

**CONTRATO FUTURO DE TAXA DE CÂMBIO DE REAIS POR DÓLAR CANADENSE****1. Informações do contrato**

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

<b>Preço de ajuste</b>	Valor expresso em reais (BRL) por CAD1.000,00 dólares canadenses, com três casas decimais, apurado diariamente pela B3, conforme regras divulgadas, para efeito de atualização do valor das posições em aberto e apuração do valor de ajustes diários
<b>Paridade (TP)</b>	Taxa de câmbio de dólar canadense (CAD) por dólar dos Estados Unidos da América (USD), apurada pela The World Markets Company PLC (WM) e divulgada pela Reuters Limited (Reuters), na sua página WMRSBOT02 cotação WM/Reuters Closing Spot Rate <sup>1</sup>
<b>Taxa de câmbio em dólar (TxC)</b>	Taxa de câmbio de BRL por USD PTAX, cotação de venda, apurada e divulgada pelo Banco Central do Brasil.

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

## 2. Ajuste diário

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

---

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

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

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

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

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

Onde:

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

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

$PO$  = preço da operação;

$n$  = número de contratos;

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

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

**3. Condições de liquidação no vencimento**

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

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

Onde:

- VL = valor de liquidação, em reais;
- TxCt-1 = taxa de câmbio de BRL por USD na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;
- TPt-1 = taxa de câmbio de CAD por USD, na data de fixing, conforme definida na cláusula 1;
- n = número de contratos.

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

#### **4. Condições especiais**

##### **a) Feriado Extraordinário**

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

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

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

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

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

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

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

### **5. Lei de regência**

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

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

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

