrigatório	Número atribuído a operação de registro de fluxo de caixa não constante.
Justificativa	Motivo Deve ser informado o motivo de exclusão do contrato.	Condicional	Campo de preenchimento obrigatório, caso a exclusão seja comandada a partir do 4º dia útil da data de registro do contrato e até D-1 da data de vencimento. Nesse caso, a aprovação ficará pendente de aprovação pela B3. Campo tipo texto, com até 4.000 caracteres.

19 EXERCÍCIO DA OPÇÃO

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Exercício de Opção

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZOS

Contrato à vista: Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D + 1 ou 2) até a data de vencimento, inclusive.
Contrato a termo: Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D + N.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D + N + 1) até a data de vencimento, inclusive.
Contrato à vista com conta cliente 1: Registrado em D + 1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D + 1 ou 2) até a data de vencimento, inclusive.
Contrato a termo decorrido: Registrado em D + 1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D + N.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D + N + 1) até a data de vencimento, inclusive.

Tela Filtro Exercício da Opção

Exercício de Opção

Código do Contrato

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Tela Exercício da Opção

Exercício de Opção

Contrato

Código do Contrato	Data Início	Data Vencimento
14K00202507	19/11/2014	21/11/2014
Funcionalidades		
OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO		
Ponta 1	Ponta 2	Papel
05000.00-5	10020.00-1	PONTA 1
Ponta 1 (Nome Simplificado)	Ponta 2 (Nome Simplificado)	Meu Número
RIOBM	LEMEBM	<input type="text" value="11111"/>
Curva Ponta 1	Curva Ponta 2	
DI	DOLAR DOS EUA	
Valor da Curva Atualizado Ponta 1	Valor da Curva Atualizado Ponta 2	
100.083,50	98.009,01	

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Nesta tela, o sistema informa os dados do contrato acessado. Para prosseguir no lançamento do exercício de opção o Participante deve preencher o campo **Meu Número** e clicar no botão **Enviar**..

Observação: Não é permitido o estorno de exercício de opção de arrependimento do contrato.

Exercício de opção referente aos prêmios e comissões

Situação dos prêmios e comissões no exercício de opção dos contratos

Pagamento do PRÊMIO da OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO.

O pagamento do prêmio da opção de arrependimento, pago na data de registro tem curso normal independente se exerce ou não a opção.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade SWAPTION A TERMO.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 na data de início).

Pagamento Prêmio 1 tem curso normal.

Pagamento Prêmio 2:

- **Se não foi exercida a opção:** É cancelado automaticamente.
- **Se exercida a opção:** O pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade COMPOUND SWAPTION.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).

Pagamento Prêmio 1 tem curso normal.

Pagamento Prêmio 2:

- **Se não foi exercida a opção:** É cancelado automaticamente.
- **Se exercida a opção:** O pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.

Exercício de opção na data de Vencimento do Contrato

Possibilidade do exercício de opção no vencimento do contrato

Contratos com curvas calculadas e que não envolvam contas de clientes próprios.

Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela B3 para início da liquidação financeira na modalidade Bilateral por Participante.

Contratos com curvas calculadas e que envolvam contas de clientes próprios.

Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela B3 para início da liquidação financeira na modalidade Bilateral por Participante.

Contratos onde pelo uma das curvas seja VCP e que não envolvam contas de clientes próprios.

Se Atualização de PU/Fator finalizada até a grade CTP12 - Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela B3 para início da liquidação financeira na modalidade Bilateral por Participante;

Se Atualização de PU/Fator não finalizada até a grade CTP12 - Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela B3 para grade BRUTA STR ou BRUTA BT, conforme o caso.

Possibilidade do exercício de opção no vencimento do contrato

Contratos onde pelo uma das curvas seja VCP e que envolvam contas de clientes próprios.	<p>Se Atualização de PU/Fator finalizada até a grade CTP12 - Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela B3 para início da liquidação financeira na modalidade Bilateral por Participante;</p> <p>Se Atualização de PU/Fator não finalizada até a grade CTP12 - Horário limite para o exercício de opção é aquele estabelecido pela B3 para grade SEM MODALIDADE.</p>
---	---

20 INTERMEDIÇÃO

A Intermediação de Contrato registra o valor da comissão, devida ao intermediador, que é cobrada da Parte que o contratou. Ocorrem com a digitação de ambas as partes envolvidas, o intermediador (quem recebe a comissão) e do Participante (quem paga a comissão).

Caso o intermediador cobre comissão das duas Partes envolvidas na operação, esta função deve ser realizada para o Participante e também para a Contraparte.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Lançamentos > Intermediação de Contrato

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

Tela Intermediação de Contrato

Registro de Intermediação de Contrato

Parte	<input type="text" value="05000"/>	<input type="text" value="00"/>	<input type="text" value="5"/>
Contraparte	<input type="text" value="10020"/>	<input type="text" value="00"/>	<input type="text" value="1"/>
Código do Contrato	<input type="text" value="14K00079310"/>		
Meu Número	<input type="text" value="125"/>		
Comissão	<input type="text" value="1"/>	<input type="text" value=""/>	<input type="text" value=""/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Observações:

- 1) O pagamento da comissão de intermediação deve ser na data de registro do contrato, mesmo que não coincida com a data de início, como no caso de contratos a termo.
- 2) Registro permitido para contratos de Pagamento Final.
- 3) O registro de comissão só é permitido entre contas próprias e para operações de Swap nas quais parte e contraparte são também contas próprias.
- 4) Para efeito de liquidação da comissão, o sistema irá verificar quais das contas informadas na "Tela Intermediação de Contratos" faz parte da operação indica pelo código do contrato e, desta conta, irá debitar a comissão (e, conseqüentemente, será creditada a outra conta).

Descrição dos Campos da Tela Filtro Cancelamento

Campo	Descrição	Tipo de Preenchimento	Regras
Parte	Código da conta que identifica o membro que está acessando o módulo.	Obrigatório	Conta B3
Contraparte	Código da conta que identifica o outro membro envolvido na operação.	Obrigatório	Conta B3
Código do Contrato	Número do contrato de Swap gerado pelo sistema.	Obrigatório	
Número Operação	Número atribuído à operação de intermediação.	Obrigatório	
Comissão	Valor percentual que será aplicado sobre o Valor Base inicial da operação, sob a forma de comissão a ser paga ao intermediador.	Obrigatório	Tipo: Numérico (2 (dois) números inteiros e 8 (oito) decimais)

21 CONSULTA CARACTERÍSTICA DO CONTRATO

O Participante pode consultar as características de um contrato de Swap com fluxo de caixa em que apareça em uma das pontas ou de um Participante do seu serviço de digitação.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Consultas > Características de Contrato de Swap

Arquivo: DPOSIÇÃO_SWAP

Mensageria: Não disponível

PRAZOS: A partir de D0 do registro

Observação: Caso a consulta ultrapasse 5.000 linhas, é enviado arquivo ao participante.

Tela de Consulta de Contratos

Consulta Contratos	
Parte (Nome Simplificado)	<input type="text"/>
Parte (Conta)	<input type="text"/> - <input type="text"/> - <input type="text"/>
Código do Contrato	<input type="text"/>
Tipo do Contrato	<input type="text"/>
Situação do Contrato	<input type="text"/>
Cesta Garantias	<input type="text"/>
Agenda Prêmio	<input type="text"/>
Reset	<input type="text"/>
Funcionalidades	<input type="text"/>
Indexador da Parte	<input type="text"/>
Indexador da Contraparte	<input type="text"/>
Contrato - Data de Registro	<input type="text"/> - <input type="text"/>
Data Vencimento	<input type="text"/> - <input type="text"/>
Evento - Data do Evento	<input type="text"/> - <input type="text"/>
Sistema Origem	<input type="text"/>
Código IF Sistema Origem	<input type="text"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

O Participante deve preencher pelo menos um campo da tela e clicar no botão Pesquisar.

Descrição dos Campos da Tela de Filtro Consulta Contratos

Campo	Descrição	Regras
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado do participante no contrato de Swap.	
Parte (Conta)	Conta própria do participante no contrato de Swap.	
Código do contrato	Código do Contrato a ser pesquisado.	
Tipo do Fluxo de Caixa	Tipo de fluxo utilizado na operação de Swap.	Caixa Seleção com as opções: Pagamento Final, Fluxo Constante, Fluxo Não Constante
Situação do Contrato	Indica a situação em que se encontra o contrato a ser pesquisado.	Caixa de Seleção com as opções: Acelerado, Aguardando Finalização, Antecipado Total, Antecipado Total por Reset, Cancelado, Confirmado, Transferido, A exercer, Aguardando Trigger In, Pendente Aprovação Aditamento, Aguardando Liquidação do Evento
Cesta de Garantias	Pode ser filtrado pela Cesta de Garantias do contrato.	Caixa de Seleção com as opções: Vazio (default), SIM e NÃO.
Agenda de Prêmio	Pode ser filtrado pela Agenda de Prêmios do contrato.	Caixa de Seleção com as opções: Vazio (default), SIM e NÃO.
Reset	Pode ser filtrado pelo Reset do contrato.	Caixa de Seleção com as opções: Vazio (default), SIM e NÃO.

Campo	Descrição	Regras
Funcionalidades	Pode ser filtrado pela Funcionalidade do contrato.	Caixa de Seleção com as opções pré-definidas: Sem Funcionalidade, Swap com Opção de Arrependimento, Knock In, Knock out, Knock In/Out, Swaption, Compound, Knock In com Opção, Knock Out com Opção, Swap com Prêmio
Indexador do Participante	Pode ser filtrado pelo indexador da curva do participante.	Caixa de Seleção com as opções pré-definidas
Indexador da Contraparte	Pode ser filtrado pelo indexador da curva da contraparte.	Caixa de Seleção com as opções pré-definidas.
Contrato - Data de Registro		Podem ser informados, isoladamente ou em conjunto, períodos de datas de emissão e/ou de vencimento.
Contrato - Data de Vencimento		Podem ser informados, isoladamente ou em conjunto, períodos de datas de emissão e/ou de vencimento.
Evento - Data do Evento		Podem ser informados, separadamente ou de forma combinada com as datas acima, um período de data de evento.
Sistema Origem		Campo de preenchimento opcional. Caixa combo-box com a opção: BMF Bovespa
Código IF Sistema Origem		Campo de preenchimento opcional. Campo de preenchimento com 14 (quatorze) caracteres.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

22 CONSULTA - AGENDA DE EVENTOS

A função permite que as partes envolvidas num contrato de Swap Fluxo de Caixa, consultem as datas dos eventos e suas respectivas operações - Troca de diferenciais de Juros ou de amortizações e prêmios - programadas num contrato não vencido (ou vencido e “Aguardando Liquidação Evento”)

A função também permite a realização da consulta mesmo que as partes envolvidas não façam parte do contrato.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Consultas > Agenda de Eventos

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZOS: A partir de D0 do registro

Tela de Filtro de Consulta de Agenda de Eventos

Consulta Agenda de Eventos

Código do Contrato 13H00000208

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Tela de Relação

Consulta Agenda de Eventos

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 24 de 24)
Data e Hora da Consulta: 21/02/2022 - 10:31:10

 Critério de pesquisa

Código do Contrato	Operação	Data Original	Data Ocorrência	Porta (Conta)	Porta (Nome Simplificado)	Estado
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	28/07/2013	29/07/2013	05000-00-5	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	28/07/2013	29/07/2013	05000-10-8	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	AMORTIZACAO	28/07/2013	29/07/2013	05000-00-5	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	AMORTIZACAO	28/07/2013	29/07/2013	05000-10-8	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	01/08/2013	01/08/2013	05000-00-5	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	01/08/2013	01/08/2013	05000-10-8	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	AMORTIZACAO	01/08/2013	01/08/2013	05000-00-5	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	AMORTIZACAO	01/08/2013	01/08/2013	05000-10-8	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	01/10/2013	01/10/2013	05000-00-5	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	01/10/2013	01/10/2013	05000-10-8	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	AMORTIZACAO	01/10/2013	01/10/2013	05000-00-5	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	AMORTIZACAO	01/10/2013	01/10/2013	05000-10-8	RIOBM	LIQUIDADO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	01/10/2015	01/10/2015	05000-00-5	RIOBM	NÃO LIQUIDADO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	01/10/2015	01/10/2015	05000-10-8	RIOBM	NÃO LIQUIDADO
13H00000208	AMORTIZACAO	01/10/2015	01/10/2015	05000-00-5	RIOBM	NÃO LIQUIDADO
13H00000208	AMORTIZACAO	01/10/2015	01/10/2015	05000-10-8	RIOBM	NÃO LIQUIDADO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	15/12/2017	15/12/2017	05000-00-5	RIOBM	ATIVO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	15/12/2017	15/12/2017	05000-10-8	RIOBM	ATIVO
13H00000208	AMORTIZACAO	15/12/2017	15/12/2017	05000-00-5	RIOBM	ATIVO
13H00000208	AMORTIZACAO	15/12/2017	15/12/2017	05000-10-8	RIOBM	ATIVO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	01/10/2024	01/10/2024	05000-00-5	RIOBM	ATIVO
13H00000208	PAGAMENTO DE JUROS	01/10/2024	01/10/2024	05000-10-8	RIOBM	ATIVO
13H00000208	AMORTIZACAO	01/10/2024	01/10/2024	05000-00-5	RIOBM	ATIVO
13H00000208	AMORTIZACAO	01/10/2024	01/10/2024	05000-10-8	RIOBM	ATIVO

Atualizar Voltar

<< 1 Exibir página >>

Obter no formato: Excel

Descrição dos Campos da Tela de Relação da Agenda de Eventos

Campo	Descrição
Código do Contrato	Código do contrato de Swap
Operação	Nome da operação que ocorrerá na “Data Ocorrência” do evento
Data Original	Indica a data do evento do contrato indicada no registro.
Data Ocorrência	<p>Indica a data em que o evento exibido no campo “Data Original” será liquidado.</p> <p>O campo “Data Ocorrência” é sensibilizado com uma data diferente da “Data Original” caso o contrato possua eventos registrado em dias não úteis e/ou contratos em que uma das curvas seja “<i>SOFR</i>” e seja indicado uma “<i>Data Liquidação</i>” diferente de D-0 (mais detalhes na seção: Registro de Contrato – Fluxo Não Constante).</p>
Parte (Conta)	Conta própria do participante no contrato de Swap.
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado do participante no contrato de Swap.
Estado	<p>Indica o estado daquele evento, sendo as opções disponíveis:</p> <ul style="list-style-type: none">• ATIVO: Evento ainda não ocorreu e se encontra ativo;• LIQUIDADO: Evento já ocorreu e foi liquidado; e• NÃO LIQUIDADO: Evento já ocorreu e não foi liquidado

Após clicar no link existente no campo “**Data Original**”, o sistema exibe tela com detalhes do evento selecionado.

Tela Detalhe Agenda de Eventos

Agenda de Eventos

Código do Contrato

13H00000208

Data Registro

26/07/2013

Valor Base

1.000.000,00

Data Início

26/07/2013

Data Vencimento

01/10/2024

Valor Amortizado

700.000,00

Parte		Contraparte	
Parte (Conta)	Parte (Nome Simplificado)	Contraparte (Conta)	Contraparte (Nome Simplificado)
05000.00-5	RIOBM	05000.10-8	RIOBM
Percentual	Curva	Percentual	Curva
100,00	VCP	100,00	VCP
+/-	Juros(% aa)	+/-	Juros(% aa)
	0,0000	+	6,7900
Data Atualizacao da Parte	Valor da Curva Atualizado - Parte	Data Atualizacao da Contraparte	Valor da Curva Atualizado - Contraparte
14/10/2020	300.000,00	27/02/2020	345.000,00

Dados do Evento

Data Original	Data Ocorrencia	Operação	Dias Úteis	Taxa TJMI	% Amortização	Tx Juros (ñ constante)	Estado
28/07/2013	29/07/2013	PAGAMENTO DE JUROS	1				LIQUIDADO
Lim. Inf.	Lim. Sup.						

Voltar

Sair

Nesta tela o Participante pode consultar detalhadamente o evento selecionado.

23 CONSULTA – FLUXO NÃO CONSTANTE

Por meio dessa função, o Participante tem acesso, para simples consulta, aos detalhes do fluxo de um contrato de Swap com fluxo de caixa não constante.

A função também permite a realização da consulta mesmo que as partes envolvidas não façam parte do contrato

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Consultas > Fluxo não Constante

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZOS: A partir de D0 do registro

Tela de Filtro de Consulta de Agenda de Eventos

Consulta de Fluxo de Caixa Não Constante

Código do Contrato

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

DIACÃO

24 CONSULTA – HISTÓRICO DE PARÂMETROS PARA DISPARO NO RESET

Através dessa função, o Participante tem acesso à lista de registros de parâmetros efetuados em um ou mais contratos.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Consultas > Histórico de Parâm. Disparo de Reset

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZOS: A partir de D0 do registro

Tela Filtro Histórico de Parâmetros Para Disparo No Reset

Histórico de Parâmetros para Disparo de Reset	
Parte (Nome Simplificado)	<input type="text"/>
Parte (Conta)	<input type="text"/>
Contraparte (Nome Simplificado)	<input type="text"/>
Contraparte (Conta)	<input type="text"/>
Código do Contrato	<input type="text"/>
Forma de Disparo	<input type="text"/>
Data Registro	<input type="text"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos Campos da Tela Filtro Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Campo	Descrição
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Parte (Conta)	Conta própria da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Conta)	Conta própria da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Código do Contrato	Código do Contrato a ser pesquisado.
Data Registro	Período em que foi registrado o Reset desejado.

25 CONSULTA – HISTÓRICO DE CURVAS MARCADAS A MERCADO

Através dessa função, o Participante tem acesso à lista de registros de parâmetros efetuados em um ou mais contratos.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Consultas > Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZOS: A partir de D0 do registro

Tela Filtro Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Consulta de Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Parte (Nome Simplificado)
Parte (Conta) - -
Nome Simplificado Contraparte
Contraparte (Conta) - -
Código do Contrato
Data de Registro / / - / /

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Descrição dos Campos da Tela Filtro Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Campo	Descrição
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Parte (Conta)	Conta própria da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Conta)	Conta própria da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Código do Contrato	Código do Contrato a ser pesquisado.
Data Registro	Período em que foi registrado o Reset desejado.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

DIACÇÃO

26 CONSULTA – HISTÓRICO DE RESET

Esta função permite ao Participante, consultar o histórico dos ajustes registrados e suas possíveis alterações.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Consultas > Histórico de Curvas Marcadas a Mercado

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZOS: A partir de D0 do registro

Tela Filtro Histórico de Reset

Histórico de Reset	
Parte (Nome Simplificado)	<input type="text"/>
Parte (Conta)	<input type="text"/>
Contraparte (Nome Simplificado)	<input type="text"/>
Contraparte (Conta)	<input type="text"/>
Código do Contrato	<input type="text"/>
Liquidação do Reset	<input type="text"/>
Data Registro	<input type="text"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos Campos da Tela Filtro Histórico de Reset

Campo	Descrição
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Parte (Conta)	Conta própria da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Contraparte (Conta)	Conta própria da contraparte no registro de Reset a ser pesquisado.
Código do Contrato	Código do Contrato a ser pesquisado.
Liquidação de Reset	Caixa de Seleção com as opções Sim e Não. Indica se existiu ou não liquidação no Reset desejado.
Data Registro	Período em que foi registrado o Reset desejado.

27 CONSULTA – RESUMO DE CONTRATOS

O resumo dos contratos permite visualizar o saldo de todos os contratos realizados por um Participante, segregado por data de vencimento e parâmetro.

A função também permite a realização da consulta mesmo que o participante não faça parte do contrato.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Consultas > Resumo de Contratos

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZOS: A partir de D+1 do registro

Tela Filtro Consulta Resumo dos Contratos

Filtro Consulta Resumo dos Contratos

Parte --

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Tela de Relação

Consulta Resumo dos Contratos

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 6 de 6)

Data e Hora da Consulta: 03/10/2023 - 18:52:45



Critério de pesquisa

Data de Vencimento	Curva	Saldo
22/11/2023	PREFIXADO 252D	-258,32
02/12/2023	IPCA	-8,34
10/01/2024	EURO WMR	420,42
23/02/2024	DI	7,80
09/06/2024	SOFR	-803,32
15/10/2042	DI	70,68

28 CONSULTA – CONTRATOS OPÇÃO COM ARREPENDIMENTO

Permite a visão do resultado parcial na data da consulta, positivo ou negativo, de todos os registros de contratos com opção de arrependimento de um determinado Participante.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Consultas > Contratos com Opção de Arrependimento

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRazos: A partir de D+1 do registro

Tela Filtro Consulta Resumo dos Contratos

Consulta Contratos Com Opção de Arrependimento do Participante

Parte
Data

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Tela de Relação

Consulta Contratos Com Opção de Arrependimento do Participante

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 7 de 7)

Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 16:39:41



Funcionalidade	Data Vencimento	Código do Contrato	Contraparte	Data Liquidação		Prêmio	Diferença
OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO	12/12/2014	14D00027512	10020.10-4	23/07/2014		212.121,00	-1.487.319,26
					Total na data		-1.487.319,26
KNOCK OUT COM OPÇÃO	15/06/2015	11I00000087	10020.10-4	23/07/2014		1,00	-97,54
					Total na data		-97,54
OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO	16/05/2016	13G00002978	10020.10-4	23/07/2014		1,00	-165,70
					Total na data		-165,70
					Total Geral		-1.487.582,50

<< < 1 Exibir página > >>

Atualizar

Voltar

Obter no formato:

Excel

29 CONSULTA – CONTRATOS DE SWAPTION/ COMPOUND

Permite a visão do resultado parcial na data da consulta, positivo ou negativo, de todos os registros de contratos com opção de arrependimento de um determinado Participante.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Consultas > Contratos de Swaption/ Compound

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZOS: A partir de D+1 do registro

Tela Filtro Contratos de Swaption/ Compound

Consulta de Contratos Swaption/Compound Participante

Parte
Data

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Tela de Relação

Consulta Contratos Com Opção de Arrependimento do Participante

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 7 de 7)

Data e Hora da Consulta: 23/07/2014 - 16:39:41



Critério de pesquisa

Funcionalidade	Data Vencimento	Código do Contrato	Contraparte	Data Liquidação		Prêmio	Diferença
OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO	12/12/2014	14D00027512	10020.10-4	23/07/2014		212.121,00	-1.487.319,26
					Total na data		-1.487.319,26
KNOCK OUT COM OPÇÃO	15/06/2015	11I00000087	10020.10-4	23/07/2014		1,00	-97,54
					Total na data		-97,54
OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO	16/05/2016	13G00002978	10020.10-4	23/07/2014		1,00	-165,70
					Total na data		-165,70
					Total Geral		-1.487.582,50

<< 1 Exibir página >>

Atualizar

Voltar

Obter no formato: Excel

30 CONSULTA – HISTÓRICO DE ALTERAÇÃO DE CONTRATO

Permite a visão do resultado parcial na data da consulta, positivo ou negativo, de todos os registros de contratos com opção de arrendimento de um determinado Participante.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

Menu Swap > Consultas > Consulta Histórico Alteração de Contrato

Arquivo: Não disponível

Mensageria: Não disponível

PRAZOS: A partir de D+1 do registro

Tela Filtro Contratos de Swaption/ Compound

Consulta Historico - Alteração de Contratos	
Parte (Nome Simplificado)	<input type="text"/>
Parte (Conta)	<input type="text"/> <input type="text"/> <input type="text"/>
Código do Contrato	<input type="text"/>
Tipo do Contrato	<input type="text" value="v"/>
Situação do Contrato	<input type="text" value="v"/>
Indexador da Parte	<input type="text" value="v"/>
Indexador da Contraparte	<input type="text" value="v"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Tela de Relação

Descrição dos Campos Tela Filtro Consulta Histórico

Campo	Descrição	Regras
Parte (Nome Simplificado)	Nome simplificado da parte a ser pesquisada.	Conta própria da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Parte (Conta)	Conta própria da parte.	Conta própria da parte no registro de Reset a ser pesquisado.
Código do Contrato	Código do Contrato a ser pesquisado.	
Tipo de Fluxo de Caixa	Indica o tipo do fluxo de caixa do contrato a ser pesquisado.	Caixa de Seleção: Constante, Não Constante, Pagamento Final
Situação do Contrato	Informar o estado atual do contrato.	Caixa de Seleção: Aguardando Finalização, Antecipado Total, Antecipado Total Por Reset, Cancelado, Confirmado, Transferido, A Exercer, Aguardando Trigger In, Pendente de Aprovação, Aguardando Liquidação.
Indexador do Participante	Informar o indexador do Participante no contrato.	Caixa de Seleção com lista de ativos pré-definida
Indexador da Contraparte	Informar o indexador da Contraparte no contrato.	Caixa de Seleção com lista de ativos pré-definida.

31 INFORMAÇÕES ADICIONAIS

31.1 Ativos disponíveis e cadastro de novos ativos

Os ativos disponíveis para utilização no módulo de Swap Sem Contraparte Central Garantidora podem ser consultados no arquivo público

- Curvas Calculadas: Lista das curvas disponíveis e seu código de referência externa (para registro via arquivo): **AAAAMMDD_IndexadoresSWAP**
- Lista das Ações Nacionais disponíveis para utilização no Swap Pagamento Final (curva ACOES): **AAAAMMDD _Ativos_Subjacentes**
- Lista das Mercadorias disponíveis para utilização no Swap Pagamento Final/Fluxo de Caixa (curva COMMODITIES): **AAAAMMDD _ Mercadorias**
- Curvas VCP's: AAAAMMDD _Ativos_Subjacentes

Disponível em:

1) <ftp://ftp.cetip.com.br/Public> ou:

2) Sistema NoMe > Transferência de arquivos > Arquivo > Arquivos Públicos

Solicitações para inclusão de novos indexadores podem ser feitas através do e-mail: op.derivativos@b3.com.br

LISTA DE CURVAS CALCULADAS		MODALIDADE DO SWAP		
CLASSE DE ATIVO	CURVA	PAGAMENTO FINAL	FLUXO DE CAIXA - CONSTANTE	FLUXO DE CAIXA - NÃO CONSTANTE
ACOES	ACOES	Sim	Não	Não
COMMODITIES	COMMODITIES	Sim	Sim	Sim
COMMODITIES	OURO Ajuste	Sim	Não	Não
INDICES	IBOVESPA	Sim	Não	Não
INDICES DE PRECOS	INPC, IGP-M, IGP-DI	Sim	Não	Não
INDICES DE PRECOS	IPCA	Sim	Não	Sim
JUROS	PREFIXADO 252D, PREFIXADO 360D, DI 360D, DI	Sim	Sim	Sim
JUROS	SELIC, TJLP, TR	Sim	Não	Não
JUROS INTERNACIONAIS	SOFR	Não	Não	Sim
JUROS INTERNACIONAIS	LIBOR (DOLAR, EURO, IENE, LIBRA) - (01M, 03M, 06M e 12M)	Sim	Sim	Sim
JUROS INTERNACIONAIS	TJMI	Sim	Sim	Sim
TAXAS DE CAMBIO	TODAS	Sim	Sim	Sim

31.2 Arquivos

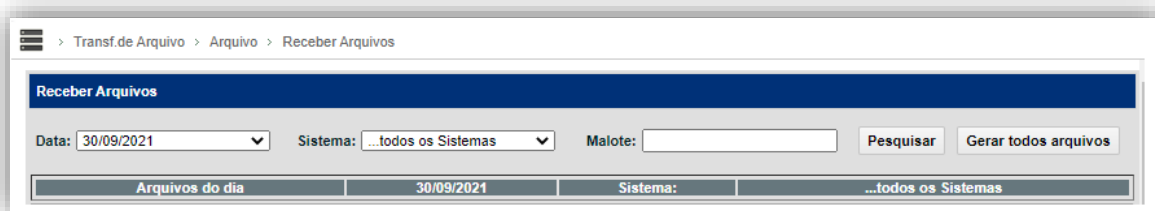
É possível consultar o layout dos arquivos no seguinte caminho:

- b3.com.br > Regulação > Estrutura normativa > Manuais de Operações > Manuais Operacionais - Balcão B3 > Enviar Arquivos
- b3.com.br > Regulação > Estrutura normativa > Manuais de Operações > Manuais Operacionais - Balcão B3 > Receber Arquivos

31.3 Consulta de Arquivos e Relatórios

Para baixar os arquivos e relatórios, o Participante deve seguir o caminho abaixo:

Transf.de Arquivo > Arquivo > Receber Relatórios



31.4 Antecipação

Possibilidade de antecipação nos contratos com Fluxo Constante e Não Constante

Possibilidade de antecipação nos contratos com FLUXO Constante e Não Constante

	Antecipação Parcial	Antecipação Total
Contrato a termo	Sim, mas somente da data de início até D-1 da data de vencimento	Sim. De D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento.
Contrato à vista	Sim, De D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento	Sim. De D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento.

Possibilidade de antecipação nos contratos com FLUXO Constante e Não Constante

Operação de antecipação decorrida.	Sim, somente para contratos que envolvam contas de clientes 1. É acatado registro de antecipação parcial retroativa de até 2 (dois) dias úteis, se e somente se não houver ocorrido evento no período entre a data do registro e a data da antecipação retroativa. Se um contrato for registrado a termo e já iniciou, as antecipações retroativas não podem se referir à data anterior ao dia de início do contrato.	Sim, somente para contratos que envolvam contas de clientes 1 e registro retroativo de até 2 (dois) dias úteis e de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento.
Operação de Antecipação em data de eventos com amortização	Sim	Sim
Operação de Antecipação em data de eventos apenas de juros	Sim	Sim
Operação de Antecipação decorrida em Datas de Eventos	Sim	Não

Possibilidade de ANTECIPAÇÃO nos Contratos de Pagamento Final

	Antecipação Parcial	Antecipação Total
Contrato a termo	Sim, de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento	Sim, de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento
Contrato à vista	Sim, de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento	Sim, de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento
Operação de antecipação decorrida.	Sim, somente para contratos que envolvam contas de clientes 1. É acatado registro de antecipação parcial retroativa de até 2 (dois) dias úteis. Se um contrato for registrado a termo e já iniciou, as antecipações retroativas não podem se referir à data anterior ao dia de início do contrato.	Sim, somente para contratos que envolvam contas de clientes 1 e registro de até 2 (dois) dias úteis e de D+1 da data de registro até D-1 da data de vencimento.

Possibilidades de antecipação nos contratos COM e SEM MODALIDADE

Tipos de Contratos	Knock In	Knock Out	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio
À vista Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.	No primeiro dia útil posterior à data de início até a data do vencimento, exclusive.	No primeiro dia útil posterior à data de início até a data do vencimento, exclusive se não disparar o trigger.	No primeiro dia útil posterior à data de início até a data do vencimento, exclusive, se o trigger não for disparado.	Não se aplica.	No primeiro dia útil posterior à data de início (D), até a data de vencimento, exclusive.	No primeiro dia útil posterior à data de início (D), até a data de vencimento, exclusive.
À termo Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N.	Não se aplica.	Não se aplica.	Não se aplica.	Se exercida a opção, no primeiro dia útil posterior a D+N, até data de vencimento, exclusive.	Não se aplica.	No primeiro dia útil posterior a D+N, até data de vencimento, exclusive.
À vista com conta Cliente1 Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.	No primeiro dia útil posterior à data de início até a data do vencimento, exclusive	No primeiro dia útil posterior a D, até a data de vencimento, exclusive	No primeiro dia útil posterior à data de início até a data do vencimento, exclusive. Se o trigger não for disparado	Não se aplica.	No primeiro dia útil posterior à data de registro (D+1 ou 2), até a data de vencimento, exclusive.	No primeiro dia útil posterior à data de registro (D+1 ou 2), até a data de vencimento, exclusive.
À termo decorrido Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.	Não se aplica.	Não se aplica.	Não se aplica.	Se exercida a opção, no primeiro dia útil posterior a D+N, até data de vencimento, exclusive.	Não se aplica.	No primeiro dia útil posterior a D+N, até data de vencimento, exclusive.

[SUMÁRIO](#)
[REGISTRO](#)
[FUNCIONALIDADES](#)
[ANTECIPAÇÃO](#)
[CESSÃO](#)
[ALTERAÇÃO](#)
[EXERCÍCIO DA OPÇÃO](#)
[INTERMEDIACÃO](#)
[CONSULTAS](#)
[INFORMAÇÕES ADICIONAIS](#)

31.5 Cessão

Possibilidades de Cessão nos contratos COM e SEM MODALIDADE

Tipos de Contratos	Knock In	Knock Out	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio
À vista Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive. Independente do disparo do trigger.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive. Desde que o trigger não tenha sido disparado.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive. Independente do disparo do trigger de In.	Não se aplica.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive.
À termo Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N.	Não se aplica.	Não se aplica.	Não se aplica.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive.	Não se aplica.	A partir de D, até a data de vencimento, exclusive.
À vista com conta Cliente¹ Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive. Independente do disparo do trigger.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive. Desde que o trigger não tenha sido disparado.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive. Independente do disparo do trigger de In.	Não se aplica.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive.	A partir de D+1 ou 2, até a data de vencimento, exclusive.

Tipos de Contratos	Knock In	Knock Out	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio
À termo decorrido Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.	Não se aplica.	Não se aplica.	Não se aplica.	A partir de D+1 ou 2, até a data vencimento, exclusive.	Não se aplica.	A partir de D+1 ou 2, até a data vencimento, exclusive.

CONTRATOS SEM MODALIDADE	
À vista Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.
À termo Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N.	A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.
À vista com conta de Cliente¹ Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.	A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.
À termo decorrido Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.	A partir da data de registro até a data de vencimento, exclusive.

Cessão referente aos prêmios

Cessão de contrato e a situação dos prêmios.	
Pagamento do PRÊMIO da OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO .	Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade KNOCK IN . (O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).	Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Cessão de contrato e a situação dos prêmios.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK OUT**.

(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN-OUT**.

(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **SWAPTION A TERMO**.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 na data de início).

Os direitos são transferidos.

Se a data da cessão for posterior à data de pagamento do Prêmio 2, o valor financeiro da transferência do prêmio, informado para a cessão, inclui os dois pagos anteriormente.

Se a data da cessão for anterior à data de pagamento do Prêmio 2, o valor financeiro da transferência do prêmio informado para a cessão, inclui somente o Prêmio 1. E a obrigação do Prêmio 2 é transferida para o novo titular se desejar exercer a opção.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **COMPOUND SWAPTION**.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).

Se a data da cessão for posterior à data de pagamento do Prêmio 2, o valor financeiro da transferência do prêmio, informado para a cessão, inclui os dois pagos anteriormente.

A data da cessão for anterior à data de pagamento do Prêmio 2, o valor financeiro da transferência do prêmio informado para a cessão, inclui somente o Prêmio 1. E a obrigação do Prêmio 2 é transferida para o novo titular se desejar exercer a opção.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **SWAP COM PRÊMIO**.

Prêmio já foi pago.

CONTRATOS SEM MODALIDADE

PRAZOS

À vista

Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D.

A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D) até a data de vencimento, exclusive.

À termo

Registrado em D, de operação pactuada em D, com início em D+N.

A partir do primeiro dia útil posterior à data de registro (D+N+1) até a data de vencimento, exclusive.

À vista com conta cliente¹

Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D.

A partir do primeiro dia útil posterior à data de início (D+1 ou 2) até a data de vencimento, exclusive.

CONTRATOS SEM MODALIDADE	PRAZOS
À termo decorrido Registrado em D+1 ou 2, de operação pactuada em D, com início em D+N.	A partir do primeiro dia útil posterior à data de registro (D+N+1) até a data de vencimento, exclusive.

Antecipação referente aos prêmios e comissões

Situação dos prêmios e comissões na antecipação dos contratos	
Pagamento da COMISSÃO de intermediação de contrato na DATA DE INÍCIO .	A comissão tem curso normal de liquidação.
Pagamento do PRÊMIO da OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO .	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade KNOCK IN . (O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade KNOCK OUT . (O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade KNOCK IN-OUT . (O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).	O pagamento de prêmio tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade SWAPTION A TERMO . (Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 na data de início).	Pagamento Prêmio 1, tem curso normal. Pagamento Prêmio 2, depois de exercida a opção, o pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade COMPOUND SWAPTION . (Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).	Pagamento Prêmio 1, tem curso normal. Pagamento Prêmio 2: <ul style="list-style-type: none"> • Antes de exercida a opção: É cancelado automaticamente. <ul style="list-style-type: none"> ▪ Depois de exercida a opção: O pagamento do Prêmio 2 tem curso normal.
Pagamento de PRÊMIO da modalidade SWAP COM PRÊMIO .	Pagamento Prêmio 1, tem curso normal.

31.6 Contratos com Funcionalidades

➤ Swap com opção de arrependimento

Participante titular paga prêmio na data de registro para ter direito de, poder exercer a opção de arrependimento sobre o contrato, o que o rescindir sem apuração de resultado financeiro deste. Para contratos com esta funcionalidade, na data de vencimento, exclusivamente, o sistema realiza o exercício automático da Opção de Arrependimento caso o ajuste do Swap seja negativo para o titular da Opção de Arrependimento. O Exercício da Opção de Arrependimento antes da data de vencimento deve ser realizado mediante comando das partes do contrato na função “Exercício de Opção”.

Swaption a Termo

Operação através da qual uma das partes, mediante o pagamento de um prêmio à outra parte, adquire o direito de, em uma determinada data futura, decidir se irá realizar um Swap.

Assim, o Participante titular paga prêmio 1 na data de registro para entrar em uma opção cujo ativo objeto é um contrato de Swap com início a partir de uma data futura. Nesta, se pretender entrar no Swap, deve exercer a opção, pagando o prêmio 2.

➤ Compound Swaption

Participante titular paga prêmio 1 na data de registro para entrar em uma opção que lhe dê o direito de permanecer no contrato de Swap com início a partir da própria data de registro.

Na data de exercício, pré-determinada no registro, se pretender permanecer no Swap, deve exercer a opção, pagando o prêmio 2.

➤ Knock In

Contrato somente produz direitos e obrigações a partir de um determinado patamar de variação da curva ou do parâmetro que a compõe, informados como trigger (gatilho).

Portanto, trata-se de operação através do qual uma das partes, mediante o pagamento de prêmio à outra parte, estabelece a(s) condição (ões) requerida(s) para que um Swap tenha validade.

➤ Knock Out

Contrato somente deixa de produzir direitos e obrigações a partir de um determinado patamar de variação da curva ou do parâmetro que a compõe, informados como trigger (gatilho).

Portanto, trata-se de operação através do qual uma das partes, mediante o pagamento de prêmio à outra parte, estabelece em que condição (ões) um Swap será rescindido.

➤ Knock In-Out

Combinação do uso de **Knock In** e **Knock Out**, nesta ordem.

➤ Swap com Knock In e com Opção de Arrependimento

Contrato em que uma das partes, mediante o pagamento de prêmio à outra parte:

Estabelece em que condição (ões) (trigger) o contrato produzirá efeitos; e

Adquire o direito de, ocorrendo o trigger, rescindir o Swap a qualquer tempo, inclusive na data de vencimento.

➤ **Swap com Knock Out com Opção de Arrependimento**

Contrato em que uma das partes, mediante o pagamento de prêmio à outra parte:

Estabelece em que condição (ões) (trigger) o contrato será rescindido; e

Adquire o direito de, caso o trigger não ocorra, rescindir o Swap a qualquer tempo, inclusive na data de vencimento.

➤ **Swap com Knock In, Knock Out ou Knock In-Out Forma de Verificação de Disparo Discreto**

Diária - Verifica diariamente se o trigger foi disparado (DI, Selic, TJLP, Ouro, Dólar, Dólar Comercial Exponencial, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, EURO WMR, Iene, Franco Suíço, Franco Suíço BCE, Franco Suíço WMR, Peso Mexicano e Ibovespa de Liquidação).

Regra de Disparo do Trigger:

Se, taxa ou Valor de fechamento em D-1 \leq Trigger \leq D0 ☐ Dispara Trigger na Alta.

Se, taxa ou Valor de fechamento em D-1 \geq Trigger \geq D0 ☐ Dispara Trigger na Baixa.

Final - Verifica apenas na data do vencimento do contrato, se o trigger foi disparado (DI, Selic, TJLP, Ouro, Dólar, Dólar Comercial Exponencial, EURO/COM.EUROPEIA, EURO BCE, EURO WMR, Iene, Franco Suíço, Franco Suíço BCE, Franco Suíço WMR e Peso Mexicano, Ibovespa de Liquidação, IGP-M, IGP-DI, INPC e TR).

Regra de Disparo do Trigger:

Se 1,00000000 \leq Fator Trigger \leq Fator Resultante da Curva ☐ Dispara Trigger na Alta.

Se 1,00000000 \geq Fator Trigger \geq Fator Resultante da Curva ☐ Dispara Trigger na Baixa.

➤ **Swap com Knock In, Knock Out ou Knock In-Out - Forma de Verificação de Disparo Contínuo (Ibovespa de Liquidação Contínuo)**

Exclusivo quando a curva utilizada para trigger for "IBOVESPA Liquidação Contínuo".

A verificação do viés do trigger determinará qual cotação do Ibovespa será utilizada para o disparo do trigger:

Se for trigger de Baixa - cotação utilizada para disparo será o Ibovespa Mínimo;

Se for trigger de Alta - cotação utilizada para disparo será o Ibovespa Máximo.

Contrato somente deixa de produzir direitos e obrigações a partir de um determinado patamar de variação da curva ou do parâmetro que a compõe, informados como trigger (gatilho).

Diária - Verifica diariamente se o trigger foi disparado.

Regra de Disparo do Trigger:

Se Valor máximo em (D-1, D-2 ou D-3) \leq Trigger \leq D0 ☐ Dispara Trigger na Alta.

Se Valor mínimo em (D-1, D-2 ou D-3) \geq Trigger \geq D0 ☐ Dispara Trigger na Baixa.

Final - Verifica apenas na data do vencimento do contrato, se o trigger foi disparado

Regra de Disparo do Trigger:

Se 1,00000000 \leq Fator Trigger \leq Fator Resultante da Curva ☐ Dispara Trigger na Alta.

Se 1,00000000 \geq Fator Trigger \geq Fator Resultante da Curva ☐ Dispara Trigger na Baixa.

➤ **Swap com Limitador de Alta ou de Baixa**

Contrato em que as partes estabelecem patamar máximo e/ou mínimo para uma ou ambas as curvas.

Limitador de Alta: Patamar máximo da curva do Swap, previamente estabelecido pelas partes, a ser utilizado no cálculo de Diferencial.

Limitador de Baixa: Patamar mínimo da curva do Swap, previamente estabelecido pelas partes, a ser utilizado no cálculo de Diferencial.

➤ **Swap com Limitador por Terceira Curva**

Contrato em que as partes estabelecem uma terceira curva como patamar máximo ou mínimo para uma das curvas.

➤ **Swap com Prêmio**

Contrato que estabelece que uma das partes efetue o pagamento de prêmio na data de registro.

Observações: EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)

EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)

EURO-WMR = Paridade USD/EUR (WMR) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)

FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]

FRANCO SUÍÇO WMR = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (WMR) / Paridade USD/EUR (WMR)]

Pagamento de Rebate

Pagamento de Rebate			
Knock In	No vencimento do contrato de Swap. Independente da forma de verificação do trigger.		
Knock Out	Três possibilidades: 1 - Na data de disparo do trigger de Knock Out; 2 - No vencimento original do contrato; e 3 - Em n dias úteis após o disparo, limitado à data de vencimento. Independente da forma de verificação do trigger.		
Knock In-Out	Knock In	Knock Out	Data do Rebate
	Verificação dos Triggers	Verificação dos Triggers	Na data do Knock Out; No vencimento;
	Diária	Diária	Em n dias úteis após Knock Out, limitado à data de vencimento.
	Diária	Final	No vencimento.
	Final	Final	No vencimento.

Observação: O Pagamento de Rebate é realizado na modalidade de Liquidação Bilateral.

Registro de Funcionalidades Documentacional

As funcionalidades **Knock In**, **Knock Out**, **Knock In com Opção**, **Knock Out com Opção**, **Limitador por fator arbitrado (inferior ou superior)**, quando utilizadas com **indexador VCP** é de **registro documentacional**, ou seja, não há verificação de disparo do trigger ou de utilização dos limitadores, exceto para a funcionalidade **Knock Out com Arrependimento**, onde o Participante pode exercer a opção de arrependimento de acordo com a regra já estabelecida no Módulo de Swap.

O Registro Documentacional das funcionalidades **Knock In**, **Knock Out**, **Knock In com Opção**, **Knock Out com Opção**, **Limitador por Fator Arbitrado (inferior ou superior)**, esta disponível para uso em todos os VCPs.

31.7 Funcionalidade de Opção de Arrependimento para cenários de Opções Flexíveis

A funcionalidade de Opção de Arrependimento pode ser utilizada para replicar payoff's de Opções Flexíveis e para isso é necessário observar a forma de preenchimento das curvas das partes do contrato e do titular da funcionalidade “Opção de Arrependimento”, para replicar corretamente o cenário desejado.

A tabela abaixo tem o intuito de auxiliar a visualização de cenários possíveis, de acordo com **as curvas indicadas** na Parte e Contraparte e **quem foi indicado como titular da funcionalidade**:

Dados informados no registro do Swap			Cenário da Opção Flexível replicado		
PARTE	CONTRAPARTE	TITULAR DA FUNCIONALIDADE “OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO”	TIPO OPÇÃO	PARTE	CONTRAPARTE
PRÉ	Ativo Subjacente	PARTE	PUT	COMPROU	VENDEU
PRÉ	Ativo Subjacente	CONTRAPARTE	CALL	VENDEU	COMPROU
Ativo Subjacente	PRÉ	PARTE	CALL	COMPROU	VENDEU
Ativo Subjacente	PRÉ	CONTRAPARTE	PUT	VENDEU	COMPROU

31.8 Cruzamento de Funcionalidades x Operações

Operações e Funcionalidades	Knock In com/ sem opção	Knock Out com/sem opção	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio	Opção de Arrependimento
Registro em D com início em D-1 ou D-2	P	P	P	I	P	P	P
Antecipação	P	P	P	P	P	P	P
Antecipação entre clientes (em D-1).	P	P	P	P	P	P	P
Intermediação de Contrato	P	P	P	P	P	P	P
Opção de Arrependimento	I	I	I	I	I	I	N.A

Operações e Funcionalidades	Knock In com/ sem opção	Knock Out com/sem opção	Knock In-Out	Swaption a Termo	Compound Swaption	Swap com Prêmio	Opção de Arrependimento
Limite Fator Arbitrado	P	P	P	P	P	P	P
Limite 3ª Curva	P	P	P	P	P	P	P
Cessão de Contratos	P	P	P	P	P	P	P
Operação a Termo	I	I	I	P	I	P	P
Operação a Termo com Valor Base Corrigido	I	I	I	P	I	P	P
Início em dia não útil	I	I	I	I	I	I	I
Término em dia não útil	P	P	P	P	P	P	P
TR escolhida	P	P	P	P	P	P	P
Rebate de Prêmio	I	P	P	I	I	I	I
Knock In	N.A	I	I	I	I	I	P
Knock Out	P	N.A	I	I	I	I	P
Swaption a Termo	I	I	I	N.A	I	I	I
Compound Swaption	I	I	I	I	N.A	I	I
Swap com prêmio	I	I	I	I	I	N.A	I
Cupom Limpo	P	P	P	P	P	P	P

Legenda: P = Possível; I = Impossível e N.A. = Não se aplica.

31.9 Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 1

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Agenda de Prêmios	Reset	Limitador Fator	Limitador Terceira Curva	Termo
Agenda de Prêmios	N.A	S	S	S	S
Reset	S	N.A	N	N	S
Limitador Fator	S	N	N.A	N	S
Limitador Terceira Curva	S	N	N	N.A	S
Termo	S	S	S	S	N.A
AÇÕES	S	N	N	N	S
DI	S	S	S	S	S
DI 360d	S	N	S	S*****	S

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Agenda de Prêmios	Reset	Limitador Fator	Limitador Terceira Curva	Termo
SELIC	S	N	S	S	S
PREFIXADO 252	S	S	N	S*****	S
PREFIXADO 360	S	S	N	N*****	S
DOLAR	S	S	S	S	S
DOLAR COMERCIAL EXPONENCIAL	S	N	S	S	S
EURO/COM.EUROPEIA	S	N	S	S	S
EURO-BCE	S	N	S	S*****	S
IENE	S	N	S	S	S
FRANCO SUIÇO	S	S	S	S	S
PESO MEXICANO	S	S	S	S	S
TR	S	N	S	S	S
TJLP	S	N	S	S	S
LIBOR	S	S	S**	S*****	S
TJMI	S	S	S**	S*****	S
IGPM	S	N	S	S	S
IGPDI	S	N	S	S	S
INPC	S	N	S	S	S
OURO	S	S	S	S	S
IBOVESPA Liquidação	S	N	S	S*****	S
IBOVESPA Liquidação Contínuo	S	N	N	N	N
VCP	S	S	S***	S*****	S
COMMODITY	S	N	S	S	S

Legenda: S = Sim; N = Não e N.A = Não se aplica.

* exceto no caso de variação cambial Outros

** somente o específico da curva

*** funcionamento do limitador fator documental

**** exceto nos contratos que envolvam contas de cliente 1

***** Nos casos de contratos com funcionalidade Terceira Curva há possibilidade de utilização desta curva somente como indexador do contrato.

Observações:

- EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)
- EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

- EURO-WMR = Paridade USD/EUR (WMR) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)
- FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
- FRANCO SUÍÇO WMR = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (WMR) / Paridade USD/EUR (WMR)]

31.10 Cancelamento referente aos prêmios e comissões

Cancelamento de contrato e a situação dos prêmios e comissões

Pagamento da COMISSÃO de intermediação de contrato na **DATA DE REGISTRO**.

Quando o cancelamento do contrato coincidir com a data de registro, seja à vista ou a termo:

- **Se o registro de contrato é entre clientes ou entre Participante e cliente próprio:** O sistema cancela automaticamente a comissão de intermediação.
- **Se o registro de contrato é do Participante:** O estorno da comissão de intermediação é obrigatório, se ainda não liquidada financeiramente.

Quando o cancelamento do contrato é posterior a data de registro, seja à vista ou a termo, e registro de contrato que envolva clientes, não há cancelamento da comissão de intermediação.

Pagamento do PRÊMIO da **OPÇÃO DE ARREPENDIMENTO**.

Quando o cancelamento ocorrer:

- Na data de registro, o sistema estorna automaticamente o prêmio da opção de arrependimento, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.
 - Em data posterior à data de registro, o prêmio da opção de arrependimento gerado não será estornado.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN**.

(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK OUT**.

(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **KNOCK IN-OUT**.

(O pagamento é integral e sempre no registro do contrato).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Cancelamento de contrato e a situação dos prêmios e comissões

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **SWAPTION A TERMO**.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).

Quando o cancelamento ocorrer:

- Em data posterior à data de registro, pagamento de Prêmio 1 tem curso normal e do Prêmio 2 é cancelado automaticamente.
 - Na data de registro, o sistema cancela automaticamente o pagamento do Prêmio 2 e do Prêmio 1, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **COMPOUND SWAPTION**.

(Prêmio 1 é sempre no registro do contrato e Prêmio 2 é em uma Data 2 futura).

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro, o sistema cancela automaticamente o pagamento do Prêmio 2 e do Prêmio 1, caso este não tenha sido liquidado financeiramente.

Pagamento de PRÊMIO da modalidade **SWAP C/ PRÊMIO**.

Quando o cancelamento ocorrer na data de registro e se o prêmio ainda não foi liquidado financeiramente o sistema cancela automaticamente o pagamento do prêmio.

31.11 Registro Contrato com curva VCP

Nos registros de contratos com curva VCP os campos **Denominação**, do grupo de informações **Se Curva = VCP**, obedece ao seguinte critério de preenchimento:

Parte	Contraparte	Curva da Parte VCP	Curva da Contraparte VCP	Preenchimento Denominação Parte	Preenchimento Denominação Contraparte
Mercado	Mercado	X	X	X	X
Mercado	Mercado	X		X	
Mercado	Mercado		X		X
Mercado	Conta cliente 1	X	X	X ¹	
Mercado	Conta cliente 1	X		X	
Mercado	Conta cliente 1		X		X
Mercado	Conta cliente 2	X	X	X	X

Parte	Contraparte	Curva da Parte VCP	Curva da Contraparte VCP	Preenchimento Denominação Parte	Preenchimento Denominação Contraparte
Mercado	Conta cliente 2	X		X	
Mercado	Conta cliente 2		X		X
Conta cliente 1	Conta cliente 1	X	X	X ¹	
Conta cliente 1	Conta cliente 1	X		X	
Conta cliente 1	Conta cliente 1		X		X
Conta cliente 2	Conta cliente 2	X	X	X	X
Conta cliente 2	Conta cliente 2	X		X	
Conta cliente 2	Conta cliente 2		X		X

Observações:

- 1) O campo denominação da Parte deve ser preenchido com a descrição da curva VCP de ambas as Partes.
- 2) Agente Mercado = Participantes detentores de conta própria.

31.12 Contratos com limitador

Os contratos de swap permitem utilização de limitador superior e/ou inferior, dependendo do tipo de swap (pagamento final, fluxo constante ou não constante) e do indexador, conforme detalhado na tabela abaixo:

Categoria do indexador	Pagamento final	Fluxo de Caixa Constante	Fluxo de Caixa Não Constante
Ações	N/A	N/A	N/A
Commodities	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior e/ ou Superior
Índices	Inferior ou Superior	N/A	N/A
Índices de Preços	N/A	N/A	N/A
Juros			
• <i>DI</i>	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior e/ ou Superior
• <i>DI 360D</i>	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior e/ ou Superior
• <i>Prefixado 252D</i>	N/A	N/A	Inferior e/ ou Superior
• <i>Prefixado 360D</i>	N/A	N/A	Inferior e/ ou Superior

• SELIC	Inferior ou Superior	N/A	N/A
• TJLP	Inferior ou Superior	N/A	N/A
• TR	Inferior ou Superior	N/A	N/A
Juros Internacionais	Inferior e/ou Superior	Inferior e/ou Superior	Inferior e/ou Superior
Taxas de Câmbio	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior e/ou Superior
VCP (não calculado)	Inferior ou Superior	Inferior ou Superior	Inferior e/ou Superior

Com relação aos valor dos limitadores:

- Para contratos do tipo Fluxo de Caixa CONSTANTE, **não é possível** informar valores de limitadores diferentes por fluxo, ou seja, em todos os fluxos **o valor do limitador se repete**;
- Para contratos do tipo Fluxo de Caixa NÃO CONSTANTE, **é possível** informar valores de limitadores diferentes por fluxo, ou seja, cada fluxo **poderá ter um valor de limitador diferente**.

31.13Cruzamento de Funcionalidades x Curvas para atualização - Tabela 2

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Opção de Arrependimento	Knock In e/ou Knock Out	Knock In com Opção ou Knock Out com Opção	Swap com Prêmio	Swaption a Termo	Compound Swaption
Agenda de Prêmios	S	S	S	S	S	S
Reset	N	N	N	N	N	N
Limitador Fator	S	S	S	S	S	S
Limitador Terceira Curva	S	S	S	S	S	S
Termo	S	N	N	S	S	N
DI	S	S	S	S	S	S
AÇÕES	S	N	N	S	N	N
DI 360d	S	N	N	S	S	S
SELIC	S	S	S	S	S	S
PREFIXADO 252	S	N	N	S	S	S
PREFIXADO 360	S	N	N	S	S	S
DOLAR	S	S	S	S	S	S
DOLAR COMERCIAL EXPONENCIAL	S	S	S	S	S	S
EURO/COM.EUROPEIA	S	S	S	S	S	S

Funcionalidades e Curvas para Atualização	Opção de Arrependimento	Knock In e/ou Knock Out	Knock In com Opção ou Knock Out com Opção	Swap com Prêmio	Swaption a Termo	Compound Swaption
EURO-BCE	S	S	S	S	S	S
IENE	S	S	S	S	S	S
FRANCO SUÍÇO	S	S	S	S	S	S
PESO MEXICANO	S	S	S	S	S	S
TR	S	S	S	S	S	S
TJLP	S	S	S	S	S	S
LIBOR	N	N	N	S	N	N
TJMI	N	N	N	S	N	N
IGPM	S	S	S	S	S	S
IGPDI	S	S	S	S	S	S
INPC	S	S	S	S	S	S
OURO	S	S	S	S	S	S
IBOVESPA Liquidação	S	S	S	S	S	S
IBOVESPA Liquidação Contínuo	N	S	S	N	N	N
VCP	S	N*	N*	S	S	S
COMMODITY	S	S	S	S	S	S

Legenda: S = Sim e N = Não

* exceto no caso de Registro de Funcionalidades Documentacional

Observações:

- EURO/COM.EUROPEIA = PTAX BRL/EUR Venda (BACEN – 978)
- EURO-BCE = Paridade USD/EUR (BCE) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)
- EURO-WMR = Paridade USD/EUR (WMR) x PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220)
- FRANCO SUÍÇO BCE = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (BCE) / Paridade USD/EUR (BCE)]
- FRANCO SUÍÇO WMR = PTAX BRL/USD Venda (BACEN – 220) / [Paridade CHF/EUR (WMR) / Paridade USD/EUR (WMR)]

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

32 ATUALIZAÇÃO DA VERSÃO

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
04/12/2023	27/02/2024	“Juros Internacionais Overnight”	Ajustes realizados no campo “Data Liquidação” referente a descrição e a regra adotada.
04/12/2023	20/12/2023	Manual de Swap	Nova estrutura do Manual de Operações – Swap.
04/12/2023	04/12/2023	Swap “Fluxo de Caixa Não Constante”	Possibilidade de informar no contrato de Swap Fluxo de Caixa Não Constante os limitadores diferentes por fluxo, conforme divulgado no Comunicado Externo 057/2023-VPC.
04/12/2023	04/12/2023	Swap “Fluxo de Caixa Não Constante”	Disponibilização para Swap Fluxo de Caixa não Constante da Curva Calculada de Term SOFR, conforme divulgado no Comunicado Externo 057/2023-VPC.
04/12/2023	04/12/2023	Swap sem CCP	Possibilidade de alterar contratos de Swap sem CCP, do tipo Fluxo de Caixa Não Constante após D+3 do registro, para contraparte cliente, conforme divulgado no Comunicado Externo 057/2023-VPC.
09/10/2023	09/10/2023	Registro de Contrato – Pagamento Final	Inclusão dos campos “Spread”, “+/-” e “Observação”, conforme divulgado no comunicado externo 035/2023-VPC.
09/10/2023	09/10/2023	Registro de Contrato – Fluxo de Caixa Constante e Fluxo de Caixa Não Constante	Inclusão do campo “Observação”, conforme divulgado no comunicado externo 035/2023-VPC.
28/08/2023	12/09/2023	Cessão de Contrato	Ajuste na descrição da funcionalidade “Cessão de Contrato”.
28/08/2023	28/08/2023	Ajuste em telas de registro de Swap Pagamento Final e Fluxo Não Constante	Inclusão dos campos “Data de Fixing IPCA” nos registros de Swap Pagamento Final e Fluxo de Caixa Não Constante, conforme divulgado nos comunicados 021/2023-VPC, 026/2023-VPC e 031/2023-VPC.
24/04/2023	24/04/2023	Alteração de Contrato – Pagamento Final	Ajuste nos prazos relacionados ao item “Alteração de Contrato – Pagamento Final”, conforme divulgado no comunicado 008/2023-VPC.
24/04/2023	24/04/2023	Estratégia	Ajustes na descrição do campo “Código Estratégia” e na consulta Tipo Classe “Estratégia”.
13/02/2023	13/02/2023	Atualização de PU/Fator	Atualização de informações sobre atualização de PU a mercado, detalhando as telas que exibem o Valor Financeiro calculado, conforme divulgado no comunicado 001/2023-VPC.
05/12/2022	24/01/2023	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 20580 EPOL US Equity
05/12/2022	24/01/2023	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 20560 SB US Equity; 20561 CMRE US Equity; 20581 MCO US Equity.
05/12/2022	05/01/2023	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 20340 MSOX US Equity; 20380 CIEQV01 Index; 20420 CPI; 20421 PPI; 20481 ABGSD007 Index; 20500 GSIRTR01 Index; 20501 GSIRTR02 Index; 20502 ABGSCC8 Index; 20520 CIMAMIA1
05/12/2022	05/01/2023	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 20361 CINT US Equity; 20480 HLT US Equity
05/12/2022	05/12/2022	Antecipação de Swap	Aumento de 10 para 14 inteiros no campo “Valor para Antecipação”.
08/08/2022	29/11/2022	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 20085 EUFN US Equity; 20087 GSVIBRC1 Index; 20088 GSVIBRC2 Index; 20162 SOLCYBV8 Index; 20221 GSIS239E Index.
08/08/2022	29/11/2022	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 20089 SGML UR Equity; 20090 SGML UQ Equity; 20106 ELF US Equity; 20107 SKIN US Equity; 20108 ULTA US Equity; 20120 SGML US Equity; 20240 MCD US Equity; 20280 ADS GR Equity.
08/08/2022	29/11/2022	ETF'S	Inclusão do Tipo/Classe: 20220 IHF US Equity.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
08/08/2022	29/11/2022	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 20260 INBR32 BZ Equity.
08/08/2022	14/10/2022	Cotas de Fundos de Investimento Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 20007 AP ENERGIAS RENOVÁVEIS FI.
08/08/2022	14/10/2022	Commodity	Inclusão do Tipo/Classe: 20005 ZINCO SPOT.
08/08/2022	14/10/2022	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 20000 USOSFR5 BGN Curncy.
08/08/2022	14/10/2022	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 19984 CLSA3 BZ Equity.
08/08/2022	27/09/2022	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 19022 ABGS1099 Index; 18922 SOLAITER Index; 18961 CIMAANS1 Index; 18621 BNPIC52V INDEX; 18641 CITIGRND Index; 18680 CIIRBFUU INDEX; 18681 CIIRBF2U INDEX; 19639 GSFXID63 Index; 19934 MQMAXP6 Index; 19910 CIMABSA1 Index; 19903 GSIS216W Index; 19902 RCXT216W Index; 19940 GSISDRV1 Index; 19943 GSISDRV4 Index; 19934 MQMAXP6 Index.
08/08/2022	27/09/2022	ETF's	Inclusão do tipo/Classe: 18682 VEGI UP Equity; 18686 XBI US Equity; 19004 VAGU LN Equity; 19003 CEMB US Equity; 17944 BCOM LN Equity; 18521 METV UP Equity; 18921 LIT US Equity; 19025 EUO US Equity; 19932 DBA UP Equity; 19904 PBW US Equity; 19900 SXPPEX GY Equity; 19865 UNG US Equity; 19850 TIP US Equity; 19932 DBA UP Equity.
08/08/2022	27/09/2022	Futuro de Índices	Inclusão do Tipo/Classe: 18882 Futuro de Europe Pulp BHKP.
08/08/2022	27/09/2022	Futuro de Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 18560 Futuro de Título do Gov. Federal Alemão.
08/08/2022	27/09/2022	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18600 TRAD3 BZ Equity; 18940 PRIO3 BZ Equity; 19052 INBR31 BZ Equity; 19936 RDOR3 BZ Equity; 19981 VIVA3 BZ Equity; 19980 TFCO4 BZ Equity; 19979 SBFG3 BZ Equity; 19978 SMFT3 BZ Equity; 19977 ALPA4 BZ Equity; 19976 CEAB3 BZ Equity; 19975 DXCO3 BZ Equity; 19974 MDIA3 BZ Equity; 19973 PGMN3 BZ Equity.
08/08/2022	27/09/2022	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18561 UNH US Equity; 18601 REP SM Equity; 18620 ACI US Equity; 19023 INTR US Equity; 18980 TGA LN Equity; 18960 UMG NA Equity; 18920 META UW Equity; 18900 WDS US Equity; 6340 IRS US Equity; 19081 RACE US Equity; 19080 M US Equity; 19082 LULU UW Equity; 19084 NHC AU Equity; 19083 WHC AU Equity; 19640 WMT UN Equity; 19660 STO AU Equity; 19740 GE US Equity; 19741 GD US Equity; 19738 NOVA US Equity; 19739 NPI CN Equity; 19781 SHEL US Equity; 19933 OKTA US Index; 19923 PAH3 GR Equity; 19922 MC FP Equity; 19909 AR US Equity; 19908 DE US Equity; 19907 DK US Equity; 19906 FANG US Equity; 19905 LPX US Equity; 19933 OKTA US Index; 19942 STLD US Equity; 19960 TWTR US Equity; 19972 MDLZ UW Equity.
08/08/2022	27/09/2022	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18684 FIDC Angá Sabemi XI; 19925 PTBAFIF BZ Equity.
08/08/2022	27/09/2022	Commodity	Inclusão do Tipo/Classe: 19889 FUTURO DE SUINOS; 19888 FUTURO DE TRIGO; 19950 MONT BELVIEU NORMAL BUTANE (OPIS).
08/08/2022	27/09/2022	Criptoativos: Futuro de Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 19782 Futuro de Ether; 19783 Futuro de Bitcoin.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
08/08/2022	27/09/2022	Criptoativos: Futuro de Ativos	Inclusão do novo módulo.
08/08/2022	08/08/2022	Atualização de PU/Fator e inclusão da sessão "Funcionalidade de Opção de Arrependimento para cenários de Opções Flexíveis"	Atualização das informações da função de Atualização de PU/Fator, apresentando o "Valor Financeiro" sensibilizado pelo lançamento realizado em tela. Inclusão da sessão "Funcionalidade de Opção de Arrependimento para cenários de Opções Flexíveis" para auxílio no registro de contratos com <i>payoffs</i> de Opções via Swap, conforme divulgado no comunicado 064/2022-VPC.
14/03/2022	10/06/2022	Curva de Juros Internacional - SOFR	Ajuste na descrição do campo "Data Liquidação" do bloco "EXCLUSIVO PARA CURVA "JUROS INTERNACIONAIS OVERNIGHT"
14/03/2022	04/05/2022	Curvas Disponíveis para VCP – Ações Nacionais	Inclusão do item 8 referente a incidência de custos de Emolumentos e Corretagem no ajuste da curva de Ações.
14/03/2022	28/04/2022	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 18380 RDXS LN Equity; 18381 XAR US Equity; 18382 SJB US Equity; 18384 OIH US Equity; 18402 PST US Equity; 18480 DRV US Equity; 18520 METV UP Equity; 18521 METV US Equity.
14/03/2022	28/04/2022	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18406 MSUSMSGP INDEX; 18462 CSEAGETR Index; 18482 BNPIMAC4 Index.
14/03/2022	28/04/2022	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18400 RAIL3 BZ Equity; 18401 MEGA3 BZ Equity; 18404 MOVI3 BZ Equity; 18481 POSI3 BZ Equity.
14/03/2022	28/04/2022	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18383 SLB US Equity; 18403 NTR US Equity; 18405 VLO US Equity; 18420 TTE FP Equity; 18460 GPRE US Equity; 18461 WM USEquity; 18483 HL US Equity; 18509 BKR US Equity; 18510 HAL US Equity.
14/03/2022	14/03/2022	Cancelamento de Contrato	Inclusão de informações sobre a funcionalidade de cancelamento do Swap
14/03/2022	14/03/2022	Registro Fluxo de Caixa Não Constante	Ajuste das informações referentes ao campo "Data Liquidação"
14/03/2022	14/03/2022	Agenda de Eventos	Ajuste das informações referentes ao campo "Data Liquidação"
13/12/2021	25/02/2022	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18360 GSISI139 Index.
13/12/2021	25/02/2022	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 18260 FALN US Equity; 18300 TBX US EQUITY; 18361 REZ US Equity.
13/12/2021	25/02/2022	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18320 DYNCODO BZ Equity.
13/12/2021	25/02/2022	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 18220 VALEBZ Float PERP Corp; 18240 ACUPET 7 ½ 01/13/32.
13/12/2021	25/02/2022	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18160 BPAC11 BZ Equity; 18341 XPBR31 BZ Equity.
13/12/2021	25/02/2022	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18180 COP US Equity; 18280 CF US Equity; 18340 GRBK US Equity.
13/12/2021	02/02/2022	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17945 BAYN GY Equity; 17947 LULU US Equity; 17960 HD US Equity; 17980 VTRU US

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
			EQUITY; 18001 PPG US Equity; 18100 ENPH UQ Equity; 18101 F UN Equity; 18102 NIO UN Equity.
13/12/2021	02/02/2022	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18120 PCMAGOI LX Equity.
13/12/2021	02/02/2022	Futuro de Mercadorias	Inclusão do Tipo/Classe: 17961 Futuro de Frete; 17962 Futuro de Madeira.
13/12/2021	02/02/2022	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 18000 BNPIGIFT Index; 18080 GSVI15UE Index; 18140 SOLXPESG Index.
13/12/2021	02/02/2022	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 17944 BCOM LN Equity; 18002 VDE US Equity; 18020 PSQ US EQUITY; 18103 RWM US Equity.
13/12/2021	13/01/2022	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17780 IGIT11 BZ Equity; 17800 SEQL3 BZ EQUITY e 17925 CURY3 BZ Equity.
13/12/2021	13/01/2022	Criptoativos: ETFs Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17521 BITO UP Equity.
13/12/2021	13/01/2022	Indices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17439 BNPISFIN Index; 17840 CSEAFTR Index; 17920 CIMAATH1 Index; 17440 SOLXPGLV Index e 17441 ARKK UP Equity.
13/12/2021	13/01/2022	Indices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 17541 BOIL US Equity; 17910 USRT US Equity; 17940 IHYA LN EQUITY; e 17941 JPEA LN EQUITY.
13/12/2021	13/01/2022	Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17900 ESTRON Index; 17921 TERM SOFR 12M; 17922 TERM SOFR 6M; 17923 TERM SOFR 3M; e 17924 TERM SOFR 1M.
13/12/2021	13/01/2022	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17438 MSFT UW Equity; 17460 APD US Equity; 17462 CMC US Equity; 17500 AESANDES CI Equity; 17501 PARAUCO CI Equity; 17502 CENCOSHO CI Equity; 17520 ACX SM Equity; 17540 SAABB SS Equity; 17542 LKOD LI Equity; 17543 EVR LN Equity; 17560 GAZ GY Equity; 17781 AG US Equity; 17782 EQT US Equity; 17783 EXK US Equity; 17784 KGC US Equity; 17785 KL US Equity; 17786 LNG US Equity; 17787 MAG US Equity; 17788 PAAS US Equity; 17801 NESN SE Equity; 17820 NU US Equity; 17860 SGM AU EQUITY; e 17880 BFIT NA EQUITY.
13/12/2021	13/12/2021	Registro de Contrato – Fluxo Não Constante	Disponibilização da nova curva calculada de SOFR para o módulo de Swap com Fluxo de Caixa não Constante, conforme divulgado no comunicado 051/2021-VPC.
20/09/2021	30/11/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17581 RS US Equity; 17620 MTZ US Equity; 17621 MRO US EQUITY; 17622 NRG US EQUITY; 17623 BLL US EQUITY; 17660 EL US EQUITY e 17700 MOS US Equity.
20/09/2021	30/11/2021	Commodity	Inclusão do Tipo/Classe: 17760 ATR Componente Etanol – Consecana e 17761 ATR Componente Açúcar – Consecana.
20/09/2021	30/11/2021	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17680 MSEMLEA LX Equity; 17681 MSIFGUA LX Equity; 17682 MSIGLSA LX Equity e 17683 MSAIOPA LX Equity.
20/09/2021	30/11/2021	Indices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17600 MSFDVTAL Index e 17701 BNPIMAU5 Index.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
20/09/2021	30/11/2021	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 17580 BNO US Equity; 17686 CPER US Equity; 17720 XME US Equity; 17721 PAVE US Equity; 17736 XLB US Equity; 17684 INDA US Equity e 17685 MOO US Equity.
20/09/2021	18/10/2021	Contratos de Swap	Atualização de termos obsoletos do manual em aderência aos OC 005-2021 PRE, OC 022-2021 PRE, OC 109-2020 PRE quando se aplicar.
20/09/2021	18/10/2021	Registro de Contrato - Fluxo Não Constante	Inclusão da Categoria INDICES DE PRECOS para registro de contrato com Fluxo de Caixa Não Constante, possibilitando uso de curva calculada de IPCA, conforme divulgado no comunicado 029/2021-VPC.
20/09/2021	01/10/2021	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 17404 SOXQ US Equity; 17407 VT UP Equity; 17409 CQQQ US Equity; 17410 ARKQ US Equity e 17413 SOXX UQ Equity.
20/09/2021	01/10/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17411 GSIS180V Index; 17412 BNPIUIL5 Index e 17416 SPE350UN Index.
20/09/2021	01/10/2021	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17143 LOGN3 BZ Equity; 17430 TEND3 BZ Equity; 17431 AMER3 BZ Equity e 17436 VVEO3 BZ Equity.
20/09/2021	01/10/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17403 PRIM US Equity; 17408 VTEX US Equity; 17414 XLNX US Equity; 17415 AMD US Equity; 17427 CHNG US Equity; 17428 AJRD US Equity; 17429 GLEN LN Equity; 17432 AES US Equity; 17433 ET US Equity; 17434 MUR US Equity e 17435 VST US Equity.
20/09/2021	23/09/2021	Registro de Contrato - Pagamento Final	Atualização das informações referente ao campo “ PU Inicial/Cupom limpo ”.
20/09/2021	23/09/2021	Criptoativos: ETFs Nacionais ETFs Internacionais Índices Internacionais	Inclusão dos novos módulos.
20/09/2021	23/09/2021	Títulos Públicos Nacionais	Inclusão sobre “média de cotações” na coluna de “Informações Necessárias”.
20/09/2021	23/09/2021	Índices de Preço	Inclusão sobre “cálculo de pro rata” na coluna de “Informações Necessárias”.
20/09/2021	20/09/2021	Registro de Contrato - Fluxo Não Constante	Inclusão da Categoria INDICES DE PRECOS para registro de contrato com Fluxo de Caixa Não Constante, possibilitando uso de curva calculada de IPCA, conforme divulgado no comunicado 029/2021-VPC.
28/06/2021	02/09/2021	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 17287 HDRO US Equity; 17327 HACK UP Equity; 17390 ARKK US Equity; 17392 ARKF US Equity; 17393 ARKW US Equity e 17401 SMH US Equity.
28/06/2021	02/09/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17395 MXWOTAPE Index e 17400 GSVIDG50 Index.
28/06/2021	02/09/2021	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17347 AMBP3 BZ Equity.
28/06/2021	02/09/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17262 BLDR US Equity; 17282 SFL US Equity; 17283 ZIM US Equity; 17284 GSL US Equity; 17285 U/U CT Equity; 17307 PENN US Equity; 17367 MIN AU Equity; 17389 U-U CN Equity; 17391 CENCOSUD CI Equity; 17394 OPEN US Equity e 17402 NMM US Equity.
28/06/2021	02/08/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17212 GOGL US Equity; 17213 SBLK US Equity; 17214 EGLE US Equity; 17215 2020 NO Equity e 17217 HOG UN Equity.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/06/2021	02/08/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17206 MSUSMT6E Index; 17208 CGW US Equity; 17209 PHO US Equity; 17211 DRIV UQ Equity; 17218 IBBQ US Equity e 17220 ICLN UQ Equity
28/06/2021	19/07/2021	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17204 SPXI11 BZ EQUITY
28/06/2021	19/07/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17203 IWF UP Equity
28/06/2021	19/07/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17202 GFL US Equity
28/06/2021	19/07/2021	Juros Internacionais	Inclusão de informações adicionais sobre a seção VCP de Juros Internacionais - exclusivo para Juros Internacionais Overnight
28/06/2021	12/07/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17167 WCN US Equity; 17183 WIX US Equity e 17184 CVE US Equity.
28/06/2021	12/07/2021	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17166 ORVR3 BZ Equity
28/06/2021	12/07/2021	Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17182 SOFR RATE INDEX.
28/06/2021	29/06/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17155 S32 LN EQUITY.
28/06/2021	29/06/2021	Commodity	Inclusão do Tipo/Classe: 17150 Açúcar ATR São Paulo – Consecana.
28/06/2021	29/06/2021	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17153 BTGRJSM KY Equity.
28/06/2021	29/06/2021	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17152 VNLNDPL BZ Equity.
28/06/2021	29/06/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17148 SPSIMMTR Index; 17149 KRBN US Equity e 17156 CIMASAF1 Index.
28/06/2021	28/06/2021	Registro de Contrato – Pagamento Final	Disponibilização de novas curvas calculadas de Ações Nacionais para o produto Swap com Pagamento Final. A metodologia de cálculo dos ativos considerará a variação de preços do ativo (cotação final/cotação inicial). Nessa primeira entrega, não serão tratados os eventos corporativos das Ações Nacionais, conforme divulgado no comunicado 010/2021-VPC.
28/06/2021	28/06/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17143 SHY US EQUITY .
28/06/2021	28/06/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17142 BOE AU Equity; 17145 CCO CN EQUITY; 17146 GLXY EQUITY e 17147 HUT CN EQUITY.
29/06/2020	17/06/2021	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 16111 Títulos do Tesouro.
29/06/2020	17/06/2021	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 16115 BTGAUNI KY Equity; 16116 BTGDBNI KY Equity e 17098 BTGRMSM KY Equity.
29/06/2020	17/06/2021	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17112 OIBR3 BZ Equity
29/06/2020	17/06/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 16117 COIN UW Equity; 17010 IVN CN Equity; 17029 ANTO LN Equity; 17090 CVX US Equity; 17094 BMOB3 BZ Equity; 17099 X US Equity; 17118 RIOT US Equity; 17119 COIN US Equity; 17120 MSTR US Equity; 17138 BITF CN Equity; 17139 MARA US Equity; 17140 TDY US Equity e 17141 OUT1V FH Equity
29/06/2020	17/06/2021	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 17095 GSXFBREO Index.
29/06/2020	17/06/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 16105 SOLBCTH Index; 16112 HWBM1 Index; 17009 SLV US Equity; 17028 CIEQDUV1 Index; 17091 SMH UP Equity; 17093 CIIRSAF1 Index; 17097 HWOM1 Index; 17109 MSOS US Equity; 17110 ITB UF Equity; 17111 XHB UP Equity e 17121 BLOK UP Equity.
29/06/2020	28/04/2021	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 16037 Futuro de Emissões de Carbono EUA.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/06/2020	28/04/2021	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15927 BTGRATE KY Equity e 16041 CSHMESB BZ Equity.
29/06/2020	28/04/2021	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 16034 LAME3 BZ Equity; 16035 PCAR3 BZ Equity e 16047 PSSA3 BZ Equity.
29/06/2020	28/04/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15929 QCLN US Equity; 15930 SPESG Index; 15931 QQQJ US Equity; 15932 DBC UP Equity; 15934 PALL US Equity; 15939 DCB US Equity; 15973 VNQ UP EQUITY; 15991 TBT US Equity; 15993 URNM US Equity; 15997 OIL FP Equity; 16014 IBB UQ UP; 16015 IBB UP Equity; 16016 ARKG UF Equity; 16039 SONRGY21 INDEX e 16044 HERO US EQUITY.
29/06/2020	28/04/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15926 PKX US Equity; 15928 NXE CN Equity; 15933 ROSN LI Equity; 15936 LVC PW Equity; 15937 CMPC CI Equity; 15938 LYC AU Equity; 15953 PXD US EQUITY; 15954 MRNA US EQUITY; 15955 XOM US EQUITY; 15974 MA UN EQUITY; 15975 CSAN-W US EQUITY; 15977 CMCSA UN Equity; 15978 RCL UN Equity; 15979 BLMN UW Equity; 15980 BKNG UW Equity; 15981 EXPE UW Equity; 15982 ATAD LI Equity; 15983 CVAC US Equity; 15984 OLA CN Equity; 15985 AAL US Equity; 15986 UAL US Equity; 15987 DAL US Equity; 15988 MP US Equity; 15990 YCA LN Equity; 15992 NHY NO Equity; 15994 EFR CN Equity; 15995 DNN US Equity; 15996 UEC US Equity; 15998 VMC US Equity; 16013 MELI UP Equity; 16033 EU CN Equity; 16036 SONY US EQUITY; 16038 BRK/B UN EQUITY; 16040 TSM US EQUITY; 16042 PLTR US EQUITY; 16043 NXE US EQUITY; 16045 DML CN Equity; 16046 NVAX US Equity e 16104 AFYA US Equity.
29/06/2020	08/04/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15998 VMC US Equity.
29/06/2020	08/04/2021	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15997 OIL FP Equity.
29/06/2020	25/02/2021	- Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais - Índices Internacionais	Inclusões nas "Informações Adicionais".
29/06/2020	25/02/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15658 SOLXPCOM Index; 15667 BNPIWA8U Index; 15762 EFIV UP Equity e 15802 YOLO US Equity.
29/06/2020	25/02/2021	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15409 BTGPGRF KY Equity.
29/06/2020	25/02/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15633 EBR US Equity; 15634 MNOD LI Equity; 15635 VINP US Equity; 15637 MWK US Equity; 15655 SQ US Equity; 15656 SF SS Equity; 15659 NVDA US Equity; 15665 TSLA UW Equity; 15801 OXY US Equity e 15803 HP US Equity.
29/06/2020	25/02/2021	Ações	Inclusão do Tipo/Classe: 15636 VAMO3 BZ Equity.
29/06/2020	22/01/2021	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15553 TENB US Equity; 15615 PFE UN Equity e 15616 MELI UW Equity.
29/06/2020	22/01/2021	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15552 USCARN8E Index e 15593 JPMRFTED Index.
29/06/2020	22/01/2021	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15554 IEUR US Equity; 15594 ITB US Equity; 15613 URA US Equity; 15614 ICLN UP Equity; 15617 IPO UP Equity; 15618 BETZ UP Equity; 15619 ARKG UP Equity; 15620 XSOE UP Equity; 15621 SCHA UP Equity e 15622 REMX UP Equity
29/06/2020	09/12/2020	Moedas	Inclusão do Tipo/Classe: 15546 - XDR BNG Curncy
29/06/2020	09/12/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15532 CCL US Equity; 15533 YNDX US Equity; 15534 INAQ US Equity; 15535 JOF US Equity; 15539 CMI US Equity; 15538 NKLA US Equity; 15537 BLPD US Equity; 15540 LIN US Equity; 15541 PYPL US Equity; 15542 POG LN Equity; 15543

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
			POLY LN Equity; 15544 MAIL LI Equity; 15545 ITM LN Equity; 15547 PVG US Equity;
29/06/2020	08/12/2020	Ações Nacionais	Alteração do ativo: 15531 - IGNT3 BZ Equity para GNDI3 BZ Equity.
29/06/2020	03/12/2020	Registro de Contrato - Pagamento Final	Alteração na descrição sobre o "Código da Commodity"
29/06/2020	24/11/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15497 EQX US Equity; 15499 ZEN US Equity; 15501 SBER LI Equity; 15502 SKG LN Equity; 15503 AAL LN Equity; 15517 WRK US Equity e 15518 IP US Equity.
29/06/2020	24/11/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15530 LOGG3 BZ Equity e 15531 IGNT3 BZ Equity
29/06/2020	24/11/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15500 CIMAIAI Index; 15504 M1US000V Index; 15505 M1WO000G Index; 15506 M1US000G Index; 15507 M1WO000V Index e 15508 SOLXPTEC Index.
29/06/2020	24/11/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15498 SUSC US Equity.
29/06/2020	13/11/2020	Ações Internacionais	Alteração na descrição sobre o "Cotação Inicial" em "Informações Necessárias"
29/06/2020	04/11/2020	Moedas	Alteração na descrição sobre o "Cotação Inicial" em "Informações Necessárias"
29/06/2020	28/10/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15496 GMATDEA ID Equity
29/06/2020	28/10/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15493 IGTA3 BZ Equity
29/06/2020	28/10/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15492 SKYY UP Equity; 15495 IXJ US Equity
29/06/2020	28/10/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15490 VRTX UW Equity; 15491 DXCM UW Equity; 15497 EQX US Equity
29/06/2020	07/10/2020	Ações Nacionais	Alteração do ativo: 5074 - NATU3 para NTCO3.
29/06/2020	07/10/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15449 SPXESUP Index.
29/06/2020	07/10/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15468 GME US Equity e 15488 CLF US Equity.
29/06/2020	28/09/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15448 MATRDHC ID Equity.
29/06/2020	28/09/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 15433 BRFSBZ 5 ¼ 09/21/50 REGS CORP.
29/06/2020	28/09/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15430 QQQ UP Equity; 15431 MCHI UN Equity e 15432 Ewt up equity.
29/06/2020	14/09/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15419 JJN US Equity; 15421 XHB US Equity; 15423 DBA US Equity e 15429 SHE US Equity.
29/06/2020	14/09/2020	Futuro de Mercadorias	Inclusão do Tipo/Classe: 15428 Mini Futuro de Prata.
29/06/2020	14/09/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15425 BIDI4 BZ Equity.
29/06/2020	14/09/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15420 BLMN US Equity; 15422 NGD US Equity e 15424 CCJ US Equity
29/06/2020	01/09/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15417 ICLN US Equity e 15418 UUP UP Equity.
29/06/2020	25/08/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15388 KWEB US Equity e 15408 VNQ US Equity.
29/06/2020	25/08/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15409 BTGPGRD KY Equity; 15410 BTGPGA1 KY Equity; 15411 BTGPA1A KY Equity e 15412 BTGPGRA KY Equity.
29/06/2020	25/08/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15384 GILD US Equity; 15385 AZN US Equity; 15413 NEM UM Equity; 15414 GOLD UM Equity; 15415 AU UM Equity e 15416 AEM UM Equity.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
29/06/2020	12/08/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15344 VSTA US Equity; 15347 ARCE US Equity; 15348 FM CN Equity e 15364 TAST US Equity.
29/06/2020	12/08/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15345 TLT US Equity
29/06/2020	31/07/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15331 SHOP UM Equity e 15332 SQ UM Equity.
29/06/2020	31/07/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15284 NEOE3 BZ Equity.
29/06/2020	31/07/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 15305 RDEDOR 4 ½ 01/22/30 REGS CORP e 15306 BANVOR 4 3/8 07/29/25.
29/06/2020	31/07/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15285 DSI UP Equity e 15324 GDXJ US Equity.
29/06/2020	31/07/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14544 CSTREND Index; 15327 MSUSMPT6 Index; 15328 MSFDVT12 Index; 15329 MSFDMSV9 Index e 15330 MSFDMS11 Index.
29/06/2020	31/07/2020	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15325 MSUSBS17 Index e 15326 MSUSBZ20 Index. Exclusão do Tipo/Classe: 14544 CSTREND5 Index.
29/06/2020	22/07/2020	Índices Nacionais Índices Internacionais ETFs	Alteração na descrição sobre o “Cupom Limpo” no campo “Informações Necessárias”.
29/06/2020	14/07/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 12567 NDX Index.
29/06/2020	01/07/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15166 USFD US Equity e 15184 TECK US Equity
29/06/2020	01/07/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15244 CIEQPU01 Index; 15245 CIEQDUV3 Index e 15246 CIEQCUOI Index.
29/06/2020	01/07/2020	Índices Internacionais(ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15164 DBB US Equity; 15185 ESGU US Equity; 15186 ESGE US Equity; 15187 ESGD US Equity; 15204 MCHI UP Equity e 15224 URTN US Equity.
29/06/2020	29/06/2020	Alteração de Contrato	Informação de que podem ser realizadas mais de uma alteração do contrato no dia, conforme divulgado no comunicado 019/2020-VPC.
29/06/2020	29/06/2020	-Registro de Contrato – Pagamento Final -Registro de Contrato – Fluxo Constante -Registro de Contrato – Fluxo não Constante	Alteração na descrição dos campos “Cupom Limpo” e “Data de Cotação” do bloco: Cupom Limpo/Data Cotação – Parte/Contraparte.
29/06/2020	29/06/2020	Alteração de Contrato – Pagamento Final	Alteração na descrição dos campos “Cupom Limpo” e “Data de Cotação” do bloco: Cupom Limpo/Data Cotação – Parte/Contraparte.
29/06/2020	29/06/2020	- Ações Nacionais - Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira)	Alteração na descrição sobre o “Cupom Limpo” no campo “Informações Necessárias”.
29/06/2020	29/06/2020	Ações Internacionais	Alteração na descrição sobre “Denominação” no campo “Informações Necessárias”.
29/06/2020	29/06/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15065 IWM UP Equity; 15124 RSX US Equity e 15127 SIL US Equity.
29/06/2020	29/06/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 15104 BRFSBZ 4 7/8 01/24/30 REGS CORP e 15105 AEGEBZ 5 ¾ 10/10/24 REGS CORP.
29/06/2020	29/06/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15125 FNV US Equity e 15126 GOLD US Equity.
29/06/2020	29/06/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15144 VVAR3 BZ Equity.
17/02/2020	26/05/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15084 F2036CP BZ Equity.
17/02/2020	18/05/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15066 BKLN IS Equity.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
17/02/2020	14/05/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15048 AGI US Equity e 15049 AEM US Equity.
17/02/2020	14/05/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15050 MTRE3 BZ Equity.
17/02/2020	14/05/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15064 XLV UP Equity.
17/02/2020	06/05/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15044 XPH UP Equity.
17/02/2020	06/05/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 15045 BEEFBZ 6 ½ 09/20/26 REGS CORP.
17/02/2020	28/04/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 15025 YDUQ3 BZ Equity; 15026 COGN3 BZ Equity.
17/02/2020	28/04/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 15024 EWZ UP Equity.
17/02/2020	23/04/2020	Taxas de Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14967 FEDL01 Index.
17/02/2020	23/04/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14904 CRAK US Equity; 14965 FEZ US Equity; 14968 IEF US Equity; 14988 XOP US Equity; 14990 GREK US Equity; 14991 EWU US Equity; 15004 EWUS US Equity; 15007 IVVB11 BZ Equity.
17/02/2020	23/04/2020	Cotas de Fundos de Investimentos Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14985 BRCR11 (CNPJ 08.924.783/001-0).
17/02/2020	23/04/2020	Futuro de Mercadorias	Inclusão do Tipo/Classe: 14925 Futuro de Palladium; 15006 Futuro de Platina.
17/02/2020	23/04/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14924 PETBRA 5 ¼ 02/01/29 CORP; 14944 ARGENT 2 12 12/31/38 GOVT; 14966 SBSPBZ 6 ¼ 16/12/20 REGS CORP; 14969 BVMFBZ 5 ½ 07/16/20 REGS CORP.
17/02/2020	23/04/2020	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14970 TOTS3 BZ Equity
17/02/2020	23/04/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14984 ENIC US Equity; 14986 JNJ UN Equity; 15005 NLMK LI Equity.
17/02/2020	23/04/2020	Ações Internacionais	Atualização de participação para Ações Internacionais
17/02/2020	15/04/2020	Registro de Contrato - Pagamento Final	Ajuste nas observações referente às combinações possíveis de Parte e Contraparte nos contratos.
17/02/2020	23/03/2020	Ações Nacionais	Atualização de participação para Ações Nacionais
17/02/2020	12/03/2020	Índices Internacionais (ETF)	Atualização de proventos para ETF
17/02/2020	27/02/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14824 VVNT US Equity; 14825 SCR CN Equity; 14864 CNE CN Equity e 14885 FCX US Equity.
17/02/2020	27/02/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14823 PETRA 6.9 03/19/49 CORP; 14843 CSNABZ 6 34 01/28/28 REGS-CORP; 14846 ELEBRA 4 5/8 02/04/2030 REGS-CORP e 14884 4 5/8 PERP REGS-CORP.
17/02/2020	27/02/2020	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14847 IYW UP Equity; 14848 JJC US Equity; 14849 OESA GR Equity; 14850 TUR US Equity; 14886 SLX US Equity e 14887 COPX US Equity.
17/02/2020	17/02/2020	- Contratos com funcionalidade - Exercício de Opção	Alteração do funcionamento da funcionalidade da opção de arrependimento, exclusivamente no vencimento, conforme comunicado no 002/2020-VPC.

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2019	20/01/2020	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14805 PETBRA 6 7/8 01/20/40 CORP; 14806 HIDRVS 5.95 01/24/25 CORP
28/05/2019	20/01/2020	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14804 CSEAGG20 Index.
28/05/2019	20/01/2020	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14763 ACEL/WS US Equity; 14783 GM UN; 14803 UBER UN Equity
28/05/2019	06/01/2020	Taxa de Juros Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14743 Selic REFIS.
28/05/2019	17/12/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14723 BMEBMZ 9 5/8 07/16/20 REGS-CORP
28/05/2019	12/12/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14683 BAC US Equity; 14684 SCHW US Equity; 14685 KO UN Equity e 14686 XP US Equity.
28/05/2019	10/12/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14663 V UN Equity.
28/05/2019	09/12/2019	Taxa de Juros Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14624 EONIA Index.
28/05/2019	09/12/2019	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14643 MJ US Equity.
28/05/2019	02/12/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14623 BAKIDE 7.45 11/15/29 CORP.
28/05/2019	02/12/2019	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14544 CSTREND5 Index.
28/05/2019	02/12/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14583 GOOGL UW Equiy.
28/05/2019	28/11/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14603 NEXA RESOURCES SA.
28/05/2019	21/11/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14543 DESP US Equity.
28/05/2019	11/11/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14503 BA US Equity
28/05/2019	01/11/2019	Registro de Contrato – Pagamento Final	Alteração na descrição do campo “Valor (R\$)”
28/05/2019	23/10/2019	Taxa de Juros Nacionais	Inclusão no campo “ Informações Necessárias” sobre o Percentual da Curva.
28/05/2019	22/10/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14444 MVFPSO 6.748 06/01/34 REGS – CORP.
28/05/2019	22/10/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14423 FTCH US Equity e 14443 V US Equity.
28/05/2019	15/10/2019	Lançamentos	Alteração na descrição do campo “Adesão a Contrato”.
28/05/2019	11/10/2019	Índices Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14400 BZRFIB5+ Index; 14401 BZRFIRFM Index e 14402 BZRFIMAB Index.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2019	10/10/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14391 IB5M 11 BZ Equity; 14392 IRFM11 BZ Equity e 14393 IMAB11 BZ Equity
28/05/2019	10/10/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14351 BONSUC 9 1/4 11/03/20 REGS - CORP.
28/05/2019	10/10/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14331 MCD UN Equity.
28/05/2019	12/09/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14312 IJR US Equity.
28/05/2019	12/09/2019	Futuro de Mercadorias	Inclusão do Tipo/Classe: 14310 FUTURO DE AÇUCAR; 14311 FUTURO DE ZINCO.
28/05/2019	06/09/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14291 SBS US Equity.
28/05/2019	27/08/2019	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14272 MGOIEAA LX Equity.
28/05/2019	27/08/2019	Futuro de Taxas de Juros	Inclusão do Tipo/Classe: 14271 Futuro de Cupom IPCA (DAP).
28/05/2019	27/08/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14250 GDX US Equity.
28/05/2018	15/08/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão do Tipo/Classe: 14159 SPXU US Equity e 14190 QID US Equity.
28/05/2018	15/08/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14191 7974 JT; 14210 IFS US Equity e 14230 KER FP Equity.
28/05/2018	15/08/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14231 BIDI11 BZ Equity.
28/05/2018	26/07/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13995 EXITO CB Equity.
28/05/2018	26/07/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 14110 USIM 5 7/8 07/18/26 REGS – CORP.
28/05/2018	26/07/2019	Índices Internacionais (ETF)	Inclusão dos Tipos/Classe: 14090 SQQQ US Equity e 14130 SRTY US EQUITY.
28/05/2018	26/07/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 14075 TAAE11 BZ Equity.
28/05/2018	24/06/2019	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: 13993 WORK US Equity; 13990 DIS UN Equity
28/05/2018	24/06/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 13992 JSLGBZ 7 3/4 07/26/24 REGS - CORP
28/05/2018	24/06/2019	Índices Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13991 Futuro de DXY Index
28/05/2018	18/06/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 13972 UNIGEL 10 1/2 01/22/24 REGS - Corp

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

Versão	Atualização em	Referência	Atualização
28/05/2018	18/06/2019	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipos/Classe: 13973 SUZ US Equity; 13951 WCAGY US Equity
28/05/2018	18/06/2019	Cotas de Fundos de Investimento Internacional	Inclusão dos Tipos/Classe: 13971 PGIPVA ID Equity; 13970 MORAMAH LX Equity
28/05/2018	18/06/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13932 ENAT3 BZ Equity
28/05/2018	13/05/2019	Moedas	Melhoria da descrição das Informações Necessárias.
28/05/2018	13/05/2019	Cotas de Fundos de Investimentos Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13789 EURBARR LX Equity
28/05/2018	13/05/2019	Ativos	Inclusão do Tipo/Classe: 13809 PDCAR 7 1/8 06/10/21 CORP; 13829 KLAB 5 3/4 04/03/29 CORP; 13930 BUENOS 9 58 04/18/28 CORP; 13931 BUENOS 6 12 02/15/23 CORP
28/05/2018	13/05/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13850 SLCE3 BZ Equity; 13851 BRDT3 BZ Equity; 13890 IRBR3 BZ Equity; 13912 EGIE3 BZ Equity; 13913 GRND3 BZ Equity; 13914 RAPT4 BZ Equity
28/05/2018	13/05/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13849 NETS US Equity; 13911 IPOA US Equity
28/05/2018	18/03/2019	ETF	Inclusão do Tipo/Classe: 13769 SMIN US Equity
28/05/2018	18/03/2019	Ativos	Inclusão dos Tipo/Classe: 13549 VALEBZ 5 78 06/10/21 Corp; 13530 MENDOZ 8 38 05/19/24 Cor
28/05/2018	18/03/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13569 005930 KP Equity
28/05/2018	14/03/2019	Ativos	Inclusão dos Tipo/Classe: 13610 ITAU 6 18 PERP CORP; 13589 PETBRA 7 14 03/17/44 Corp
28/05/2018	14/03/2019	Ações Nacionais (para contratos com Verificação Contínua de Barreira)	Inclusão do Tipo/Classe: 13669 PETR4 (contínuo)
28/05/2018	14/03/2019	Ações Internacionais	Inclusão dos Tipo/Classe: 13689 6758 JP Equity; 13629 WB US Equity; 13609 EA US Equity
28/05/2018	14/03/2019	ETFs	Inclusão dos Tipo/Classe: 13729 ACWX US Equity; 13649 GXG US Equity
28/05/2018	14/03/2019	Índices Internacionais	Inclusão dos Tipo/Classe: 13749 ENHAEMD5 Index; 13709 JPUSFTRC Index.
28/05/2018	21/01/2019	Taxas de Juros	Correção da descrição das informações Necessárias.
28/05/2018	21/01/2019	Ações Nacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13429 B3SA3 BZ Equity
28/05/2018	21/01/2019	Ações Internacionais	Inclusão do Tipo/Classe: 13469 IRCP US Equity

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

CONSULTAS

INTERMEDIACÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

ALTERAÇÃO

CESSÃO

ANTECIPAÇÃO

FUNCIONALIDADES

REGISTRO

SUMÁRIO