

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 | 94 |
| 17 | Alteração – Pagamento Final | 99 |
| 18 | Alteração – Fluxo Constante..... | 110 |
| 19 | Alteração – Fluxo Constante..... | 114 |
| 15 | Alteração – Fluxo Constante..... | 117 |
| 16 | Alteração De Fluxo De Data De Verificação..... | 121 |
| 17 | Alteração De Pagamento De Prêmio | 124 |
| 18 | Cancelamento De Contrato | 128 |

| | | |
|----|--|-----|
| 19 | Exercício Da Opção | 130 |
| 20 | Intermediação..... | 133 |
| 21 | Consulta Característica Do Contrato | 135 |
| 22 | Consulta - Agenda De Eventos | 138 |
| 23 | Consulta – Fluxo Não Constante..... | 141 |
| 24 | Consulta – Histórico De Parâmetros Para Disparo No Reset | 142 |
| 25 | Consulta – Histórico De Curvas Marcadas A Mercado..... | 143 |
| 26 | Consulta – Histórico De Reset..... | 144 |
| 27 | Consulta – Resumo De Contratos | 145 |
| 28 | Consulta – Contratos Opção Com Arrependimento | 146 |
| 29 | Consulta – Contratos De Swaption/ Compound..... | 147 |
| 30 | Consulta – Histórico De Alteração De Contrato..... | 148 |
| 31 | Informações Adicionais..... | 150 |
| 32 | Atualização Da Versão..... | 171 |

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: 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: <input type="text"/> Categoria: <input type="text"/> Curva: <input type="text"/> TR Escolhida: <input type="text"/> +/-: <input type="text"/> Juros(% aa): <input type="text"/> Lim. Inferior (Floor): <input type="text"/> Lim. Superior (Cap): <input type="text"/> | Percentual: <input type="text"/> Categoria: <input type="text"/> Curva: <input type="text"/> TR Escolhida: <input type="text"/> +/-: <input type="text"/> Juros(% aa): <input type="text"/> Lim. Inferior (Floor): <input type="text"/> Lim. Superior (Cap): <input type="text"/> |

Terceira Curva

Parte/Contraparte: Capom Limpo: Percentual: Curva: +/-: Juros(% aa): Limitador:

Se Curva(s) – "VCP":

| Parte | Contraparte |
|---|---|
| PU: <input type="text"/> Tipo/Classe: <input type="text"/> Denominação: <input type="text"/> | PU: <input type="text"/> Tipo/Classe: <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"/> |

Exclusivo para curva "Libor"

| Parte | Contraparte |
|---|---|
| Data de Cotação - Libor: <input type="text"/> Variação Cambial: <input type="text"/> Tipo Classe: <input type="text"/> Data de Cotação - Variação Cambial: <input type="text"/> Cupom Limpo / Outros - Cotação: <input type="text"/> Aliquota IR: <input type="text"/> Limite Inferior (Floor) - Perc.: <input type="text"/> Limite Superior (Cap) - Perc.: <input type="text"/> | Data de Cotação - Libor: <input type="text"/> Variação Cambial: <input type="text"/> Tipo Classe: <input type="text"/> Data de Cotação - Variação Cambial: <input type="text"/> Cupom Limpo / Outros - Cotação: <input type="text"/> Aliquota IR: <input type="text"/> Limite Inferior (Floor) - Perc.: <input type="text"/> Limite Superior (Cap) - Perc.: <input type="text"/> |

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 <input type="text"/> | Data Vencimento <input type="text"/> | Adesão a Contrato <input type="text"/> |
| Valor Base <input type="text"/> | Agenda de Prêmio <input type="text"/> | Código Estratégia <input type="text"/> |
| Observação <input type="text"/> | Amortiza sem troca de diferencial <input type="text"/> | Código Identificador <input type="text"/> |

| 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 prever ajuste com apenas troca de juros | Condicional | 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). |
| 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 | Campo de preenchimento obrigatório se o Índice Termo for preenchido. Tipo: Numérico(até 3 (três) números inteiros e 2 (dois) decimais). |
| 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 | <p>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.</p> | 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 | <p>Tipo do Índice VCP que atualiza o Valor Base do contrato a termo.</p> | 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 | <p>Descrição do parâmetro escolhido como VCP para atualização do Valor Base do contrato a termo. Texto livre com 320 posições.</p> | 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 | TR Escolhida | Lim. Inferior (Floor) | Percentual | Categoria | Curva | TR Escolhida | Lim. Superior (Cap) |
| <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |
| Terceira Curva | | | | | | | | | |
| Parte/Contraparte | Cupom Limpo | Percentual | Curva | Lim. Inferior (Floor) | Lim. Superior (Cap) | Juros(% aa) | Limitador | | |
| <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | | |
| Se Curva(s) = "VCP": | | | | | | | | | |
| Parte | | | | | Contraparte | | | | |
| PU | Denominação | Tipo/Classe | | | PU | Denominação | Tipo/Classe | | |
| <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | | | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | | |
| 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 |
|-------------------|--|-----------------------|---|
| 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

INTERMEDIÇÃO

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, Prefixado 365 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 |
|--|---|------------------------------|--|
| 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 juros 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 -
Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por Taxa Juros Mercado Internacional.

| | | | |
|---------------------------------------|---|-------------|---|
| 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 opcional. Informar com até 3 (três) números inteiros e 5 (cinco) decimais. |

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

| Campo | Descrição | Tipo de Preenchimento | Regras |
|--|--|-----------------------|---|
| 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 opcional. 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 opcional. 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 | Média Asiática Verificação | Data da Cotação para Ajuste | Cotação Inicial | Código da Commodity/Ação | Média Asiática Verificação | Data da Cotação para Ajuste |
| <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <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"/> | <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. |
| 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. |

| Campo | Descrição | Tipo de Preenchimento | Regras |
|-------------------------------------|--|-----------------------|---|
| 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 opcional. |
| Spread | É o valor do Spread a ser aplicado na cotação final para liquidação. | Condicional | Campo opcional. 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 | Verificação |
| <input type="text"/> | <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"/> | <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. |

| Campo | Descrição | Tipo de Preenchimento | Regras |
|--|---|-----------------------|--|
| 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 lene 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. | | | |
| 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. | | | |

| Campo | Descrição | Tipo de Preenchimento | Regras |
|---|--|-----------------------|--|
| 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 | Caso não seja preenchido o sistema considerará o número índice M-1 já na tela de confirmação. Campo tipo domínio com as opções: "M-1" e "M-2", |
|----------------------------|--|-----------------|---|

Observações:

- a) O campo **Juros (% aa)**, quando a curva selecionada for **Prefixada 252 d, Prefixada 360 d** ou Prefixada 365 d permite o preenchimento com a informação menor, igual ou maior que zero.
- b) 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
- c) É permitido utilizar (1) um limitador no contrato, sendo aplicado em apenas uma das curvas.
- d) 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

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

| | | | |
|---------------------------------|--|-------------|--|
| 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, Prefixado 365 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"/> |

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. |

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

| 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 -
Campos exclusivos para a(s) curva(s) que optar (em) por SOFR.

| | | | |
|------------------------|---|-------------|---|
| 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

Contraparte

Meu Número (Oper Original)

Número de Datas de Eventos

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) via registro em tela. Contratos partir de 181 fluxos poderão ser registrados via arquivo, onde o limite máximo de fluxos permitidos é de 360 (incluindo vencimento)."

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"/> |
| 06/12/2021 | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |

Fluxo Não Constante Ponta 2

| | | | | | | |
|----------------------|----------------------|----------------------|--------------------------------|-------------------------------|----------------------|----------------------|
| Data | +/- | Juros(% aa) | Data Início 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"/> |
| 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> |

| 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. |

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 | Tipo/Classe | PU | Tipo/Classe |
| <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> | <input type="text"/> |
| Denominação | | Denominação | |
| <input type="text"/> | | <input type="text"/> | |
| 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"/> |

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 | Campo de preenchimento obrigatório quando curva 00 ou contrato à vista ou decorrido. Pode ser atualizado pela função Atualização de PU / Fator até a data do vencimento. |

| 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 **indices@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) Não é permitida a utilização de cross rate para Paridade entre moedas
- 5) 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 (exemplo: %as – ao semestre, %at – ao trimestre, %ap – ao período, etc.) |

| | | |
|---|---|---|
| | | <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: <ul style="list-style-type: none"> 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). |
| Varição Quanto | <ul style="list-style-type: none"> Denominação | No caso de variação Quanto, informar "ausência de variação cambial" ou "variação quanto" no campo "Denominação". |
| Varição 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) | <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 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 | <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> <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) | <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> |

| 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

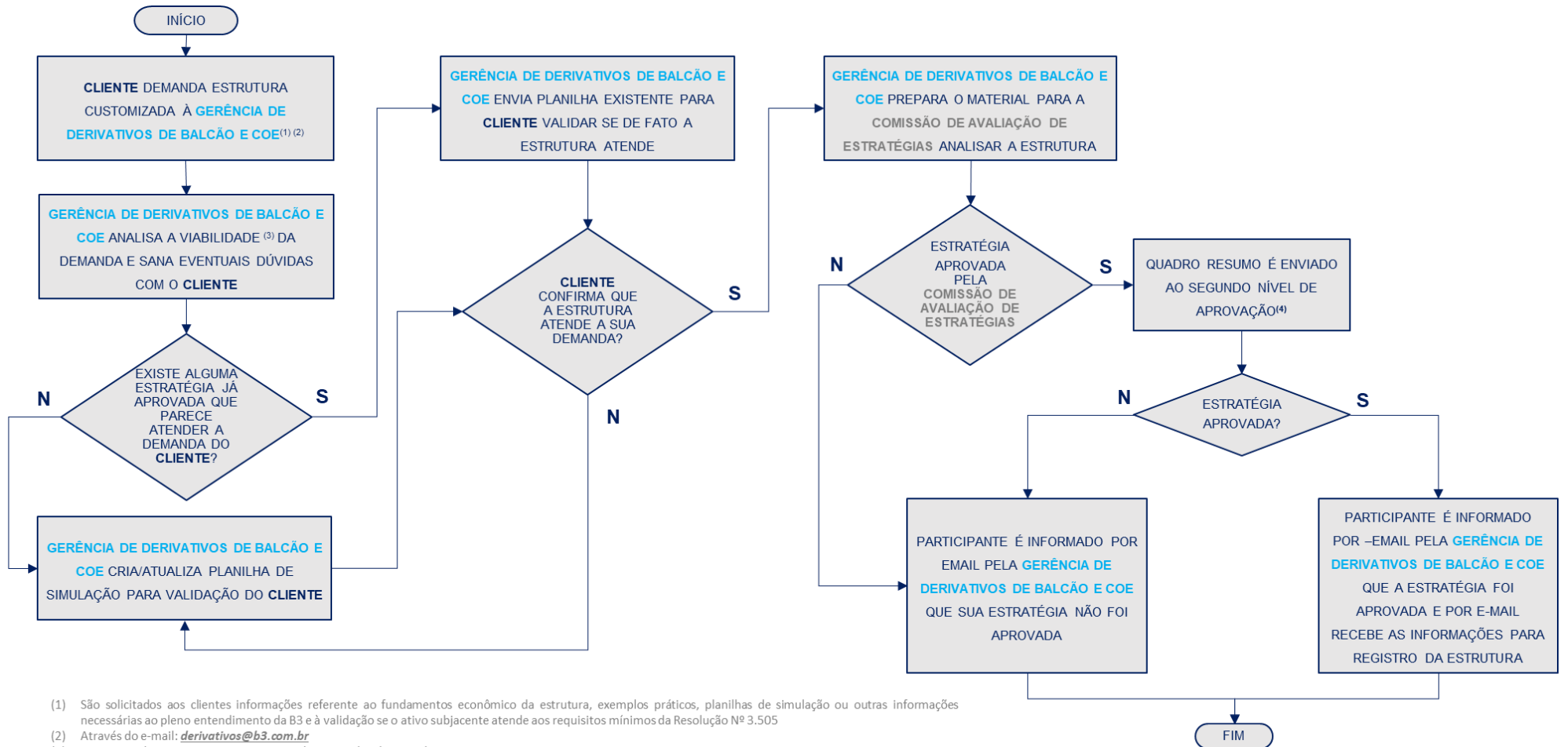
2 - O participante, após registrar o Contrato, com a indicação do Código da Estratégia, no Módulo de Swap ou Opção Flexível, deve informar no MID, na função Registro de Dados de Estratégia os respectivos dados da Estratégia. A informação dos dados deve ser realizada, obrigatoriamente, no mesmo dia do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

Tela de Registro de Dados de Estratégia

A captura de tela mostra a interface de usuário para o registro de dados de estratégia. No topo, há uma barra de título azul com o texto "Filtro Registro Dados de Estratégia". Abaixo, há um campo de entrada para "Código do Contrato" e um menu suspenso para "Ação" com o valor "INCLUIR" selecionado. Na base da interface, há três botões: "Pesquisar", "Limpar Campos" e "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 iniciar o Cupom Limpo.

FORMAS DE LANÇAMENTO

Tela:

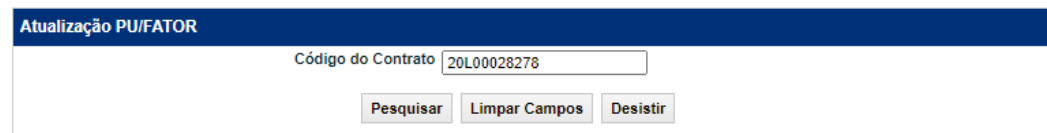
Menu Swap > Lançamentos > Atualização PU/Fator

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



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



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 | Preço ou cotação para atualizar a curva definida no campo Curva. Pode ser informado o PU ou Fator para atualização. | Condicional | Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. A atualização informada é utilizada como "PU Final" na atualização do Valor Base (para mais detalhes acessar o Caderno de Fórmulas Swap – Curvas VCP) Para o lançamento de: <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 (Nome Simplificado) RIOBM |
| Ponta 1 05000.00-5 | Ponta 2 (Nome Simplificado) LEMEBM |
| Ponta 2 10020.00-1 | Tipo de Atualização CURVA VCP |
| Papel PONTA 1 | Data PU/FATOR 25/07/2022 |
| Curva PONTA 1 | Data de Início 27/05/2014 |
| Meu Número 1 | Data de Vencimento 06/06/2023 |
| Valor Curva 1 7.000,00 | PU 70,00000000 |
| Valor Curva 2 6.600,00 | FATOR |
| Valor Financeiro 400,00 | |
| <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 n° 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.

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

ContraParte

Meu Número (Oper Original)

Quantidade de Datas de Verificação Parte

Quantidade de Datas de Verificação ContraParte

| Campo | Descrição | Tipo de Preenchimento | Regras |
|---|--|------------------------------|--|
| Parte | Código da conta que identifica o membro que está acessando o sistema e, conseqüentemente, 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 (simplex ou ponderada). Informado com até 3 (três) inteiros. |

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

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

Registro de Pagamento de Prêmio

Código do Contrato: 22G00294182

Forma de Pagamento: DEFINIR FLUXO

Quantidade de Prêmios: 2

Pesquisar Limpar Campos Voltar Desistir

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 | Campo de preenchimento obrigatório somente quando for escolhida a forma de pagamento Definir Fluxo . 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. |

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 <input type="text" value="15"/> / <input type="text" value="07"/> / <input type="text" value="2022"/> | Valor do Prêmio <input type="text" value="500"/> , <input type="text"/> | Titular <input type="text" value="PONTA 1"/> |
| Data <input type="text" value="20"/> / <input type="text" value="07"/> / <input type="text" value="2022"/> | Valor do Prêmio <input type="text" value="800"/> , <input type="text" value="00"/> | Titular <input type="text" value="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 <input type="text" value="3456"/> |
| Curva Ponta 1 DI | Curva Ponta 2 DOLAR DOS EUA | Papel PONTA 1 |
| Permissibilidade para Registros | | |
| Curvas Marcadas a Mercado <input type="text" value="PONTA 1"/> | | Reset <input type="text" value="PONTA 1"/> |
| Condição de Disparo | | |
| Forma de Disparo DATA OU VALOR | Credor <input type="text" value="PONTA 1"/> | |
| Disparo por Valor | | |
| Valor <input type="text" value="1000"/> | | |
| Datas de Disparo | | |
| <input type="text" value="21"/> | <input type="text" value="11"/> | <input type="text" value="2014"/> |
| <input type="text" value="28"/> | <input type="text" value="11"/> | <input type="text" value="2014"/> |
| <input type="button" value="Enviar"/> | <input type="button" value="Limpar Campos"/> | <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/> |

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. |

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 informa 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 ,

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"/> | <input type="text"/> |
| ContraParte | <input type="text"/> | <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"/> | | |

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, conseqüentemente, 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 | Data Início | Data Vencimento |
| 22G00294185 | 15/07/2022 | 20/07/2022 |
| Código Parte | Código Contraparte | Meu Número (Oper Original) |
| 07570.00-7 | 70180.00-8 | 4 |
| Parte (Nome Simplificado) | Contraparte (Nome Simplificado) | Papel |
| KEBBC | ANDBANKBM | PONTA 1 |
| Curva Parte | Curva Contraparte | Meu Número |
| COMMODITIES | DI | 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.

Quando se realiza o agendamento de Antecipação, a atualização do Valor Base Remanescente está condicionada ao pagamento da Antecipação na Bilateral, por isso, não deve ter agendamento de Antecipações para datas que tenham Eventos de Vencimentos (Juros e Amortização), pois o sistema calculará a liquidação sob o Valor Remanescente sem atualização.

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

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 22L00022402 | Papel PONTA 1 |
| Ponta 1 05000.00-5 | Meu Número <input type="text"/> |
| Ponta 2 05000.10-8 | Fator para Antecipação (Ponta 1) <input type="text"/> . <input type="text"/> |
| Ponta 1 (Nome Simplificado) RIOBM | Fator para Antecipação (Ponta 2) <input type="text"/> . <input type="text"/> |
| Ponta 2 (Nome Simplificado) RIOBM | Data de Antecipação <input type="text"/> ▾ |
| Valor Base Remanescente 900.000,00 | Data de Liquidação <input type="text"/> / <input type="text"/> / <input type="text"/> |
| Cesta de Garantias (Ponta 1) | Valor para Antecipação <input type="text"/> . <input type="text"/> |
| Cesta de Garantias (Ponta 2) | 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> |
| Data de Liquidação | <p>Este campo permite indicar, no momento do lançamento de uma antecipação parcial ou total, que a liquidação financeira dessa antecipação ocorrerá no próximo dia útil (D+1) na grade bilateral. Caso a data não seja preenchida, a liquidação ocorrerá no mesmo dia (D0).</p> | Opcional | <p>Campo de preenchimento obrigatório, quando for necessário o agendamento da liquidação.</p> <p>Preenchido no formato data: AA/MM/DDDD</p> |

| Campo | Descrição | Tipo de Preenchimento | Regras |
|-------------------------------|---|-----------------------|--|
| Valor para Antecipação | Valor total ou parcial a antecipar do contrato. | Condicional | Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Preenchido com 14 inteiros e 2 casas decimais. |
| Mantém Prêmios | | Obrigatório | Caixa de Seleção com as opções: Vazio, SIM e NÃO. Em caso de antecipação total, esse campo não deve ser considerado ficando o mesmo com a opção Vazio. Em caso de antecipação parcial: 1) Se informado Sim, indica que os pagamentos de prêmios agendados após a data da antecipação parcial devem ser mantidos. 2) Se informado Não, indica que os pagamentos de prêmios agendados após a data de antecipação parcial serão cancelados automaticamente pelo sistema. |

▪ **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>.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

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 total 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. A 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 |

| Tipo de Swap | Tipo de Contrato | PRAZOS | | |
|--------------------------------|---|--------|---------|------|
| | | 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

Tela de Registro de Alteração de Contrato - Pagamento Final

Alteração de Contrato - Pagamento Final

| | | | |
|--|--|--|--|
| Parte 05000.00-5 Meu Número <input type="text"/> | Contraparte 05000.10-8 Código do Contrato 22L00022405 | CPF/CNPJ Cliente Parte <input type="text"/> | CPF/CNPJ Cliente Contraparte 012.345.678-90 |
| | | Comissão Parte <input type="text"/> | Comissão Contraparte <input type="text"/> |

Características

| | | | | | | | |
|---|---|-------------------------------|--|-----------------------------|---------------------------|-----------------------------|---------------------------------------|
| Data de Registro 23/12/2022 | Data Início 17/12/2023 | 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 <input type="text"/> | | | | |
| Amortiz. sem troca de diferencial <input type="text"/> | Código Identificador <input type="text"/> | | | | | | |

Exclusivo para Contrato à Termo

| | | |
|-----------------------------|-------------------|-------------------------------------|
| Data Operação 23/12/2022 | Índice Termo ▼ | 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 ▼ | Denominação <input type="text"/> |
|--|---|------------------|-------------------------------------|

Curvas para Atualização

| Parte | | | Contraparte | | |
|---|--------------------|---|---|------------------------------|---|
| Percentual 100 | Categoria JUROS | Curva DI | Percentual 100 | Categoria TAXAS DE CAMBIO | Curva DOLAR DOS EUA |
| TR Escolhida <input type="text"/> | +/- ▼ | Juros(% aa) <input type="text"/> | TR Escolhida <input type="text"/> | +/- ▼ | Juros(% aa) <input type="text"/> |
| Lim. Inferior (Floor) <input type="text"/> | | Lim. Superior (Cap) <input type="text"/> | Lim. Inferior (Floor) <input type="text"/> | | Lim. Superior (Cap) <input type="text"/> |

Terceira Curva

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

Se Curva(s) = "VCP":

| Parte | | Contraparte | |
|-------------------------------------|------------------|-------------------------------------|------------------|
| PU <input type="text"/> | Tipo/Classe ▼ | PU <input type="text"/> | Tipo/Classe ▼ |
| Denominação <input type="text"/> | | Denominação <input type="text"/> | |

Cupom Limpo/Data Cotação

| Parte | | Contraparte | |
|-------------------------------------|----------------------|------------------|------------------------|
| Cupom Limpo <input type="text"/> | Data de Cotação ▼ | Cupom Limpo 5 | 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

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 ADESÃO) |
| 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 | | <p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Tipo: Numérico (até 10 inteiros)</p> |
| Data Operação | Data em que o contrato terá sua Taxa a Termo formada | <p>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.</p> <p>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.</p> <p>Se for contrato a termo SEM previsão de índice de atualização, a data pode ser alterada, mesmo que este já tenha iniciado.</p> <p>Tipo: Data (formato DD/MM/AAAA)</p> |
| 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). | <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> |
| PU Inicial/ Cupom limpo | <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>É permitida a alteração, se o contrato ainda não tiver sido iniciado. A atualização é realizada para o dia seguinte da alteração.</p> <p>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.</p> |

| 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. |
| Varição 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. |

| | | |
|--|--|--|
| Varição 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. |

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

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 |

| Tipo de Swap | Tipo de Contrato | PRAZOS | | |
|----------------------------|-------------------|--------|---------|-----|
| | | 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

Ação CORREÇÃO

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 Início | Data Vencimento | |
| 30 / 4 / 2008 | 30 / 5 / 2008 | 30 / 5 / 2018 | |
| Adesão a Contrato | Valor Base | Valor Total Antecipado | |
| <input type="text"/> | 1000000000 , <input type="text"/> | 100 , <input type="text"/> | |
| Valor Base Atual | Valor Total Amortizado | Agenda de Prêmio | |
| 1008766750 , <input type="text"/> | 521194068 , 90 | NAO | |
| Código Estratégia | | Amortiza sem troca de diferencial | |
| <input type="text"/> | | <input type="text"/> | |
| Código Identificador | | | |
| <input type="text"/> | | | |
| Exclusivo para Contrato à Termo | | | |
| Data Operação | Índice Termo | Perc. Termo | |
| 30 / 4 / 2008 | SELIC | 100 , <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"/> |
| FLUXO DE JUROS e AMORTIZAÇÕES | | | |
| Juros a cada | Período | Data Início Pagto Juros | |
| 1 | Meses | 30 / 6 / 2008 | |
| Amort a cada | Período | Data Início Pagto Amort. | Tipo Amortização |
| 1 | Meses | 30 / 6 / 2008 | Sobre valor Base Original |

(continua)

| Curvas para Atualização | | | | | |
|--|--|---|--|--|--|
| Parte | | | Contraparte | | |
| Percentual <input type="text"/> , <input type="text"/> | | | Percentual <input type="text"/> , <input type="text"/> | | |
| Curva <input type="text"/> | | | Curva <input type="text"/> | | |
| Juros(% aa) <input type="text"/> , <input type="text"/> | | | Juros(% aa) <input type="text"/> , <input type="text"/> | | |
| Lim. Superior (Cap) <input type="text"/> , <input type="text"/> | | | Lim. Superior (Cap) <input type="text"/> , <input type="text"/> | | |
| Se Curva(s) = "VCP": | | | | | |
| Parte | | | Contraparte | | |
| PU <input type="text"/> , <input type="text"/> | | | PU <input type="text"/> , <input type="text"/> | | |
| Tipo/Classe <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"/> , <input type="text"/> | | Data Informação Cupom Limpo <input type="text"/> / <input type="text"/> / <input type="text"/> | | Cupom Limpo <input type="text"/> , <input type="text"/> | |
| Data de Cotação <input type="text"/> | | | Data de Cotação <input type="text"/> | | |
| Exclusivo para curva "Libor" | | | | | |
| Parte | | | Contraparte | | |
| Data de Cotação - Libor <input type="text"/> | | Variação Cambial <input type="text"/> | | Data de Cotação - Libor <input type="text"/> | |
| Tipo Classe <input type="text"/> | | Data da Cotação - Variação Cambial <input type="text"/> | | Variação Cambial <input type="text"/> | |
| Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/> , <input type="text"/> | | Alíquota IR <input type="text"/> , <input type="text"/> | | Tipo Classe <input type="text"/> | |
| Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/> , <input type="text"/> | | Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/> , <input type="text"/> | | Data da Cotação - Variação Cambial <input type="text"/> | |
| | | | | Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/> , <input type="text"/> | |
| | | | | Alíquota IR <input type="text"/> , <input type="text"/> | |
| | | | | Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/> , <input type="text"/> | |
| | | | | Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/> , <input type="text"/> | |
| Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional" | | | | | |
| Parte | | | Contraparte | | |
| Taxa Juros <input type="text"/> , <input type="text"/> | | Troca de Fluxo <input type="text"/> | | Taxa Juros <input type="text"/> , <input type="text"/> | |
| Variação Cambial <input type="text"/> | | Tipo Classe <input type="text"/> | | Variação Cambial <input type="text"/> | |
| Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/> , <input type="text"/> | | Alíquota IR <input type="text"/> , <input type="text"/> | | Tipo Classe <input type="text"/> | |
| Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/> , <input type="text"/> | | Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/> , <input type="text"/> | | Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/> , <input type="text"/> | |
| | | | | Alíquota IR <input type="text"/> , <input type="text"/> | |
| | | | | Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/> , <input type="text"/> | |
| | | | | Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/> , <input type="text"/> | |
| Exclusivo para Commodity | | | | | |
| Parte | | | Contraparte | | |
| Cotação Inicial <input type="text"/> , <input type="text"/> | | Codigo da Commodity <input type="text"/> | | Data da Cotação para Ajuste <input type="text"/> | |
| | | | | | |

(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

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

| | | |
|---------------------------------|--|--|
| Período | | É permitida a alteração desde que não tenha existido operação de troca de juros/amortização. É feito 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 feito 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

| Tipo de Swap | Tipo de Contrato | PRAZOS | | |
|--------------------------------|-------------------|--------|---------|-----|
| | | 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

Ação

Alterar Número de Datas de Eventos

Número de Datas de Eventos

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 | Contraparte | CPF/CNPJ Cliente Parte | CPF/CNPJ Cliente Contraparte |
| 05000,00,5 | 05000,10,8 | | 987.654.321-00 |
| Meu Número | Código do Contrato | | |
| | 21100001441 | | |
| Características | | | |
| Data de Registro | Data Início | Data Vencimento | |
| 21/9/2021 | 21/9/2021 | 21/9/2022 | |
| Adesão a Contrato | Valor Base | Valor Total Antecipado | |
| | 1000000,00 | 0,00 | |
| Valor Base Atual | Valor Total Amortizado | Agenda de Prêmio | |
| 1000000,00 | 0,00 | 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 | Categoria | Percentual | Categoria |
| 100,00 | JUROS INTERNACIONAIS | 110,00 | INDICES DE PRECOS |
| Curva | +/- | Curva | +/- |
| SOFR2 | | IPCA | |
| Juros(% aa) | Lim. Inferior (Floor) | Juros(% aa) | Lim. Inferior (Floor) |
| | | | |
| Lim. Superior (Cap) | | Lim. Superior (Cap) | |
| | | | |
| 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 <input type="text"/> | Variação Cambial <input type="text"/> | | Data de Cotação - Libor <input type="text"/> | Variação Cambial <input type="text"/> | |
| Tipo Classe <input type="text"/> | Data da Cotação - Variação Cambial <input type="text"/> | | Tipo Classe <input type="text"/> | Data da Cotação - Variação Cambial <input type="text"/> | |
| Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/> | Alíquota IR <input type="text"/> | | Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/> | Alíquota IR <input type="text"/> | |
| Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/> | Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/> | | Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/> | Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/> | |
| Exclusivo para curva "Taxa Juros Mercado Internacional" | | | | | |
| Parte | | | Contraparte | | |
| Taxa Juros <input type="text"/> | Troca de Fluxo <input type="text"/> | | Taxa Juros <input type="text"/> | Troca de Fluxo <input type="text"/> | |
| Variação Cambial <input type="text"/> | Tipo Classe <input type="text"/> | | Variação Cambial <input type="text"/> | Tipo Classe <input type="text"/> | |
| Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/> | Alíquota IR <input type="text"/> | | Cupom Limpo / Outros - Cotação <input type="text"/> | Alíquota IR <input type="text"/> | |
| Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/> | Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/> | | Limite Inferior (Floor) - Perc. <input type="text"/> | Limite Superior (Cap) - Perc. <input type="text"/> | |
| Exclusivo para curva "Juros Internacionais Overnight" | | | | | |
| Data Liquidação <input type="text"/> | | | | | |
| Parte | | | Contraparte | | |
| Cotação Inicial Moeda <input type="text"/> | Expressão Juros <input type="text"/> | | Cotação Inicial Moeda <input type="text"/> | Expressão Juros <input type="text"/> | |
| Metodologia de composição da taxa <input type="text"/> | Alíquota IR (em %) <input type="text"/> | | Metodologia de composição da taxa <input type="text"/> | Alíquota IR (em %) <input type="text"/> | |
| Deslocamento da taxa <input type="text"/> | | | Deslocamento da taxa <input type="text"/> | | |
| Exclusivo para Commodity e Ação | | | | | |
| Parte | | | Contraparte | | |
| Cotação Inicial <input type="text"/> | Código da Commodity/Ação <input type="text"/> | Data da Cotação para Ajuste <input type="text"/> | Cotação Inicial <input type="text"/> | Código da Commodity/Ação <input type="text"/> | Data da Cotação para Ajuste <input type="text"/> |
| Dados de Operações | | | | | |
| Existem operações nesse contrato entre as datas de início e de correção/aditamento? <input type="text"/> | | | | | |
| <input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="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. |

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

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>accrua</i> l 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>accrua</i> l 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. |

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

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

INTERMEDIACÃO

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

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 | <input type="text" value="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 |
| <input type="text" value="19"/> / <input type="text" value="11"/> / <input type="text" value="2014"/> | <input type="text" value="5"/> , <input type="text"/> | <input type="text" value="PONTA 1"/> ▼ |
| <input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="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 |
|---|--|
| <p>À vista, com contrato registrado em D; data de início em D, agenda de prêmios para D+n</p> | <p>Se não existe operação de pagamento de prêmio para D:</p> <ul style="list-style-type: none"> Permitida alteração (inclusões e exclusões) da agenda de prêmios das datas D até D+n. |
| <p>À termo, com contrato registrado em D; data de início em D+n, agenda de prêmios para D+n</p> | |
| <p>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</p> | <p>Se operação de pagamento de prêmio com status Pendente de Liquidação Financeira:</p> <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. |
| <p>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</p> | |
| Contrato com clientes próprios e entre clientes | |
| <p>À vista, com contrato registrado em D, Data de Início em D, Agenda de Prêmios para D+n</p> | <p>Se não existe operação de pagamento de prêmio para D:</p> <ul style="list-style-type: none"> É permitida alteração (inclusões e exclusões) da agenda de prêmios das datas D até D+n. |
| <p>À termo, com contrato registrado em D, Data de Início em D+n, Agenda de Prêmios para D+n</p> | <p>Se existe operação de pagamento de prêmio:</p> <ul style="list-style-type: none"> É permitida alteração da agenda de prêmios somente para os prêmios futuros. |
| <p>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</p> | <p>Se operação de pagamento de prêmio com status Finalizado:</p> <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. |
| <p>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</p> | |

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.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

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. |

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

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: <ul style="list-style-type: none"> • 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: <ul style="list-style-type: none"> • 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.

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 SEM MODALIDADE.

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"/> | <input type="text"/> |
| <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"/> |

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. |
| 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 |

| Campo | Descrição | Regras |
|--------------------------------------|--|---|
| 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

INTERMEDIÇÃO

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

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 Ocorrencia | Parte (Conta) | Parte (Nome Simplificado) | Estado |
|--------------------|--------------------|---------------|-----------------|---------------|---------------------------|---------------|
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 28/07/2013 | 28/07/2013 | 05000 00-5 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 28/07/2013 | 28/07/2013 | 05000 10-8 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 28/07/2013 | 28/07/2013 | 05000 00-5 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 28/07/2013 | 28/07/2013 | 05000 10-8 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 01/08/2013 | 01/08/2013 | 05000 00-5 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 01/08/2013 | 01/08/2013 | 05000 10-8 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 01/08/2013 | 01/08/2013 | 05000 00-5 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 01/08/2013 | 01/08/2013 | 05000 10-8 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 01/10/2013 | 01/10/2013 | 05000 00-5 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 01/10/2013 | 01/10/2013 | 05000 10-8 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 01/10/2013 | 01/10/2013 | 05000 00-5 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 01/10/2013 | 01/10/2013 | 05000 10-8 | RIOBM | LIQUIDADO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 01/10/2015 | 01/10/2015 | 05000 00-5 | RIOBM | NÃO LIQUIDADO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 01/10/2015 | 01/10/2015 | 05000 10-8 | RIOBM | NÃO LIQUIDADO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 01/10/2015 | 01/10/2015 | 05000 00-5 | RIOBM | NÃO LIQUIDADO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 01/10/2015 | 01/10/2015 | 05000 10-8 | RIOBM | NÃO LIQUIDADO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 15/12/2017 | 15/12/2017 | 05000 00-5 | RIOBM | ATIVO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 15/12/2017 | 15/12/2017 | 05000 10-8 | RIOBM | ATIVO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 15/12/2017 | 15/12/2017 | 05000 00-5 | RIOBM | ATIVO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 15/12/2017 | 15/12/2017 | 05000 10-8 | RIOBM | ATIVO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 01/10/2024 | 01/10/2024 | 05000 00-5 | RIOBM | ATIVO |
| 13H0000208 | PAGAMENTO DE JUROS | 01/10/2024 | 01/10/2024 | 05000 10-8 | RIOBM | ATIVO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 01/10/2024 | 01/10/2024 | 05000 00-5 | RIOBM | ATIVO |
| 13H0000208 | AMORTIZACAO | 01/10/2024 | 01/10/2024 | 05000 10-8 | RIOBM | ATIVO |

« 1 Exibir página » »

Obter no formato: ▾

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 | Indica a data em que o evento exibido no campo “ Data Original ” será liquidado. 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). |
| Parte (Conta) | Conta própria do participante no contrato de Swap. |
| Parte (Nome Simplificado) | Nome simplificado do participante no contrato de Swap. |
| Estado | Indica o estado daquele evento, sendo as opções disponíveis: <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 | | Data Início 26/07/2013 | | Data Vencimento 01/10/2024 | | | |
| Valor Base 1.000.000,00 | | | | Valor Amortizado 700.000,00 | | | |
| Parte | | | | Contraparte | | | |
| Parte (Conta) 05000.00-5 | | Parte (Nome Simplificado) RIOBM | | Contraparte (Conta) 05000.10-8 | | Contraparte (Nome Simplificado) RIOBM | |
| Percentual 100,00 | | Curva VCP | | Percentual 100,00 | | Curva VCP | |
| +/- | | Juros(% aa) 0,0000 | | +/- | | Juros(% aa) 6,7900 | |
| Data Atualizacao da Parte 14/10/2020 | | Valor da Curva Atualizado - Parte 300.000,00 | | Data Atualizacao da Contraparte 27/02/2020 | | Valor da Curva Atualizado - Contraparte 345.000,00 | |
| Dados do Evento | | | | | | | |
| Data Original 28/07/2013 | Data Ocorrencia 29/07/2013 | Operação PAGAMENTO DE JUROS | Dias Úteis 1 | Taxa TJMI | % Amortização | Tx Juros (fi constante) | Estado LIQUIDADO |
| Lim. Inf. | Lim. Sup. | | | | | | |
| <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Sair"/> | | | | | | | |

Nesta tela o Participante pode consultar detalhadamente o evento selecionado.

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIACÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

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

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"/> |

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

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 / / - / /

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)

Parte (Conta)

Contraparte (Nome Simplificado)

Contraparte (Conta)

Código do Contrato

Liquidação do Reset

Data Registro -

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

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 > »

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 arrendimento 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

Tela de Relação

Consulta Contratos Com Opção de Arrendimento 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 > »

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: indices@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, Prefixado 365 d, 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

A captura de tela mostra a interface de usuário para 'Receber Arquivos'. No topo, há uma barra de navegação com o caminho: > Transf.de Arquivo > Arquivo > Receber Arquivos. Abaixo, o título 'Receber Arquivos' está em uma barra azul. O formulário contém campos para 'Data:' (30/09/2021), 'Sistema:' (...todos os Sistemas) e 'Malote:' (campo vazio). Há botões para 'Pesquisar' e 'Gerar todos arquivos'. Na base do formulário, há uma barra de status com os seguintes dados: 'Arquivos do dia' (30/09/2021) e 'Sistema:' (...todos os Sistemas).

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. | <p>Sim, somente para contratos que envolvam contas de clientes 1.</p> <p>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.</p> | <p>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.</p> |
| 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. | <p>Sim, somente para contratos que envolvam contas de clientes 1.</p> <p>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.</p> | <p>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.</p> |

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 de 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. |

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**.

Prêmio já foi pago. Os direitos são transferidos.

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

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 $=$ Fator Trigger $=$ 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)**, está 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 |

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

| 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 |
| PREFIXADO 365 | 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)

SUMÁRIO

REGISTRO

FUNCIONALIDADES

ANTECIPAÇÃO

CESSÃO

ALTERAÇÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

- 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)]

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 |

| | | | |
|----------------------|-------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| • Prefixado 365D | 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**.

**31.13 Cruzamento 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 |
| PREFIXADO 365 | S | N | N | S | S | S |
| DOLAR | 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 |
|---|-------------------------|-------------------------|---|-----------------|------------------|-------------------|
| DOLAR COMERCIAL EXPONENCIAL | S | S | S | S | S | S |
| EURO/COM.EUROPEIA | S | S | S | S | S | S |
| 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

INTERMEDIÇÃO

CONSULTAS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

CONSULTAS

INTERMEDIACÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

ALTERAÇÃO

CESSÃO

ANTECIPAÇÃO

FUNCIONALIDADES

REGISTRO

SUMÁRIO

32 ATUALIZAÇÃO DA VERSÃO

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|--|--|
| 24/06/2024 | 24/06/2024 | Antecipação e Agendamento da liquidação para D+1 | Inclusão do campo "Data de Liquidação" possibilitando antecipar o Swap e agendar a liquidação para D+1, conforme divulgado no Comunicado Externo 011/2024-VPC. |
| 24/06/2024 | 24/06/2024 | Curva Calculada de PRE 365 | Inclusão da curva calculada Prefixada 365 para o registro de Swap de Pagamento Final e Fluxo Não Constante, conforme divulgado no Comunicado Externo 022/2024-VPC. |
| 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 CIEQVV01 Index; 20420 CPI; 20421 PPI; 20481 ABGSD007 Index; 20500 GSIRTR01 Index; 20501 GSIRTR02 Index; 20502 ABGSCCC8 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". |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|---|--|
| 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. |
| 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 GSFID63 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 TF04 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. |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|--|---|
| 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. |
| 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 MOV13 BZ Equity; 18481 POS13 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. |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|---|--|
| 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 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 | Índices Internacionais | Inclusão do Tipo/Classe: 17439 BNPIFIN Index; 17840 CSEAFTR Index; 17920 CIMAATH1 Index; 17440 SOLXPGLV Index e 17441 ARKK UP Equity. |
| 13/12/2021 | 13/01/2022 | Índices 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-VP. |
| 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 |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|---|--|
| | | | 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 | Índices Internacionais | Inclusão do Tipo/Classe: 17600 MSFDVTAI Index e 17701 BNPIMAU5 Index. |
| 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 Necessarias”. |
| 20/09/2021 | 23/09/2021 | Índices de Preço | Inclusão sobre “cálculo de pro rata” na coluna de “Informações Necessarias”. |
| 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. |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|---------------|-----------------------|---|--|
| 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. |
| 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 |
| | 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 |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|---|--|
| 29/06/2020 | | | 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. |
| 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. |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|---|---|
| 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 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 CIMAAIAI Index; 15504 M1US00V 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. |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|---|--|
| 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. |
| 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 GDJX US Equity. |
| 29/06/2020 | 31/07/2020 | Índices Internacionais | Inclusão do Tipo/Classe: 14544 CSTREND Index; 15327 MSUSMPT6 Index; 15328 MSFDVT12 Index; 15329 MSFDM5V9 Index e 15330 MSFDM511 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". |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|--|--|
| 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 ¼ 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. |
| 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 BRRCR11 (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. |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|--|---|
| 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. |
| 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 Equity. |
| 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\$)” |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|---|--|
| 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. |
| 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. |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|---|--|
| 28/05/2018 | 26/07/2019 | Ações Nacionais | Inclusão do Tipo/Classe: 14075 TAE11 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 |
| 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 RAP4 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) |

| Versão | Atualização em | Referência | Atualização |
|------------|----------------|------------------------|---|
| 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 |

INFORMAÇÕES ADICIONAIS

CONSULTAS

INTERMEDIACÃO

EXERCÍCIO DA OPÇÃO

ALTERAÇÃO

CESSÃO

ANTECIPAÇÃO

FUNCIONALIDADES

REGISTRO

SUMÁRIO