

DERIVATIVOS REALIZADOS NO EXTERIOR

CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÕES DA VERSÃO	3
2 INTRODUÇÃO AOS DERIVATIVOS REALIZADOS NO EXTERIOR	5
2.1 Conhecendo o Produto	5
2.2 Ações dos Botões das Telas	5
3 LANÇAMENTO	6
3.1 Registro de Derivativo Vinculado.....	6
3.2 Cadastro de Cliente Não Residente	11
3.3 Manutenção de Cadastro de Cliente Não Residente	14
3.4 Registro de Derivativo Contratado no Exterior	17
4 CONSULTA	25
4.1 Consulta de Registro de Derivativos	25
4.2 Consulta de Derivativos Contratados no Exterior	32
4.3 Histórico de Alteração/Atualização de Contrato (DCE)	41
5 ADMINISTRAÇÃO	44
5.1 Manutenção de Contas de Clientes (DCE).....	44
6 INFORMAÇÕES ADICIONAIS	46
6.1 Lista de Ativos	46
6.2 Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros	46
7 GLOSSÁRIO	48

1 ATUALIZAÇÕES DA VERSÃO

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
18/08/2016	27/02/2026	Derivativo Contratado no Exterior – DCE	Atualização da menção a Resolução do BCB ref. aos derivativos que devem ser registrados, passando a constar no item “Derivativo Contratado no Exterior (DCE)” a Resolução 4.948, de setembro de 2021.
18/08/2016	16/04/2018	Registro de Derivativo Contratado no Exterior Consulta de Derivativos Contratados no Exterior	Melhoria da descrição dos campos “Ativo Subjacente (Parte)”, “Moeda Cotada”, “Moeda de Liquidação:”.
18/08/2016	17/02/2016	Registro de Derivativo Vinculado	Alteração da descrição do campo Moeda Referência.
18/08/2016	17/02/2016	Registro de Derivativo Contratado no Exterior	Alteração da descrição do campo Valor Base, Moeda de Liquidação e Preço.
18/08/2016	07/10/2016	Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros	Inclusão do tópico.
18/08/2014	11/05/2016	Consulta de Derivativos Contratados no Exterior	Alterações no texto da visão geral e na descrição do campo “Valor Base”.
18/08/2014	11/05/2016	Consulta de Registro de Derivativos	Inclusão dos campos: Meu número, Valor Base, Adesão a Contrato, N° controle interno, Fator de risco ativo, fator de risco passivo, complemento risco ativo, complemento risco passivo e dados complementares.
18/08/2014	11/05/2016	Registro de Derivativo Vinculado Registro de Derivativo Contratado no Exterior	Alteração na descrição do campo “Valor Base”.
18/08/2014	05/05/2016	Registro de Derivativo Vinculado Registro de Derivativo Contratado no Exterior	Alteração na descrição do campo “Valor Base”.
18/08/2014	20/04/2016	Conhecendo o Produto	Atualização no texto.
18/08/2014	20/04/2016	Registro de Derivativo Vinculado	Atualização da observação 1 e inclusão da observação 5.
18/08/2014	20/04/2016	Registro de Derivativo Contratado no Exterior	Atualização da observação 2 e inclusão da observação 5.
18/08/2014	21/08/2015	Registro de Derivativo Contratado no Exterior	Alteração na descrição do campo “Data de Vencimento”.
18/08/2014	31/03/2015	Lista de Ativos	A Tabela de Moedas foi retirada do manual, uma vez que existe o arquivo público AAAAMMDD_Dominios_DCE.txt que é atualizado diariamente e de forma automática.
18/08/2014	31/10/2014	Atualizações da Versão	Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais nova para a mais antiga.
18/08/2014	04/09/2014	Todo o manual	Arrumação das funções conforme estão no NoMe.
18/08/2014	04/09/2014	Todo o manual	Nas descrições dos campos, inclusão da informação se o preenchimento é obrigatório ou não e atualização de algumas telas conforme estão no NoMe.
18/08/2014	18/08/2014	Consulta de Derivativo Contratado no Exterior	Mudança na descrição do campo Papel.
14/04/2014	30/07/2014	Registro de Derivativo Contratado no Exterior	Mudança na descrição do campo Valor Base.
14/04/2014	15/07/2014	Registro de Derivativo Contratado no Exterior	Melhoria na descrição do campo Valor Base.
14/04/2014	10/06/2014	Registro de Derivativo Contratado no Exterior	Melhoria na descrição dos campos: Tipo de Mercado, Valor Base, Moeda de Liquidação, Código da Parte/Contraparte, Dados Complementares e Preço (Contrato de Termo).

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
14/04/2014	13/05/2014	Registro de Derivativo Vinculado	No Campo Valor Base melhoria na descrição.
14/04/2014	14/04/2014	Registro e Alteração de Derivativo Contratado no Exterior	Alteração da regra de validação dos campos Data de Início e Data de Vencimento.
17/03/2014	28/03/2014	Administração – Manutenção de Contas de Clientes	Inclusão da função.
17/03/2014	18/03/2014	Registro de Derivativo Contratado no Exterior	Atualização da Resolução do BACEN De: 3.833 Para: 3.312.
17/03/2014	17/03/2014	Registro de Derivativo Contratado no Exterior e novas Consultas.	Mudança no registro. Conforme os comunicados 124/13, 007/14 e 016/14.
22/07/2013	22/07/2013	Registro de Derivativo Contratado no Exterior	Campo valor base aumento no formato. Conforme comunicado 055/13.
20/05/2013	20/05/2013	Informações Adicionais	Inclusão da informação adicional Tabela de Moedas e inclusão da moeda CNH (IUAN RENMINBI CHINÊS - OFFSHORE).
21/11/2011	20/02/2013	Campos com a descrição opcional.	Mudança na descrição. De: Campo ou Preenchimento Opcional. Para: Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
21/11/2011	18/10/2012	Opção Excluir	Mudança no texto da "Exclusão".
21/11/2011	16/10/2012	Limite de Alta e Limite de Baixa.	Exclusão a menção ao fator de risco nos campos.

2 INTRODUÇÃO AOS DERIVATIVOS REALIZADOS NO EXTERIOR

2.1 Conhecendo o Produto

O Módulo de Derivativos Realizados no Exterior tem por objetivo viabilizar o registro documental desses derivativos de duas formas:

1. Derivativo Vinculado a Empréstimos - DVE

Devem ser registrados os derivativos de acordo com a Circular nº 3.474, de 11 de novembro de 2009.

O DVE é o instrumento financeiro derivativo que se vincule ao custo da dívida originalmente contratada em empréstimo entre residente ou domiciliado no País e residente ou domiciliado no exterior, inclusive por pessoa natural ou jurídica não financeira, realizada nos termos da Resolução nº 2.770, de 30 de agosto de 2000, do Conselho Monetário Nacional.

2. Derivativo Contratado no Exterior (DCE)

Devem ser registrados os derivativos de acordo com a seguinte resolução do Banco Central do Brasil:

Resolução nº 4.948, de 30 de Setembro de 2021;

As instituições financeiras e demais instituições autorizadas a funcionar pelo Banco Central do Brasil podem realizar operações de derivativos no exterior, de qualquer modalidade regularmente praticada no mercado internacional.

Observação: Para maiores informações sobre como acessar o módulo, consulte o manual do NoMe.

2.2 Ações dos Botões das Telas

Os botões das telas exibidas ao longo do manual estão relacionados às seguintes ações:

Botão	Funcionalidade
Atualizar	Reexecuta a consulta a partir dos filtros selecionados na tela anterior, atualizando eventuais dados que tenham sido alterados, entre a consulta e a nova atualização da Tela de Relação.
Confirmar	Confirma os dados informados em tela.

Botão	Funcionalidade
Corrigir	Retorna a tela anterior para correção de dados.
Desistir	Desiste da operação, retornando à tela da área de serviços.
Enviar	Envia os dados informados para validação.
Limpar campos	Limpa todos os campos selecionados e digitados.
Pesquisar	Submete os dados selecionados para pesquisa.
Voltar	Retorna à tela anterior.
Sair	Sai da função, retornando a tela inicial do Módulo.

3 LANÇAMENTO

3.1 Registro de Derivativo Vinculado

Menu Derivativos Realizados no Exterior > Lançamento > Registro de Derivativo Vinculado

Visão Geral

Esta função permite que os Participantes registrem contratos de **DVE**.

O registro de **DVE** no Módulo de Derivativos Realizados no Exterior é apenas documental, ou seja, não ocorre atualização de valores, nem liquidação financeira através da B3, sendo de total responsabilidade dos Participantes a correta inserção dos dados do contrato.

O contrato recebe automaticamente uma codificação quando registrado, conforme mostra o quadro abaixo:

Observações:

- 1 - O registro do DVE deve ser realizado dentro do horário da grade CTP11, conforme Circular 3.474.
- 2 - O registro do DVE deve ser efetuado: (a) por duplo comando quando ambas as partes forem Participantes; (b) por comando único da Instituição Financeira que seja parte residente ou domiciliada no País, quando a outra parte residente ou domiciliada no País for seu Cliente.
- 3 - Os Participantes podem consultar ou lançar as operações de registro de DVE através da função **Manutenção de Operações Pendentes**, no módulo **Operações**.
- 4 - É permitida alteração no contrato, a qualquer momento, no período compreendido entre a data do registro, até d-1 do vencimento do contrato. Para isso, basta acessar a função **Consulta de Registro de Derivativos**.

5- Não é permitido o registro do DVE em data igual ou posterior ao vencimento do derivativo.

Tela de Registro

Registro de Derivativo Vinculado a Empréstimo			
INCLUSÃO			
Dados da Parte			
Parte (Conta) <input type="text"/>	Papel <input type="text"/>	CPF/CNPJ Cliente Parte <input type="text"/>	CADEMP Cliente Parte <input type="text"/>
Meu Número <input type="text"/>			
Dados da Contraparte			
Contraparte (Conta) <input type="text"/>	Papel <input type="text"/>	CPF/CNPJ Cliente Contraparte <input type="text"/>	CADEMP Cliente Contraparte <input type="text"/>
Características			
Tipo de Derivativo <input type="text"/>	Valor Base <input type="text"/>	Moeda Referência <input type="text"/>	
Moeda Referência <input type="text"/>	Adesão a Contrato <input type="text"/>	Data Início <input type="text"/>	Data Vencimento <input type="text"/>
Fator de Risco Ativo <input type="text"/>	Fator de Risco Passivo <input type="text"/>	Complemento Risco Ativo <input type="text"/>	
Complemento Risco Ativo <input type="text"/>	Complemento Risco Passivo <input type="text"/>	Notional Mínimo (%) <input type="text"/>	
Notional Mínimo (%) <input type="text"/>	Notional Máximo (%) <input type="text"/>	Dados Complementares <input type="text"/>	
Dados da Operação de Empréstimo			
Tipo de Operação <input type="text"/>	Valor da Operação <input type="text"/>	Código Contrato ROF <input type="text"/>	
Código Contrato ROF <input type="text"/>	Moeda <input type="text"/>	Data de Início <input type="text"/>	Data de Vencimento <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Nesta tela o Participante e sua Contraparte devem informar os dados relativos ao DVE que pretendem registrar.

Após a inserção dos campos na tela e clicar no botão **Enviar**, o módulo exibe tela de confirmação para o usuário verifique se as informações do contrato estão corretas. A verificação das características inseridas é importante, visto que, o módulo realiza apenas o registro documental do contrato.

Descrição dos campos da Tela de Registro

Campo	Descrição
Inclusão de Dados da Parte	

Campo	Descrição
Parte (Conta)	Campo de preenchimento obrigatório. Código que identifica o Participante que está registrando o contrato.
Papel	Campo de preenchimento obrigatório. Especifica o papel da Parte no contrato. Se o campo Tipo de Derivativo for Contrato Futuro, Termo de Moedas ou Termo de Mercadorias , preencher com Comprador ou Vendedor . Se o campo Tipo de Derivativo for Contrato de Swap , preencher com Parte . Se o campo Tipo de Derivativo for Opções Flexíveis de Ação, Moedas ou Índices , preencher com Lançador ou Titular .
CPF/CNPJ Cliente Parte	Identificação do Cliente do Participante. Campo de preenchimento obrigatório apenas quando for indicada Conta de Cliente, no campo Parte (Conta) e se o CADEMP não tiver sido informado. O módulo verifica se o CPF/CNPJ está cadastrado como Cliente do Participante Parte ou Contraparte.
CADEMP Cliente Parte	Número do CADEMP do Cliente Parte no contrato. Campo de preenchimento obrigatório na hipótese de não ter sido informado o campo CPF/CNPJ Cliente Parte . Deve ser previamente cadastrado no módulo através da função Cadastro de Cliente Não Residente .
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Número de identificação do Participante na operação.
Inclusão de Dados da Contraparte	
Contraparte (Conta)	Código que identifica o Participante com quem é efetuado o contrato.
Papel	Campo de preenchimento obrigatório. Especifica o papel da Contraparte no contrato. Se o campo Tipo de Derivativo for Contrato Futuro, Termo de Moedas ou Termo de Mercadorias , preencher com Comprador ou Vendedor . Se o campo Tipo de Derivativo for Contrato de Swap , preencher com Contraparte . Se o campo Tipo de Derivativo for Opções Flexíveis de Ação, Moedas ou Índices , preencher com Lançador ou Titular .
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Identificação do Cliente do Participante. Campo de preenchimento obrigatório apenas quando for indicada Conta de Cliente, no campo Contraparte (Conta) e se o CADEMP não tiver sido informado. O módulo verifica se o CPF/CNPJ está cadastrado como Cliente do Participante Parte ou Contraparte.

Campo	Descrição
CADEMP Cliente Contraparte	Número do CADEMP do Cliente Contraparte no contrato. Campo de preenchimento obrigatório na hipótese de não ter sido informado o campo CPF/CNPJ Cliente Contraparte . Deve ser previamente cadastrado no módulo através da função Cadastro de Cliente Não Residente .
Características – Campos de preenchimento obrigatório.	
Tipo de Derivativo	Indicar o tipo de derivativo objeto do contrato. Caixa de seleção com as opções: Contrato Futuro, Contrato Swap, Opções Flexíveis de Ação, Opções Flexíveis de Moedas, Opções Flexíveis de Índices, Termo de Mercadorias, Termo de Moedas, Derivativo de Crédito, Termo de Taxa de Juros e Opções.
Valor Base	Indica o valor base do contrato de derivativos. Formato: 11 inteiros e 2 decimais. Deve ser informado na mesma moeda preenchida no campo “Moeda Referência”. O Valor Base deverá ser formado através da seguinte equação para cada ativo: $\text{Valor Base} = \text{Quantidade de Ativos} \times \text{Tamanho do Contrato} \times \text{Strike} \text{ - Opção}$ $\text{Valor Base} = \text{Quantidade de Ativos} \times \text{Tamanho do Contrato} \times \text{Taxa a Termo} \text{ - Termo}$ $\text{Valor Base} = \text{Quantidade de Ativos} \times \text{Tamanho do Contrato} \times \text{Preço do Ativo} \text{ - Swap}$ $\text{Valor Base} = \text{Quantidade de Ativos} \times \text{Tamanho do Contrato} \times \text{Preço do Ativo} \text{ - Swaption}$ $\text{Valor Base} = \text{Quantidade} \times \text{PU} \text{ - Nota Estruturada}$ $\text{Valor Base} = \text{Quantidade de Contratos} \times \text{Tamanho do contrato} \times \text{Preço do at} \text{ - Futuro.}$ $\text{Valor Base} = \text{Quantidade de Contratos} \times \text{Tamanho do contrato} \times \text{Preço do at} \text{ - CDF}$ $\text{Valor Base} = \text{Quantidade de Contratos} \times \text{Tamanho do contrato} \times \text{Preço do at} \text{ - CDS}$ <p>Observação: caso o “Preço do Ativo” seja cotado em centavos, informar o Valor Base convertido na unidade inteira da respectiva moeda.</p>

Campo	Descrição
Moeda Referência	Caixa de seleção para o Participante indicar a moeda na qual o contrato foi realizado. A relação completa pode ser consultada no manual de Transferência de Arquivos - opção Enviar Arquivos.
Adesão a Contrato	Indica a existência de adesão a contratos padronizados. Caixa de seleção com as opções: CGD , CGD/CSA , CSA , ISDA e Nenhum .
Data Início	Data inicial do contrato. Deve ser maior ou igual a 01/01/2000.
Data Vencimento	Indicar a data de vencimento do contrato. Deve ser maior que Data Início.
Fator de Risco Ativo	Indica em qual Fator de Risco o Tomador final da operação de empréstimo está ativo. Caixa de seleção com as opções: Taxa de Juros - Pré; Taxa de Juros - Flutuante; Índice – Índice Nacional; Índice - Índice DI; Índice – Índice Internacional; Variação Cambial - Dólar Americano; Variação Cambial - EURO; Variação Cambial - IENE; Variação Cambial - Libra; Variação Cambial - Outras Moedas; Commodities – Negociadas em Real; Commodities – Negociadas em Outras Moedas e Nenhum.
Fator de Risco Passivo	Indica em qual Fator de Risco o Tomador final da operação de empréstimo está passivo. Caixa de seleção com as opções: Taxa de Juros - Pré; Taxa de Juros - Flutuante; Índice – Índice Nacional; Índice - Índice DI; Índice – Índice Internacional; Variação Cambial - Dólar Americano; Variação Cambial - EURO; Variação Cambial - IENE; Variação Cambial - Libra; Variação Cambial - Outras Moedas; Commodities – Negociadas em Real; Commodities – Negociadas em Outras Moedas e Nenhum.
Descrição do Fator de Risco Ativo	Campo para descrição de informações adicionais referentes ao Fator de Risco Ativo.
Descrição do Fator de Risco Passivo	Campo para descrição de informações adicionais referentes ao Fator de Risco Passivo.
% Notional Mínimo	Percentual mínimo do valor base sobre o qual o ajuste da operação pode ser calculado, tendo como base o Tomador final da operação de empréstimo. Pode ser informado com até 4(quatro) números inteiros e 2(dois) decimais.
% Notional Máximo	Percentual máximo do valor base sobre o qual o ajuste da operação pode ser calculado, tendo como base o Tomador final da operação de empréstimo. Pode ser informado com até 4(quatro) números inteiros e 2(dois) decimais.

Campo	Descrição
Dados Complementares	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Neste campo o Participante pode descrever dados adicionais relativos ao contrato de derivativo está sendo cadastrado.
Dados da Operação de Empréstimo – Campos de preenchimento obrigatório.	
Tipo de Empréstimo	Indicar o tipo de empréstimo, a parte da operação que está sendo realizada. Caixa de seleção com as opções: Direta: Parte Dest. Final Nacional; Direta: Contraparte Dest. Final Nacional; Repasse: Parte Dest. Final Nacional; e Repasse: Contraparte Dest. Final Nacional.
Valor da Operação	Informar o valor da operação de empréstimo.
Código Contrato ROF	ROF - Registro de Operações Financeiras. Código obtido quando do registro da operação financeira junto ao SISBACEN - Sistema de Informações do Banco Central do Brasil.
Moeda	Caixa de seleção para o Participante indicar a moeda na qual a operação de empréstimo foi realizada.
Data de Início	Indicar a data de início da operação de empréstimo a qual o contrato está vinculado.
Data de Vencimento	Indicar a data de vencimento da operação de empréstimo a qual o contrato está vinculado.

3.2 Cadastro de Cliente Não Residente

Menu Derivativos Realizados no Exterior > Lançamento > Cadastro de Cliente Não Residente

Visão Geral

Função exclusiva para Contratos DVE.

Esta função possibilita que os Participantes cadastrem os Clientes Não Residentes que participam do registro do contrato e que não possuam CPF/CNPJ cadastrado no **SIC - Módulo de Identificação de Comitentes**.

Para registrar um Cliente no módulo, este deve possuir cadastro no **CADEMP - Cadastro de Empresas Área Desig**, do **Banco Central do Brasil**.

O registro do Contrato de Derivativo Vinculado a empréstimos só é efetivado se o número do CADEMP for válido e estiver cadastrado como Cliente de algum Participante.

Tela Filtro Cadastro de Cliente Não Residente

Cadastro de Cliente Não Residente			
Dados do Cliente			
Participante(ContaPrópria)	10020	00	1
CADEMP	123457		
Tipo de Pessoa	Pessoa Jurídica Não Residente		
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Após inserir os dados e clicar no botão **Confirmar**, o módulo apresenta tela para informação dos dados do Cliente.

Descrição dos campos da Tela Filtro Cadastro de Cliente Não Residente

Campo	Descrição
Dados do Cliente – Campos de preenchimento obrigatório.	
Participante (Conta Própria)	Campo onde o Participante deve informar sua Conta B3.
CADEMP	Informar o número do CADEMP, obtido através de registro em sistema do Banco Central do Brasil. Observação: É de inteira responsabilidade do Participante a informação do número do CADEMP correto de seu Cliente Não Residente.
Tipo de Pessoa	Campo para indicação da natureza do Cliente Não Residente. Caixa de seleção com opções: Pessoa Física Estrangeira e Pessoa Jurídica Estrangeira .

Tela Cadastro de Cliente Não Residente

Cadastro de Cliente Não Residente			
INCLUSÃO			
Participante(ContaPrópria)	CADEMP	Tipo de Pessoa	
10020.00-1	123457	Pessoa Jurídica Não Residente	
Dados do Cliente			
Nome/Razão Social		Endereço/Logradouro	
<input type="text"/>		<input type="text"/>	
Número	Complemento		
<input type="text"/>	<input type="text"/>		
ZIP	Cidade		
<input type="text"/>	<input type="text"/>		
Estado/Província/Região	País		
<input type="text"/>	<input type="text"/>		
Tipo de Email	e-mail		
<input type="text"/>	<input type="text"/>		
Tipo de Telefone	DDI	DDD	Telefone
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Na tela o Participante deve informar os dados relativos à localização e contato de seu Cliente.

Após a inserção dos dados, o Participante deve clicar no botão **Enviar**. Em seguida, o módulo exibe tela de confirmação dos dados, para que o Participante finalize o cadastro.

Descrição dos campos da Tela Cadastro de Cliente Não Residente

Campo	Descrição
Dados do Cliente – Campos de preenchimento obrigatório, exceto os campos Número e Complemento.	
Nome/Razão Social	Informar o nome ou a Razão Social do Cliente Não Residente.
Endereço/Logradouro	Informar o endereço/logradouro do Cliente Não Residente.
Número	Indicar o número correspondente ao endereço informado.
Complemento	Indicar o complemento correspondente ao endereço informado.
ZIP	Código de endereçamento postal relativo ao endereço do Cliente Não Residente.
Cidade	Indicar a Cidade onde o Cliente Não Residente está localizado.
Estado	Indicar o Estado onde o Cliente Não Residente está localizado.
País	Selecionar o país onde o Cliente Não Residente está localizado.
Tipo de E-mail	Indicar o tipo de e-mail utilizado. Caixa de Seleção com as opções: Particular ou Comercial .

Campo	Descrição
E-mail	Indicar o e-mail do Cliente Não Residente.
Tipo de Telefone	Indicar o tipo de telefone utilizado. Caixa de Seleção com as opções: Particular ou Comercial .
DDI	Código para Discagem Direta Internacional atribuído ao país no qual o Cliente Não Residente está lotado.
DDD	Código para Discagem Direta a Distância atribuído à cidade na qual o Cliente Não Residente está lotado.
Telefone	Telefone do Cliente Não Residente.

3.3 Manutenção de Cadastro de Cliente Não Residente

Menu Derivativos Realizados no Exterior > Lançamento > Manutenção de Cadastro de Cliente Não Residente

Visão Geral

Função exclusiva para contratos DVE.

Esta função permite que o Participante altere, exclua ou consulte o cadastro de seu Cliente Não Residente.

Tela Filtro Manutenção de Cadastro de Cliente Não Residente

Manutenção de Cadastro de Cliente Não Residente

Dados do Cliente

CADEMP

Tipo de Pessoa

Descrição dos campos da Tela Filtro Manutenção de Cadastro de Cliente Não Residente


Campo	Descrição
CADEMP	Número do CADEMP, obtido através de registro em sistema do Banco Central do Brasil.
Tipo de Pessoa	Campo de preenchimento obrigatório. Campo para indicação da natureza do Cliente Não Residente. Caixa de seleção com opções: Pessoa Física Estrangeira e Pessoa Jurídica Estrangeira .

Tela de Relação Cliente Não Residentes

Relação de Clientes Não Residentes						
Página 1 de 2 (Linhas 1 a 30 de 35)						
Data e Hora da Consulta: 04/09/2014 - 14:54:03						
 Critério de pesquisa						
Ação	Participante(ContaPrópria)	CADEMP	Nome/Razão Social	Data de Inclusão	Tipo de Pessoa	
	66690.81-8	AA8	AA8	18/01/2010	PJ	
CONSULTA	66690.87-0	AA13	A13	18/01/2010	PJ	
ALTERAR	66690.85-6	AA12	AA12	18/01/2010	PJ	
EXCLUIR		560543	BANCO ITAU BBA S.A - NASSAU BRANCH	18/01/2010	PJ	
	66690.79-1	AA6	AA6	18/01/2010	PJ	


A partir do resultado obtido através dos dados da tela filtro, o módulo exibe tela com o(s) Cliente(s) Não Residente(s) encontrado(s).

Na caixa de seleção do campo **Ação**, o Participante tem a possibilidade de **consultar**, **alterar** ou **excluir** um determinado cadastro.

Após selecionar a opção **Consultar** e clicar no ícone , o módulo exibe tela com todas as informações do Cliente, registradas na função **Cadastro de Cliente Não Residente**.


Opção Consultar

Cadastro de Cliente Não Residente			
CONSULTA			
CADEMP	Tipo de Pessoa		
AA8	Pessoa Jurídica Não Residente		
Dados do Cliente			
Nome/Razão Social	Endereço/Logradouro		
AA8	AA8		
Número	Complemento		
	AA8		
ZIP	Cidade		
AA8	AA8		
Estado/Província/Região	País		
AA8	AZERBAIJAO		
Tipo de Email	e-mail		
COMERCIAL	A@ACIM.CA		
Tipo de Telefone	DDI	DDD	Telefone
COMERCIAL	012	012	012346

Após selecionar a opção **Alterar** e clicar no ícone , o módulo exibe tela **Cadastro de Cliente Não Residente** com os campos editáveis. Não é permitida a alteração do número do **CADEMP** e do **Tipo de Pessoa**.

Opção Alterar

Cadastro de Cliente Não Residente			
ALTERAÇÃO			
CADEMP AA8	Tipo de Pessoa Pessoa Jurídica Não Residente		
Dados do Cliente			
Nome/Razão Social AA8 <input type="text"/>		Endereço/Logradouro AA8 <input type="text"/>	
Número <input type="text"/>	Complemento AA8 <input type="text"/>		
ZIP AA8 <input type="text"/>	Cidade AA8 <input type="text"/>		
Estado/Provincia/Região AA8 <input type="text"/>	País AZERBAJAO <input type="text"/>		
Tipo de Email COMERCIAL <input type="text"/>	e-mail A@ACIM.CA <input type="text"/>		
Telefone			
Tipo de Telefone COMERCIAL <input type="text"/>	DDI 012 <input type="text"/>	DDD 012 <input type="text"/>	Telefone 012346 <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Após selecionar a opção **Excluir** e clicar no ícone , o módulo exibe tela com as informações do Cliente Não Residente. Clique em **Confirmar** para excluir o cadastro do Cliente.

Opção Excluir

Cadastro de Cliente Não Residente			
EXCLUSÃO			
CADEMP	Tipo de Pessoa		
AA8	Pessoa Jurídica Não Residente		
Dados do Cliente			
Nome/Razão Social		Endereço/Logradouro	
AA8		AA8	
Número		Complemento	
AA8		AA8	
ZIP		Cidade	
AA8		AA8	
Estado/Provincia/Região		País	
AA8		AZERBAIJAO	
Tipo de Email		e-mail	
COMERCIAL		A@ACIM.CA	
Tipo de Telefone		DDI	DDD
COMERCIAL		012	012
		Telefone	
		012346	

Observações:

- 1 - Após o cadastramento de um CADEMP por um Participante, todos os demais Participantes podem utilizar esse mesmo cadastro. No entanto, fica restrita, ao Participante que efetuou a sua inclusão, a possibilidade de efetuar a sua manutenção.
- 2 - O cadastro de um Cliente Não Residente só pode ser excluído pelo Participante que o registrou e quando não haja contratos registrados com o respectivo CADEMP.
- 3 - Um CADEMP que já tenha sido utilizado e foi excluído, pode ser utilizado novamente.

3.4 Registro de Derivativo Contratado no Exterior

Menu Derivativos Realizados no Exterior > Lançamento > Registro de Derivativo Contratado no Exterior

Visão Geral

Esta função permite efetuar o registro de contratos **DCE** por comando único da Instituição Registradora.

O registro de **DCE** no Módulo de Derivativos Realizados no Exterior é apenas documental.

O contrato recebe automaticamente uma codificação quando registrado, conforme mostra o quadro abaixo:

Observações:

1 - A operação de registro pode ser cancelada, por comando único da Instituição Registradora, somente na data do registro, no Módulo de **Operações**, função Cancelamento de Operação. **2**- É permitido alteração no contrato, a qualquer momento, no período compreendido entre a data do registro, até d-1 do vencimento do contrato. Para isso, basta acessar a função **Consulta de Registro de Derivativos**.

3- Não é permitido o registro do DCE em data igual ou posterior ao vencimento do derivativo.

Tela de Registro

Registro de Derivativo Contratado no Exterior			
Dados do Registro			
Data Início	Data Vencimento	Tipo de DCE	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Tipo de Mercado	Tipo de Derivativo		Meu Número
<input type="text"/>	<input type="text"/>		<input type="text"/>
Nº Controle Interno			
<input type="text"/>			
Dados da Parte			
Conta Registradora	Conta (Parte)	Código (Parte)	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
CPF/CNPJ (Parte)	Nome/Razão Social (Parte)		
<input type="text"/>	<input type="text"/>		
Características do Contrato			
Valor Base	Quantidade	Multiplicador	Funcionalidade
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Tipo/Classe Ativo Subjacente (Parte)	Filtro de Ativos	Ativo Subjacente (Parte)	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
Moeda Cotada	Moeda de Liquidação	Entrega Física	Garantias
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Liquidação em CCP	Código ISIN		
<input type="text"/>	<input type="text"/>		
Dados Complementares			
<input type="text"/>			
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Descrição dos campos da Tela de Registro

Campo	Descrição
Dados do Registro - Campos de preenchimento obrigatório.	
Data Início	Data inicial do contrato. Deve ser maior ou igual a 01/01/2000. Pode ser preenchido com qualquer data, independentemente se a data for dia útil ou não, e pode ser anterior ou posterior a data de registro.
Data Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório, exceto para Tipo de Derivativo "Contrato de CFD". Data de vencimento do contrato. Pode ser preenchida com qualquer data, independentemente se a data for dia útil ou não, e só pode ser após a data de início e posterior a data de registro.
Tipo de DCE	Caixa de seleção com as opções: Res. 3824 e Res. 3312.

Campo	Descrição
Tipo de Mercado	Caixa de seleção com as opções: Bolsa e Balcão. Referente à natureza do contrato. Ainda um contrato que originalmente seja de balcão e seja registrado em um ambiente de bolsa , o tipo de mercado deverá ser balcão (caso seja necessário, a bolsa pode ser informada no campo Dados Complementares).
Tipo de Derivativo	Caixa de seleção com as opções: Contrato de CDS, Contrato de CFD, Contrato de Nota Estruturada, Contrato de Swap, Contrato de Swaption, Contrato de Termo, Contrato Futuro e Opções.
Nº Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório.
Meu Número	Número de identificação do lançamento.
Dados da Parte	
Conta Registradora	Campo de preenchimento obrigatório. Código que identifica a instituição que está registrando o contrato. Preencher com a conta própria da Instituição Financeira ou Instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central.
Conta (Parte)	Campo de preenchimento obrigatório. Código que identifica o Participante, parte no contrato. Podem figurar como Participante (Parte), todas as contas próprias, cliente 1 e 2 integrantes do serviço de digitação do Registrador.
Código (Parte)	Campo de preenchimento obrigatório, se a Conta Registradora for diferente da Conta (parte) e se o campo CNPJ (Parte) não for preenchido. Se o campo for preenchido, não é necessário o preenchimento das demais informações da Parte. Código numérico, com até seis posições, de controle interno do Registrador, para identificar o participante na operação. Observação: Para registrar outro contrato com o mesmo Código (Parte) informado, o campo Nome/Razão Social deve ter o mesmo nome cadastrado para o Código (Parte) registrado anteriormente.
CPF/CNPJ (Parte)	Campo de preenchimento obrigatório, se a Conta Registradora for diferente da Conta (Parte) e se o Código (Parte) não for preenchido. Código CPF/CNPJ do Participante (Parte) no contrato. O módulo verifica se o CPF/CNPJ está cadastrado como Cliente do Participante.
Nome/Razão Social (Parte)	Campo de preenchimento obrigatório, se a Conta Registradora for diferente da Conta (Parte), se o campo CPF/CNPJ (Parte) não for preenchido e se o Código (Parte) não estiver cadastrado. Nome/Razão Social do Participante (Parte).

Características do Contrato

Valor Base	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o Valor Base do contrato de derivativos. Formato: 11 inteiros e 2 decimais.</p> <p>O Valor Base deverá ser formado através da seguinte equação para cada ativo:</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Strike</i></p> <p>Opção</p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Taxa a Termo –</i> <i>Termo</i></p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Preço do Ativo – Sw</i></p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Preço do Ativo – Sw_e</i></p> <p><i>Valor Base = Quantidade x PU – Nota Estruturada</i></p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> – Futuro</p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> – CFD</p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> – CDS</p> <p>Observação: caso o “Preço do Ativo” seja cotado em centavos, informar o Valor Base convertido na unidade inteira da respectiva moeda.</p>
Quantidade	Campo de preenchimento obrigatório, para Tipo de Mercado “Bolsa” e opcional para “Balcão”.
Multiplicador	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
Funcionalidade	Campo de preenchimento obrigatório.
Tipo/Classe Ativo Subjacente (Parte)	Campo de preenchimento obrigatório, exceto para Tipo de Derivativo “Contrato de CDS”.
Ativo Subjacente (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, exceto para Tipo de Derivativo “Contrato de CDS”.</p> <p>Observação: Caso o “Tipo/Classe Ativo Subjacente (Parte)” = Taxa de Câmbio, deve ser informada a moeda base.</p>
Moeda Cotada	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Deve ser informada a moeda em que o ativo subjacente é cotado.</p>

Moeda de Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a moeda em que ocorrerá a liquidação do contrato, podendo esta ser diferente da Moeda Cotada.</p> <p>Deve ser informada a moeda em que o contrato derivativo será liquidado.</p>
Entrega Física	Caixa de seleção com as opções: Sim e Não.
Garantias	Caixa de seleção com as opções: Sim e Não.
Liquidação em CCP	Caixa de seleção com as opções: Sim e Não.
Código ISIN	
Dados Complementares	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Inclusão de informações adicionais do contrato que não são contempladas nos campos de registro e o Registrador deseje acrescentar.</p>

Caso o Tipo de Mercado for Bolsa.

Tela dos Dados do Tipo de Mercado - Bolsa

Dados do Tipo de Mercado - Bolsa	
Bolsa Negociada	País de Origem da Bolsa Negociada
<input type="text"/>	<input type="text"/>
Mês de Referência	Ano de Referência
<input type="text"/>	<input type="text"/>

Descrição dos campos da Tela dos Dados do Tipo de Mercado - Bolsa

Campo	Descrição
Bolsa Negociada	Campo de preenchimento obrigatório.
País de Origem da Bolsa Negociada	Campo de preenchimento obrigatório.
Mês de Referência	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caso este campo não seja aplicável para o contrato, deverá ser selecionado "NA".</p>
Ano de Referência	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caso este campo não seja aplicável para o contrato, deverá ser selecionado "NA".</p>

Caso o Tipo de Mercado for Balcão.

Tela dos Dados do Tipo de Mercado - Balcão

Dados do Tipo de Mercado - Balcão		
Contraparte Identificada	Código(Contraparte)	CPF/CNPJ (Contraparte)
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Nome/Razão Social (Contraparte)	País de Origem (Contraparte)	Contraparte Coligada
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Descrição dos campos da Tela dos Dados do Tipo de Mercado - Balcão

Campo	Descrição
Contraparte Identificada	Campo de preenchimento obrigatório.
Código (Contraparte)	Campo de preenchimento obrigatório, se a contraparte for identificada e se CPF/CNPJ (Contraparte) não for preenchido. Se o campo for preenchido, não é necessário o preenchimento das demais informações da Contraparte.
CPF/CNPJ (Contraparte)	Campo de preenchimento obrigatório, se a contraparte for identificada e se Código (Contraparte) não for preenchido.
Nome/Razão Social (Contraparte)	Campo de preenchimento obrigatório, se a contraparte for identificada, se CPF/CNPJ (Contraparte) não for preenchido e se Código (Contraparte) não estiver cadastrado.
País de Origem (Contraparte)	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
Contraparte Coligada	Campo de preenchimento obrigatório, se a contraparte for identificada.

Caso o Tipo de Derivativo for Contrato de CDS.**Tela dos Dados do Derivativo - CDS**

Dados do Derivativo - CDS

Posição da Parte <input style="width: 90%;" type="text"/>	Tipo de Origem <input style="width: 90%;" type="text"/>	Origem <input style="width: 90%;" type="text"/>
--	--	--

Descrição dos campos da Tela dos Dados do Derivativo - CDS

Campo	Descrição
Posição da Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Comprador de Proteção e Vendedor de Proteção.
Tipo de Origem	Campo de preenchimento obrigatório Caixa de seleção com as opções: Dívida Corporate e Dívida Soberana.
Origem	Campo de preenchimento obrigatório

Caso o Tipo de Derivativo for Contrato de CFD**Tela dos Dados do Derivativo - CFD**

Dados do Derivativo - CFD

Posição da Parte <input style="width: 90%;" type="text"/>

Descrição do campo da Tela dos Dados do Derivativo - CFD

Campo	Descrição
Posição da Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.

Caso o Tipo de Derivativo for Contrato de Nota Estruturada**Tela dos Dados do Derivativo - Nota Estruturada**

Dados do Derivativo - Nota Estruturada

Posição da Parte

Descrição do campo da Tela dos Dados do Derivativo - Nota Estruturada

Campo	Descrição
Posição da Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.

Caso o Tipo de Derivativo for Contrato de Swap**Tela dos Dados do Derivativo - Swap**

Dados do Derivativo - Swap

Tipo/Classe Ativo Subjacente (Contraparte) Filtro de Ativos Ativo Subjacente (Contraparte)

Tipo de Swap Swap Asiático Número de Fluxos

Descrição do campo da Tela dos Dados do Derivativo - Swap

Campo	Descrição
Tipo/Classe Ativo Subjacente (Contraparte):	Campo de preenchimento obrigatório.
Ativo Subjacente (Contraparte):	Campo de preenchimento obrigatório.
Tipo de Swap	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Fluxo de Caixa e Pagamento Final.
Swap Asiático	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa de seleção com as opções: Sim e Não.
Número de Fluxos	Campo de preenchimento obrigatório, se Tipo de Swap for Fluxo de Caixa.

Caso o Tipo de Derivativo for Contrato de Swaption**Tela dos Dados do Derivativo - Swaption**

Dados do Derivativo - Swaption	
Posição da Parte	<input type="text"/>

Descrição do campo da Tela dos Dados do Derivativo - Swaption

Campo	Descrição
Posição da Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.

Caso o Tipo de Derivativo for Contrato de Termo**Tela dos Dados do Derivativo - Termo**

Dados do Derivativo - Termo		
Posição da Parte	Termo Asiático	Preço
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/> , <input type="text"/>

Descrição do campo da Tela dos Dados do Derivativo – Termo

Campo	Descrição
Posição da Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.
Termo Asiático	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Sim e Não.
Preço	Campo de preenchimento obrigatório. É a taxa a termo do contrato, informada na mesma moeda preenchida no campo “Moeda Cotada”.

Caso o Tipo de Derivativo for Contrato Futuro**Tela dos Dados do Derivativo - Futuro**

Dados do Derivativo - Futuro	
Posição da Parte	Preço
<input type="text"/>	<input type="text"/> , <input type="text"/>

Descrição do campo da Tela dos Dados do Derivativo – Futuro

Campo	Descrição
Posição da Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Comprador e Vendedor.
Preço	Campo de preenchimento obrigatório.

Caso o Tipo de Derivativo for Opções**Tela dos Dados do Derivativo - Opção**

Dados do Derivativo - Opção		
Posição da Parte <input type="text"/>	Tipo de Opção <input type="text"/>	Tipo de Verificação <input type="text"/>
Strike <input type="text"/> , <input type="text"/>		Opção Asiática <input type="text"/>

Descrição do campo da Tela dos Dados do Derivativo – Opção

Campo	Descrição
Posição da Parte	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Titular e Lançador.
Tipo de Opção	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Compra e Venda.
Tipo de Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Americana, Europeia e Bermudean.
Strike	Campo de preenchimento obrigatório.
Opção Asiática	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Sim e Não.

4 CONSULTA**4.1 Consulta de Registro de Derivativos**

Menu Derivativos Realizados no Exterior > Consultas > Consulta de Registro de Derivativo

Visão Geral

Esta função permite **consultar** as características dos contratos registrados e se necessário, efetuar a **alteração** e **exclusão** dos mesmos.

Para realizar a consulta, o Participante deve informar os campos **Tipo IF** e outro campo de filtro.

Clique no botão **Confirmar**. Em seguida o módulo apresenta Tela de Relação com o(s) resultado(s) obtido(s).

Tela Consulta de Registro

Filtro de Consulta de Registro

Tipo IF

Parte (Conta)

CPF/CNPJ Cliente Parte

CADEMP Cliente Parte

Código(Parte)

Contraparte (Conta)

CPF/CNPJ Cliente Contraparte

CADEMP Cliente Contraparte

Código(ContraParte)

Conta Registradora

Tipo de Derivativo

Código IF

Data de Registro -

Data de Vencimento -

Tipo de DCE

Descrição dos campos da Tela Consulta de Registro

Campo	Descrição
Os campos Tipo IF, Parte (Conta) ou Contraparte (Conta), são de preenchimento obrigatório.	
Tipo IF	Caixa de seleção com as opções: DCE e DVE
Parte (Conta)	Código que identifica o Participante que está registrando o contrato.
CPF/CNPJ Cliente Parte	Identificação do Cliente do Participante.
CADEMP Cliente Parte	Número do CADEMP do Cliente Parte no contrato de DVE .
Código (Parte)	Código numérico de controle interno do Registrador que identifica a Parte na operação.
Contraparte (Conta)	Código que identifica o membro com quem foi efetuado o contrato.
CPF/CNPJ Cliente Contraparte	Identificação do Cliente do Participante.
CADEMP Cliente Contraparte	Número do CADEMP do Cliente Contraparte no contrato de DVE .

Campo	Descrição
Código (Contraparte)	Código numérico de controle interno do Registrador que identifica a contraparte na operação.
Conta Registradora	Informar quando tipo de registro for de contrato DCE . Código que identifica o Participante que registrou o contrato.
Tipo de Derivativo	Indicar o tipo de derivativo objeto do contrato. Caixa de seleção com as opções: Contrato Futuro, Contrato de Swap, Opções Flexíveis de Ações, Opções Flexíveis de Moedas, Opções Flexíveis de Índices, Termo de Mercadorias, Termo de Moedas, Termo de Taxa de Juros ou Derivativos de Crédito.
Código IF	Indicar o código do contrato, gerado pelo módulo a partir do seu registro.
Data de Registro	Indicar a data em que o contrato foi registrado no módulo.
Data de Vencimento	Indicar a data de vencimento do contrato.
Tipo de DCE	Caixa de seleção com as opções: "3.824" e "3.312".

Tela de Relação

Relação Consulta Registro DVE

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)
Data e Hora da Consulta: 04/09/2014 - 15:21:17

Critério de pesquisa


Ação	Código IF	Tipo de Derivativo	Parte (Conta)	Papel	CPF/CNPJ Cliente Parte	CADEMP Cliente Parte	Contraparte (Conta)	Papel	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	CADEMP Cliente Contraparte	Data Início	Data Vencimento	Data de Registro	Valor Base
 DETALHAR ALTERAR EXCLUIR	DVE01300002	SWAP	10020.00-1	PARTE			10020.10-4	CONTRAPARTE	987.654.321-00		25/02/2013	25/02/2016	25/02/2013	100,00

Atualizar Voltar

« 1 Exibir página »


Obter no formato: Excel

Na caixa de seleção do campo **Ação**, o Participante tem a possibilidade de **detalhar, alterar ou excluir** determinado do contrato.

Após selecionar a opção **Detalhar** e clicar no ícone , o módulo exibe tela para consulta de informações do contrato selecionado.

Opção Detalhar

Registro de Derivativo Vinculado a Empréstimo		
DETALHAR		
Código do Instrumento Financeiro		
Código IF DVE01300002		
Dados da Parte		
Parte (Conta)	Papel	
10020.00-1	PARTE	
Dados da Contraparte		
Contraparte (Conta)	Papel	CPF/CNPJ Cliente Contraparte
10020.10-4	CONTRAPARTE	987.654.321-00
Características		
Tipo de Derivativo	Valor Base	
SWAP	100,00	
Moeda Referência	Adesão a Contrato	
RENMINBI HONG KON	CSA	
Data Início	Data Vencimento	
25/02/2013	25/02/2016	
Fator de Risco Ativo	Fator de Risco Passivo	
Commodities - Negociadas em Real	Commodities - Negociada em Outras Moedas	
Complemento Risco Ativo	Complemento Risco Passivo	
Notional Mínimo (%)	Notional Máximo (%)	
100,00	200,00	
Dados Complementares		
Dados da Operação de Empréstimo		
Tipo de Operação parte	Valor da Operação	
DIRETA: PARTE DEST. FINAL NACIONAL	100,0000000000	
Código Contrato ROF	Moeda	
teste	RENMINBI HONG KON	
Data de Início	Data de Vencimento	
25/02/2013	25/02/2015	

Após selecionar a opção **Alterar** e clicar no ícone , o módulo exibe tela para a alteração de características do contrato. Por meio desta tela podem ser alterados os seguintes campos:

Opção Alterar


Registro de Derivativo Vinculado a Empréstimo			
ALTERAÇÃO			
Código do Instrumento Financeiro			
Código IF DVE01300002			
Dados da Parte			
Parte (Conta)	Papel	CPF/CNPJ Cliente Parte	CADEMP Cliente Parte
10020.00-1	PARTE		
Meu Número			
<input type="text"/>			
Dados da Contraparte			
Contraparte (Conta)	Papel	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	CADEMP Cliente Contraparte
10020.10-4	CONTRAPARTE	987.654.321-00	
Características			
Tipo de Derivativo		Valor Base	
SWAP		100 <input type="text"/> , <input type="text"/>	
Moeda Referência		Adesão a Contrato	
RENMINBI HONG KON		CSA <input type="text"/>	
Data Inicio		Data Vencimento	
25/02/2013		25/02/2016	
Fator de Risco Ativo		Fator de Risco Passivo	
Commodities - Negociadas em Real <input type="text"/>		Commodities - Negociada em Outras Moedas <input type="text"/>	
Complemento Risco Ativo		Complemento Risco Passivo	
<input type="text"/>		<input type="text"/>	
Notional Mínimo (%)		Notional Máximo (%)	
100,00		200,00	
Dados Complementares			
<input type="text"/>			
Dados da Operação de Empréstimo			
Tipo de Operação parte		Valor da Operação	
DIRETA: PARTE DEST. FINAL NACIONAL		100,0000000000	
Código Contrato ROF		Moeda	
teste		RENMINBI HONG KON	
Data de Inicio		Data de Vencimento	
25/02/2013		25/02/2015	

Descrição dos campos da Tela de Alteração

Campo	Descrição
Meu Número	Número de identificação do lançamento.
Valor Base	<p>Indica o Valor Base do contrato de derivativos. Formato: 11 inteiros e 2 decimais.</p> <p>Deve ser informado na mesma moeda preenchida no campo “Moeda Referência”. O Valor Base deverá ser formado através da seguinte equação para cada ativo:</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Strike</i> - Opção</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Taxa a Termo</i> - Termo</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Preço do Ativo</i> - Swap</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Preço do Ativo</i> - Swaption</p> <p><i>Valor Base = Quantidade x PU</i> - Nota Estruturada</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> - Futuro</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> - CDF</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> - CDS</p> <p>Observação: caso o “Preço do Ativo” seja cotado em centavos, informar o Valor Base convertido na unidade inteira da respectiva moeda.</p>
Adesão a Contrato	<p>Indica a existência de adesão a contratos padronizados.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: CGD, CGD/CSA, CSA, ISDA e Nenhum.</p>
Nº Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório.

Campo	Descrição
Fator de Risco Ativo	Indica em qual Fator de Risco o Tomador final da operação de empréstimo está ativo. Caixa de seleção com as opções: Taxa de Juros - Pré; Taxa de Juros - Flutuante; Índice – Índice Nacional; Índice - Índice DI; Índice – Índice Internacional; Variação Cambial - Dólar Americano; Variação Cambial - EURO; Variação Cambial - IENE; Variação Cambial - Libra; Variação Cambial - Outras Moedas; Commodities – Negociadas em Real; Commodities – Negociadas em Outras Moedas e Nenhum.
Fator de Risco Passivo	Indica em qual Fator de Risco o Tomador final da operação de empréstimo está passivo. Caixa de seleção com as opções: Taxa de Juros - Pré; Taxa de Juros - Flutuante; Índice – Índice Nacional; Índice - Índice DI; Índice – Índice Internacional; Variação Cambial - Dólar Americano; Variação Cambial - EURO; Variação Cambial - IENE; Variação Cambial - Libra; Variação Cambial - Outras Moedas; Commodities – Negociadas em Real; Commodities – Negociadas em Outras Moedas e Nenhum.
Complemento Risco Ativo	Campo para descrição de informações adicionais referentes ao Fator de Risco Ativo.
Complemento Risco Passivo	Campo para descrição de informações adicionais referentes ao Fator de Risco Passivo.
Dados Complementares	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Neste campo o Participante pode descrever dados adicionais relativos ao contrato de derivativo está sendo cadastrado.

Clique em **Enviar** para exibir a tela de confirmação. O módulo permite que as Partes realizem alterações no contrato, a qualquer momento, no período compreendido entre a data de registro, até D-1 da data do vencimento do contrato.

Após selecionar a opção **Excluir** e clicar no ícone , o módulo exibe tela para exclusão do contrato selecionado.

Opção Excluir

Registro de Derivativo Vinculado a Empréstimo			
EXCLUSÃO			
Código do Instrumento Financeiro			
Código IF DVE01300002			
Dados da Parte			
Parte (Conta)	Papel	CPF/CNPJ Cliente Parte	CADEMP Cliente Parte
10020.00-1	PARTE		
Meu Número			
<input type="text"/>			
Dados da Contraparte			
Contraparte (Conta)	Papel	CPF/CNPJ Cliente Contraparte	CADEMP Cliente Contraparte
10020.10-4	CONTRAPARTE	987.654.321-00	
Motivo			
<input type="text"/>			
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

É obrigatório o preenchimento dos campos **Meu Número** e **Motivo**. Após clicar em **Enviar** é apresentada Tela de Confirmação.

A **exclusão** é permitida no período compreendido entre a data de registro, até D-1 da data do vencimento do contrato.

4.2 Consulta de Derivativos Contratados no Exterior

Menu Derivativos Realizados no Exterior > Consultas > Consulta de Derivativos Contratados no Exterior

Visão Geral

Esta função permite **consultar** as características dos Derivativos contratados no exterior e se necessário, efetuar a **atualização**, **alteração** ou **exclusão** dos mesmos.

Tela Filtro Registro DCE

Filtro Registro DCE	
Conta Registradora	<input type="text"/>
Conta (Parte)	<input type="text"/>
CPF/CNPJ (Parte)	<input type="text"/>
Código (Parte)	<input type="text"/>
Nome/Razão Social (Parte)	<input type="text"/>
Código do Instrumento Financeiro	<input type="text"/>
Data de Registro	<input type="text"/> - <input type="text"/>
Data de Vencimento	<input type="text"/> - <input type="text"/>
Tipo de Derivativo	<input type="text"/>
Tipo de DCE	Resolução 3.312 <input type="text"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Para realizar a consulta, o Participante deve informar pelo menos um campo de filtro.

Clique no botão **Pesquisar**. Em seguida o módulo apresenta Tela de Relação com o(s) resultado(s) obtido(s).


Consulta de Registro de DCE									
Página 1 de 444 (Linhas 1 a 30 de 13312)									
Data e Hora da Consulta: 11/03/2014 - 18:17:11									
 Critério de pesquisa									
Ação	Código do Instrumento Financeiro	Tipo de Derivativo	Conta (Parte)	Posição da Parte	CPF/CNPJ (Parte)	Código (Parte)	ContraParte (Conta)	Posição da Contraparte	CPF/CNPJ (Contraparte)
DETALHAR ▾ 	DCE01400ZWX	SWAP	05051.10-2	PARTE		759999	05051.10-2	CONTRAPARTE	
DETALHAR ▾ 	DCE01400Z96	CDS	73410.10-8	COMPRADOR		123	73410.10-8	VENDEDOR	
DETALHAR ▾ 	DCE014013RT	O	10020.10-4	TITULAR		92075	10020.10-4	LANÇADOR	
DETALHAR ▾ 	DCE014013RS	O	10020.10-4	TITULAR		92067	10020.10-4	LANÇADOR	

(continua)

Código (Contraparte)	Data Início	Data Vencimento	Data de Registro	Valor Base	Conta Registradora	Tipo de DCE	Nº Controle Interno	Nº Instrumento Financeiro
	11/03/2014	21/12/2015	11/03/2014	58.303.813,00	05051.00-9	Resolução 3.312	12345	13561344
	10/03/2014	28/03/2014	10/03/2014	15.000,00	73410.00-5	Resolução 3.312	882852	13559854
	11/03/2014	12/03/2014	11/03/2014	2.500.000,00	10020.00-1	Resolução 3.312	COINP-13945684092075	13566440
	11/03/2014	12/03/2014	11/03/2014	2.500.000,00	10020.00-1	Resolução 3.312	COINP-13945684092067	13566439

(fim)

Ação Detalhar

Após selecionar “DETALHAR” e apertar o botão , serão exibidas as informações do respectivo contrato de DCE.


Registro de Derivativos Contratados no Exterior	
Dados do Registro	
Data de Registro	11/03/2014
Data Início	11/03/2014
Código IF	DCE01400ZWX
Nº Controle Interno	12345
Tipo de DCE	Resolução 3.312
Tipo de Mercado	Balcão
Tipo de Derivativo	Contrato de Swap
Data Vencimento	21/12/2015
Dados da Parte	
Conta Registradora	05051.00-9
Conta (Parte)	05051.10-2
Código (Parte)	759999
CPF/CNPJ (Parte)	
Nome/Razão Social (Parte)	CREDIT SUISSE BRAZIL (BAHAMAS) LTD
Características do Contrato	
Valor Base	58.303.813,00000
Quantidade	1,0000
Multiplicador	
Tipo/Classe Ativo Subjacente(Parte)	JUROS
Ativo Subjacente(Parte)	PRÉ
Funcionalidade	N.A.
Moeda Cotada	DOLAR DOS EUA
Moeda Liquidação	DOLAR DOS EUA
Entrega Física	NÃO
Garantias	NÃO
Liquidação em CCP	NÃO
Código ISIN	
Dados Complementares	

(continua)

Balcão	
	Contraparte Identificada NÃO
	Código(Contraparte)
	CPF/CNPJ (Contraparte)
	Nome/Razão Social (Contraparte)
	País de Origem
	Contraparte Coligada
SWAP	
	Tipo/Classe Ativo Subjacente (Contraparte) JUROS
	Ativo Subjacente (Contraparte) LIBOR-DOLAR
	Tipo de Swap FLUXO DE CAIXA
	Número de Fluxos 58
	Swap Asiático NÃO
<input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Sair"/>	

(fim)

Ação Atualizar

Após selecionar “ATUALIZAR” e apertar o botão , deverão ser preenchidos os seguintes campos:

Atualizar Contrato DCE		
Data de Atualização	Motivo Atualização	Meu Número
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Conta (Parte)	Código (Parte)	Nome/Razão Social (Parte)
<input type="text"/> 73410 <input type="text"/> 10 <input type="text"/> 8	<input type="text"/> 123	<input type="text"/> MNMNMMN
Código(Contraparte)	CPF/CNPJ (Parte)	Papel
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/> COMPRADOR <input type="button" value="v"/>
País de Origem (Contraparte)	Nome/Razão Social (Contraparte)	CPF/CNPJ (Contraparte)
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Valor Base	Quantidade	Contraparte Coligada
<input type="text"/> 15000 <input type="text"/>	<input type="text"/> 1000 <input type="text"/>	<input type="text"/>
Preço		<input type="text"/>
		<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 Atualizar Contrato DCE

Campo	Descrição
Data de Atualização	Campo de preenchimento obrigatório.
Motivo Atualização	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Amortização, Antecipação, Troca de Posição e Cessão.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório.
Conta (Parte):	Campo de preenchimento obrigatório, se Motivo for Cessão e se o DCE for de Balcão.
Código (Parte)	Campo de preenchimento obrigatório, se Motivo for Cessão, se o DCE for de Balcão e se CPF/CNPJ (Parte) não estiver preenchido.

Campo	Descrição
Nome/Razão Social (Parte)	Campo de preenchimento obrigatório, se Motivo for Cessão, se o DCE for de Balcão, se CPF/CNPJ (Parte) não estiver preenchido e se Código (Parte) não estiver cadastrado.
CPF/CNPJ (Parte)	Campo de preenchimento obrigatório, se Motivo for Cessão, se o DCE for de Balcão e se Código (Parte) não estiver cadastrado.
Papel	Campo de preenchimento obrigatório, se Motivo for Troca de Posição e se Tipo de Derivativo for Futuro, CFD ou Opção, caso contrário não deve ser preenchido.
Código (Contraparte)	Campo de preenchimento obrigatório, se Motivo for Cessão, se o DCE for de Balcão e se CPF/CNPJ (Parte) não estiver preenchido.
Nome/Razão Social (Contraparte)	Campo de preenchimento obrigatório, se Motivo for Cessão, se o DCE for de Balcão, se CPF/CNPJ (Parte) não estiver preenchido e se Código (Parte) não estiver cadastrado.
CPF/CNPJ (Contraparte)	Campo de preenchimento obrigatório, se Motivo for Cessão, se o DCE for de Balcão e se Código (Parte) não estiver cadastrado.
País de Origem (Contraparte)	Campo de preenchimento obrigatório, se Motivo for Cessão e se o DCE for de Balcão.
Contraparte Coligada	Campo de preenchimento obrigatório, se Motivo for Cessão e se o DCE for de Balcão.

Campo	Descrição
Valor Base	<p>Campo de preenchimento obrigatório, exceto se Motivo for Cessão.</p> <p>Indica o Valor Base do contrato de derivativos. Formato: 11 inteiros e 2 decimais.</p> <p>Deve ser informado na mesma moeda preenchida no campo “Moeda Referência”. O Valor Base deverá ser formado através da seguinte equação para cada ativo:</p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Strike</i> - Opção</p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Taxa a Termo</i> _ Termo</p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Preço do Ativo</i> _ Swap</p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Preço do Ativo</i> _ Swaption</p> <p><i>Valor Base = Quantidade x PU</i> - Nota Estruturada</p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> - Futuro</p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> - CDF</p> <p><i>Valor Base =</i> <i>Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> - CDS</p> <p>Observação: caso o “Preço do Ativo” seja cotado em centavos, informar o Valor Base convertido na unidade inteira da respectiva moeda.</p>
Quantidade	Campo de preenchimento obrigatório, exceto se Motivo for Cessão.
Preço	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.

Ação Alterar

Após selecionar “ALTERAR” e apertar o botão , poderão ser alterados todos os seguintes campos, conforme exemplo abaixo:

Alteração de Registro de Derivativo Contratado no Exterior			
Dados do Registro			
Data Início	Data Vencimento	Tipo de DCE	
28 / 2 / 2014		Resolução 3.312	
Tipo de Mercado		Tipo de Derivativo	
Bolsa		Contrato de CFD	
Nº Controle Interno		Meu Número	
24841219625170900000			
Dados da Parte			
Conta Registradora	Conta (Parte)	Código (Parte)	
05000 00 5	05000 00 5		
CPF/CNPJ (Parte)		Nome/Razão Social (Parte)	
Características do Contrato			
Valor Base	Quantidade	Multiplicador	Funcionalidade
1000 ,	1000 ,	1 ,	N.A.
Tipo/Classe Ativo Subjacente (Parte)		Filtro de Ativos	Ativo Subjacente (Parte)
AÇÕES			NUE US
Moeda Cotada	Moeda de Liquidação	Entrega Física	Garantias
AFEGANE/AFEGANIST	AFEGANE/AFEGANIST	NÃO	NÃO
Liquidação em CCP			Código ISIN
NÃO			
Dados Complementares			
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Descrição dos campos da Tela Alteração de Registro de Derivativo Contratado no Exterior

Campo	Descrição
Dados do Registro	
Data Início	Campo de preenchimento obrigatório.
Data Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório, exceto para Tipo de Derivativo Contrato de CFD.
Tipo de DCE	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Res. 3824 e Res. 3312.
Tipo de Mercado	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Bolsa e Balcão.
Tipo de Derivativo	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Contrato de CDS, Contrato de CFD, Contrato de Nota Estruturada, Contrato de Swap, Contrato de Swaption, Contrato de Termo, Contrato Futuro e Opções.
Nº Controle Interno	Campo de preenchimento obrigatório.
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório.
Dados da Parte	

Campo	Descrição
Conta Registradora	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código que identifica a instituição que está registrando o contrato.</p> <p>Preencher com a conta própria da Instituição Financeira ou Instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central.</p>
Conta (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Código que identifica o Participante, parte no contrato.</p> <p>Podem figurar como Participante (Parte), todas as contas próprias, cliente 1 e 2 integrantes do serviço de digitação do Registrador.</p>
Código (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se a Conta Registradora for diferente da Conta (parte) e se o campo CNPJ (Parte) não for preenchido.</p> <p>Observação: Para registrar outro contrato com o mesmo Código (Parte) informado, o campo Nome/Razão Social deve ter o mesmo nome cadastrado para o Código (Parte) registrado anteriormente.</p>
CPF/CNPJ (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se a Conta Registradora for diferente da Conta (Parte) e se o Código (Parte) não for preenchido.</p> <p>Código CPF/CNPJ do Participante (Parte) no contrato.</p> <p>O módulo verifica se o CPF/CNPJ está cadastrado como Cliente do Participante.</p>
Nome/Razão Social (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se a Conta Registradora for diferente da Conta (Parte), se o campo CPF/CNPJ (Parte) não for preenchido e se o Código (Parte) não estiver cadastrado.</p> <p>Nome/Razão Social do Participante (Parte).</p>


Características do Contrato

Campo	Descrição
Valor Base	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o Valor Base do contrato de derivativos. Formato: 11 inteiros e 2 decimais.</p> <p>Deve ser informado na mesma moeda preenchida no campo “Moeda Referência”. O Valor Base deverá ser formado através da seguinte equação para cada ativo:</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Strike</i> - Opção</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Taxa a Termo</i> - Termo</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Preço do Ativo</i> - Swap</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Ativos x Tamanho do Contrato x Preço do Ativo</i> - Swaption</p> <p><i>Valor Base = Quantidade x PU</i> - Nota Estruturada</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> - Futuro</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> - CDF</p> <p><i>Valor Base = Quantidade de Contratos x Tamanho do contrato x Preço do ativo</i> - CDS</p> <p>Observação: caso o “Preço do Ativo” seja cotado em centavos, informar o Valor Base convertido na unidade inteira da respectiva moeda.</p>
Quantidade	Campo de preenchimento obrigatório, para Tipo de Mercado Bolsa e opcional para Balcão.
Multiplicador	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.
Funcionalidade	Campo de preenchimento obrigatório.
Tipo/Classe Ativo Subjacente (Parte)	Campo de preenchimento obrigatório, exceto para Tipo de Derivativo “Contrato de CDS”
Ativo Subjacente (Parte)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, exceto para Tipo de Derivativo “Contrato de CDS”.</p> <p>Observação: Caso o “Tipo/Classe Ativo Subjacente (Parte)” = Taxa de Câmbio, deve ser informada a moeda base.</p>

Campo	Descrição
Moeda Cotada	Campo de preenchimento obrigatório. Deve ser informada a moeda em que o ativo subjacente é cotado.
Moeda de Liquidação:	Campo de preenchimento obrigatório. Deve ser informada a moeda em que o contrato derivativo será liquidado.
Entrega Física	Caixa de seleção com as opções: Sim e Não.
Garantias	Caixa de seleção com as opções: Sim e Não.
Liquidação em CCP	Caixa de seleção com as opções: Sim e Não.
Código ISIN	
Dados Complementares	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Inclusão de informações adicionais do contrato que o Registrador deseje acrescentar.

As telas e campos específicos dos tipos de Mercado e Derivativo são os mesmos do Registro de Derivativo Contratado no Exterior.

Ação Excluir

Após selecionar “EXCLUIR” e apertar o botão , deverão ser preenchidos os seguintes campos:

Descrição dos campos da Tela Exclusão de Registro de Derivativo Contratado no Exterior

Campo	Descrição
Meu Número	Campo de preenchimento obrigatório.
Motivo	Campo de preenchimento obrigatório.

4.3 Histórico de Alteração/Atualização de Contrato (DCE)

Menu Derivativos Realizados no Exterior > Consultas > Histórico de Alteração/Atualização de Contrato (DCE)

Visão Geral

Esta função permite **consultar** os históricos de Alteração/Atualização dos contratados no exterior (DCE).

Para realizar a consulta, o Participante deve informar pelo menos um campo de filtro.

Tela Filtro de Consulta de Histórico de Alterações

Filtro de Consulta de Histórico de Alterações

Conta Registradora --

Conta (Parte) --

CPF/CNPJ (Parte)

Código (Parte)

Nome/Razão Social (Parte)

Código do Instrumento Financeiro

Data de Atualização --

Tipo de Derivativo

Tipo de DCE Resolução 3.824

Clique no botão **Pesquisar**. Em seguida o módulo apresenta Tela de Relação com o(s) resultado(s) obtido(s).

Visualizar Histórico de Atualizações

Página 1 de 138 (Linhas 1 a 30 de 4125)

Data e Hora da Consulta: 12/03/2014 - 11:43:07




Ação	Código do Instrumento Financeiro	Tipo de Derivativo	Conta (Parte)	Papel	CPF/CNPJ (Parte)	Código (Parte)	ContraParte (Conta)	Posição da Contraparte	CPF/CNPJ (Contraparte)
DETALHAR	DCE014003AR	CDS	05000.10-8			123	05000.10-8		
DETALHAR	DCE01400AUH	CFUT	05000.10-8			310387	05000.10-8		
DETALHAR	DCE01400AUH	CNTE	05000.10-8			310387	05000.10-8		
DETALHAR	DCE01400AUJ	CFUT	05000.10-8			310387	05000.10-8		
DETALHAR	DCE01400AUJ	CNTE	05000.10-8			310387	05000.10-8		
DETALHAR	DCE01400AUL	CFUT	05000.10-8			310387	05000.10-8		

(continua)

Código (Contraparte)	Data Início	Data Vencimento	Data de Registro	Valor Base	Conta Registradora	Tipo de DCE	Nº Controle Interno	Nº Instrumento Financeiro
	27/02/2014	27/03/2014	27/02/2014	50,00	05000.00-5		443	13496909
	05/03/2014	07/03/2014	05/03/2014	1.000,00	05000.00-5		59947369791762300000	13514929
1234	05/03/2014	07/03/2014	05/03/2014	1.000,00	05000.00-5		17745818116001900000	13509853
	05/03/2014	07/03/2014	05/03/2014	1.000,00	05000.00-5		72442997751254400000	13514924
1234	05/03/2014	07/03/2014	05/03/2014	1.000,00	05000.00-5		80261478192660000000	13509855
	05/03/2014	07/03/2014	05/03/2014	1.000,00	05000.00-5		85393916627789400000	13514917

(fim)

Após selecionar “DETALHAR” e apertar o botão , serão exibidas as informações da alteração/atualização do respectivo contrato de DCE.

Registro de Derivativos Contratados no Exterior	
Dados do Registro	
Data de Registro	27/02/2014
Data Início	27/02/2014
Código IF	DCE014003AR
Nº Controle Interno	443
Tipo de DCE	Resolução 3.824
Tipo de Mercado	Bolsa
Tipo de Derivativo	Contrato de CDS
Data Vencimento	27/03/2014
Dados da Parte	
Conta Registradora	05000.00-5
Conta (Parte)	05000.10-8
Código (Parte)	123
CPF/CNPJ (Parte)	
Nome/Razão Social (Parte)	A
Características do Contrato	
Valor Base	50,00000
Quantidade	10,0000
Multiplicador	5,00
Tipo/Classe Ativo Subjacente(Parte)	COMMODITIES
Ativo Subjacente(Parte)	OLEO DE SOJA
Funcionalidade	KNOCK IN
Moeda Cotada	DALASI/GAMBIA
Moeda Liquidação	REAL
Entrega Física	SIM
Garantias	SIM
Liquidação em CCP	SIM
Código ISIN	
Dados Complementares	inclusao:bolsa cds

(continua)

Bolsa	
Bolsa Negociada	NATIONAL STOCK EXCHANGE OF INDIA (NSE)
País de Origem	BERMUDAS
Mês de Referência	FEVEREIRO
Ano de Referência	2015

Dados do Derivativo - CDS	
Posição da Parte	Comprador de Proteção
Tipo de Origem	DIVIDA CORPORATE
Origem	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG

(fim)

5 ADMINISTRAÇÃO

5.1 Manutenção de Contas de Clientes (DCE)

Menu Derivativos Realizados no Exterior > Administração > Manutenção de Contas (DCE)

Visão Geral

Função exclusiva para Contratos de DCE registrados após 17/03/2014.

Esta função possibilita que os Participantes cadastrem, alterem ou excluam os códigos de Clientes do DCE que participam do registro do contrato e que não possuam CPF/CNPJ cadastrado no **SIC - Módulo de Identificação de Comitentes**.

Tela filtro da Função de Manutenção de Contas (DCE)

Manutenção de Contas	
Conta Registradora	<input type="text"/> <input type="text"/> <input type="text"/>
Nome Simplificado	<input type="text"/>
Nome/Razão Social	<input type="text"/>
Código	<input type="text"/>
Ação	CONSULTAR <input type="button" value="v"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela de Manutenção de Contas (DCE)

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório	
Conta Registradora	Conta própria do Participante Registrador
Nome Simplificado	Nome Simplificado do Participante Registrador
Nome/Razão Social	Nome/Razão Social do cliente
Código	Código atribuído ao Nome/Razão Social do cliente


Campo	Descrição
Ação	Operação que o participante deseja realizar com o código selecionado

Após inserir os dados e clicar no botão **Confirmar**, o módulo apresenta tela para informação dos dados do(s) Cliente(s).

Tela Dados da Função Manutenção de Contas (DCE)

Ação	Conta Registradora	Nome Simplificado	Nome/Razão Social	Código
ALTERAR 				45322
ALTERAR 				41546
ALTERAR 				99
ALTERAR 				168461
ALTERAR 				80708
ALTERAR 				10
ALTERAR 				190313

Opção Alterar

Após selecionar a opção **Alterar** e clicar no ícone , o módulo exibe tela **Manutenção de Contas (Alteração)** com os campos editáveis, para que o Participante realize a operação.

Tela de alteração da Função Manutenção de Contas (DCE)

Manutenção de Contas (Alteração)

Nome/Razão Social

Código

Descrição dos campos de alteração da Tela de Manutenção de Contas (DCE)

Campo	Descrição
Nome/Razão Social	Nome/Razão Social do cliente.
Código	Código atribuído ao Nome/Razão Social


Após a indicação das informações a serem alteradas, o Participante deverá clicar no botão **Enviar**, e a função irá apresentar a tela de conferência da alteração. A função permite a alteração do Nome/Razão Social e/ou do Código atribuído ao cliente. As alterações realizadas na conta do cliente irão impactar o estoque de contratos registrados com os dados anteriores.

Tela de confirmação de alteração da Função Manutenção de Contas (DCE)

Manutenção de Contas (Alteração)	
Anterior	Atual
Nome/Razão Social Código Atual	Nome/Razão Social Código

Após a confirmação das informações a serem alteradas, o Participante deverá clicar no botão **Confirmar**, e o sistema irá apresentar a mensagem de que a operação foi finalizada.

Opção Exclusão

Após selecionar a opção **Exclusão** e clicar no ícone , o módulo exibe tela **Manutenção de Contas (Exclusão)** com os campos editáveis, para que o Participante realize a operação.

Tela de confirmação de exclusão da Função Manutenção de Contas (DCE)

Manutenção de Contas (Exclusão)
Nome/Razão Social Código Conta Registradora 66661.00-5

Após a confirmação das informações a serem alteradas, o Participante deverá clicar no botão **Confirmar**, e o sistema irá apresentar a mensagem de que a operação foi finalizada.

6 INFORMAÇÕES ADICIONAIS**6.1 Lista de Ativos**

Para consultar os ativos disponíveis para registro, favor acessar o arquivo AAAAMMDD_Dominios_DCE.txt localizado no sistema NoMe no menu Transferência de Arquivo > Arquivo > Arquivos Públicos.

6.2 Formação dos Códigos dos Instrumentos Financeiros**Para Registro de Derivativo Vinculado**

Exemplo:TTTTAASSSS

Onde:

TTTT = identifica o Tipo do Ativo. Quando o tipo em questão não alcançar as 4(quatro) posições previstas à sua identificação, as posições seguintes deverão ser preenchidas com "zeros", conforme exemplo: CDB00800001 OU DI000800002;

AA = identifica o ano de emissão do ativo, por exemplo, CDB emitido em 10/02/2005, seu código, deverá ser CDB00500003.

SSSSS = Seqüência de caracteres alfanuméricos, iniciada por 00001 e finalizada em ZZZZZ;

Para Registro de Derivativo Contratado no Exterior

Exemplo:TTTTAASSSS

Onde:

TTTT = identifica o Tipo do Ativo. Quando o tipo em questão não alcançar as 4(quatro) posições previstas à sua identificação, as posições seguintes deverão ser preenchidas com "zeros", conforme exemplo: CDB00800001 OU DI000800002;

AA = identifica o ano de emissão do ativo, por exemplo, CDB emitido em 10/02/2005, seu código, deverá ser CDB00500003.

SSSS = Seqüência de caracteres alfanuméricos, iniciada por 00001 e finalizada em ZZZZZ;

7 GLOSSÁRIO

C

CADEMP: Cadastro de Empresas - Área DESIG - Banco Central

CGD: Contrato Global de Derivativos.

CSA: Credit Support Anex.

D

DCE: Derivativo Contratado no Exterior.

DVE: Derivativo Vinculado a Empréstimos.

I

ISDA: International Swaps and Derivatives Association.