

PROJETOS E INICIATIVAS

2º SEMESTRE 2018

# FUTURO DE MOEDAS



## CARACTERÍSTICAS

Paridade	Código de Negociação	Cotação*	Tick Size	Tamanho do Contrato	Preço de Liquidação (Fixing)
EURUSD	EUP	USD por EUR 1.000,00	USD 0,1 por EUR 1.000	EUR 10.000	WM Reuters 4pm London (Mid Price)
GBPUSD	GBR	USD por GBP 1.000,00	USD 0,1 por GBP 1.000	GBP 10.000	
AUDUSD	AUS	USD por AUD 1.000,00	USD 0,1 por AUD 1.000	AUD 10.000	
NZDUSD	NZL	USD por NZD 1.000,00	USD 0,1 por NZD 1.000	NZD 10.000	
USDJPY	JAP	JPY por USD 1.000,00	JPY 10 por USD 1.000	USD 10.000	
USDCAD	CAN	CAD por USD 1.000,00	CAD 0,1 por USD 1.000		
USDCHF	SWI	CHF por USD 1.000,00	CHF 0,1 por USD 1.000		
USDMXN	MEX	MXN por USD 1.000,00	MXN 1 por USD 1.000		
USDTRY	TUQ	TRY por USD 1.000,00	TRY 0,5 por USD 1.000		
USDZAR	AFS	ZAR por USD 1.000,00	ZAR 1 por USD 1.000		
USDCNH	CNH	CNH por USD 1.000,00	CNH 0,5 por USD 1.000		
USDNOK	NOK	NOK por USD 1.000,00	NOK 1 por USD 1.000		
USDSEK	SEK	SEK por USD 1.000,00	SEK 1 por USD 1.000		
USDRUB	RUB	RUB por USD 1.000,00	RUB 10 por USD 1.000		
USDCLP	CHL	CLP por USD 1.000,00	CLP 50 por USD 1.000		"Dólar observado" divulgado pelo Banco Central Chileno

- **Data de Vencimento:** Primeira sessão de negociação do mês de vencimento do contrato
- **Data de Fixing:** Sessão de negociação imediatamente anterior à data de vencimento
- **Último dia de Negociação:** Sessão de negociação imediatamente anterior à data de vencimento

*\*todos os pares com 1 casa decimal*

## MENSAGENS, ARQUIVOS E FLUXOS OPERACIONAIS

Novo instrumento que será tratado da mesma forma que um de derivativo financeiro.

Não há alterações em mensagens, arquivos ou fluxos operacionais já aplicados aos demais derivativos financeiros.