

GUIA OPERACIONAL

Registro de Derivativos
Contratados no Exterior (DCE)



Sumário

1. Introdução.....	3
2. Participantes e Responsabilidades	3
3. Processo Operacional de Registro	4
3.1. Fluxo Operacional e Prazos	4
3.2. Etapas do Processo Operacional de Registro de DCE	4
I. Preparação de informações para envio ao BAB pelo PR.....	4
II. Envio ao BAB pelo PR das informações para registro do DCE.....	5
III. Formas de Envio.....	5
IV. Modelo operacional	6
V. Classificação das Operações	6
VI. Informações a serem enviadas pelo PR ao BAB.....	7
VII. Validação das informações pelo BAB para confirmação do registro do DCE	14
VIII. Recepção do registro do DCE	15
IX. Tratamento das Operações por Tipo de Análise	15
X. Conclusão e Comunicação	17
4. Horário de Funcionamento	18
5. Disposições Gerais.....	18
Anexo I – Fluxo Operacional de Validação e Registro de DCE do Tipo “Direto”	19
Anexo II – Fluxo de Análise de Aderência a Preço de Mercado	20
Anexo III - Passo a Passo Operacional do Participante de Registro	21
Anexo IV – Layout CSV	39



1. Introdução

Este Guia Operacional estabelece, de forma técnica e detalhada, os procedimentos para registro de Derivativos Contratados no Exterior (“DCE”) no ambiente de registro administrado pelo Balcão Agrícola do Brasil (“BAB”), com o objetivo de orientar os Participantes de Registro (“PR”) na adequada execução de todo o processo.

O registro de DCE tem como finalidade conferir transparência e rastreabilidade às operações, bem como, quando aplicável, atender à exigência regulatória e fiscal relacionada ao registro dessas operações em mercados de bolsa ou de balcão organizado.

O BAB atua, nesse contexto, exclusivamente como administradora de mercado de balcão organizado para o registro de DCE, não se caracterizando como contraparte das operações, nem desempenhando qualquer papel na liquidação dessas transações.

Este documento possui caráter meramente operacional e não normativo, contemplando fluxos operacionais, regras de negócio, critérios de validação e a estrutura de dados necessários ao adequado registro de DCE. Dessa forma, a leitura deste documento não dispensa os Participantes do BAB envolvidos no processo de registro de DCE da obrigação de ler, compreender e observar as disposições constantes nos Regulamentos, Manuais e demais documentos divulgados pelo BAB que tratem sobre o tema.

2. Participantes e Responsabilidades

Os pedidos de registro de DCE deverão ser submetidos ao BAB por meio de Participantes de Registro, contratados por uma ou ambas as partes da operação (considerados clientes do Participante de Registro), e que sejam devidamente autorizados e habilitados, nos termos da regulação aplicável e dos Normativos vigentes do BAB.

Compete ao Participante de Registro (PR), além das obrigações aplicáveis a todos os participantes autorizados do BAB:

- responsabilizar-se integralmente pela legalidade, regularidade, veracidade e integridade das informações referentes às partes e à operação;



- verificar a legalidade e a existência da operação no exterior;
- assegurar a correta classificação da operação quanto à modalidade de registro aplicável;
- assegurar o enquadramento da operação nas modalidades previstas nos normativos do BAB e neste Guia, inclusive no que se refere à indicação de submissão à análise de aderência a preço de mercado, quando aplicável;
- manter internamente os dados cadastrais atualizados e realizar os procedimentos de Prevenção à Lavagem de Dinheiro e Financiamento do Terrorismo (PLD/FTP) das partes cujas operações registrar; e
- manter o registro de toda e qualquer solicitação de registro de DCE à qual esteja vinculado, por um período mínimo de 5 (cinco) anos.

O BAB, por sua vez, é responsável pela recepção, validação, processamento e registro dos DCE, bem como, quando aplicável, pela realização de avaliação técnica de aderência às condições de mercado, nos termos das metodologias adotadas.

O registro de DCE no BAB não envolve, em nenhuma hipótese, procedimentos de liquidação, seja física ou financeira, nem o acompanhamento ou a atualização, pelo BAB, dos valores envolvidos na operação, tampouco o cálculo de Ajuste Diário desses contratos. A exatidão dos dados inseridos, bem como a conformidade com a regulação vigente, é de inteira responsabilidade do PR.

3. Processo Operacional de Registro

3.1. Fluxo Operacional e Prazos

O processo de registro de DCE no ambiente do BAB observará o fluxo operacional estruturado pelo BAB, compreendendo as seguintes etapas sequenciais, as quais são detalhadas ao longo deste Guia e conforme **Anexo I**.

3.2. Etapas do Processo Operacional de Registro de DCE

I. Preparação de informações para envio ao BAB pelo PR



O processo de registro de DCE no ambiente de registro do BAB tem início pelo PR, após a formalização da operação entre as partes fora do ambiente do BAB.

Uma vez contratada a operação, para a realização do registro do DCE no BAB, o PR deverá preencher o layout, conforme **Anexo IV** disponibilizado pelo BAB, ou inserir os dados diretamente na interface do sistema, com todas as informações necessárias à adequada caracterização do DCE contratado, conforme os requisitos exigidos pelo BAB.

O PR deve empregar especial atenção para que as informações mínimas obrigatórias sejam devidamente preenchidas, consistentes entre si e compatíveis com a natureza do DCE contratado.

II. Envio ao BAB pelo PR das informações para registro do DCE

O PR deverá enviar ou inserir as informações para registro do DCE, observando, rigorosamente, os padrões técnicos e operacionais estabelecidos pelo BAB. Os dados informados deverão refletir fielmente os termos e condições do DCE contratado.

III. Formas de Envio

As operações deverão ser encaminhadas ao BAB por meio de arquivo eletrônico estruturado, em formato CSV, conforme modelo disponibilizado pelo BAB, previsto no **Anexo IV**, ou inseridas individualmente através da interface do sistema

O envio do arquivo poderá ocorrer por meio dos canais operacionais disponibilizados pelo BAB, incluindo correio eletrônico, SFTP ou mensageria eletrônica, observados os requisitos técnicos de conexão e segurança aplicáveis.

Os campos e estruturas de dados a serem utilizados pelo PR devem refletir o modelo operacional adotado pelo BAB e poderão ser ajustados ao longo da evolução do serviço, sem prejuízo da consistência das informações necessárias ao registro.



IV. Modelo operacional

Para fins de envio, inserção e processamento, cada DCE deverá ser descrito por um conjunto de informações que permita ao BAB compreender, interpretar e registrar adequadamente o DCE.

De forma geral, essas informações se organizam em 4 (quatro) dimensões principais, conforme previsto nos Normativos do BAB:

- 1) A primeira dimensão refere-se à identificação da operação, incluindo elementos que permitam seu rastreamento ao longo do ciclo operacional, tais como identificadores, datas relevantes e indicação de parte(s) envolvida(s).
- 2) A segunda dimensão contempla as características do instrumento, refletindo a natureza do DCE contratado, o ativo ou referência subjacente, o tipo de instrumento, sua direção econômica, prazos e demais elementos que definem a estrutura do contrato.
- 3) A terceira dimensão abrange as condições econômicas do DCE, incluindo parâmetros de preço, multiplicadores, metodologias de cálculo ou demais componentes que determinam o valor econômico do derivativo.
- 4) Por fim, a quarta dimensão refere-se às informações operacionais e de tratamento, abrangendo o gerenciamento de eventos do ciclo de vida do contrato — tais como Cessão e Amortização —, além da classificação para processamento no BAB, bem como eventuais informações complementares que auxiliem na interpretação da estrutura ou na análise de aderência a preço de mercado.

Essas dimensões refletem o modelo operacional apresentado e são suficientes, em conjunto, para permitir o adequado registro das operações, podendo sua granularidade e detalhamento evoluir conforme o desenvolvimento do serviço.

V. Classificação das Operações

Os pedidos de registro de DCE submetidos ao BAB deverão ser classificados pelo PR em uma das seguintes modalidades:

- (i) Registro Direto; ou



(ii) Registro com análise de preço de mercado.

A classificação será determinada pelo PR, sob sua responsabilidade, com base nas características da operação, seu grau de padronização e a necessidade de suporte adicional para fins de conformidade regulatória ou fiscal. A escolha da modalidade implica na definição do fluxo de tratamento da operação no ambiente do BAB.

VI. Informações a serem enviadas pelo PR ao BAB

Cada operação deverá conter, no mínimo, as seguintes informações. A exigência de preenchimento de cada campo está indicada na coluna “Exigência”:

Campos de Identificação Básica

Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
1	ID da Operação ou UTI	Identificador global único da operação (Alfanumérico).	Obrigatório
2	Natureza da Operação	1=Inclusão 2=Alteração 3=Cancelamento 4=Cessão 5=Amortização	Obrigatório
3	ID ou UTI da Operação Mãe / Conectada/ Cedida	Identificador global da operação mãe, conectada ou cedida, conforme aplicável (Alfanumérico).	Condicional (Obrigatório se Campo 2 = 4 ou 5; opcional se Campo 2 = 1, 2 ou 3)
4	Tipo de Registro	1=Direto 2=Com validação de preço	Obrigatório
5	Tipo de Instrumento	1=Swaps 2=Opções 3=Termo 4=NDF	Obrigatório
6	Tipo de Mercado	1=OTC 2=Bolsa 3=Outro	Obrigatório



Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
7	Data de Negociação	Data de fechamento da operação (AAAA-MM-DD).	Obrigatório
8	Data de Início/Eficácia	Data de início da apuração/dos fluxos (AAAA-MM-DD).	Obrigatório
9	Data de Vencimento	Data de liquidação/término do contrato (AAAA-MM-DD).	Obrigatório
10	Forma de Liquidação	1=Liquidação Financeira Bilateral 2=Entrega Física 3=Liquidação Financeira via CCP	Obrigatório
11	Compra/Venda	Sentido da operação para o titular: 1=Compra 2=Venda	Obrigatório
12	Moeda de Liquidação	Código ISO da moeda (ex.: BRL, USD).	Obrigatório

Identificação das Partes (Bloco Dinâmico):

Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
13	Identificação da Parte	Identificador cadastral (CNPJ com 14 dígitos ou LEI com 20 caracteres).	Obrigatório
14	Nome/Razão Social (Parte)	Nome completo da entidade titular nacional.	Obrigatório
15	País de Origem (Parte)	Código ISO 3166-1 Alpha-2 do país (ex.: BR).	Obrigatório



Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
16	E-mail (Parte)	E-mail de contato.	Opcional
17	Contraparte Identificada (S/N)	1=Sim 0=Não	Obrigatório
18	Identificação da Contraparte	LEI (20 caracteres) ou ID equivalente.	Condicional (Se Campo 17 = 1)
19	Contraparte Coligada	Pertence ao mesmo grupo econômico: 1=Sim 0=Não	Condicional (Se Campo 17 = 1)
20	Nome/Razão Social (Contraparte)	Nome completo da contraparte estrangeira.	Condicional (Se Campo 17 = 1)
21	País de Origem (Contraparte)	Código ISO 3166-1 Alpha-2 do país da contraparte.	Condicional (Se Campo 17 = 1)
22	E-mail (Contraparte)	E-mail de contato.	Opcional
23	Identificação da Parte Fiscal	Identificador cadastral da instituição fiscal (CNPJ).	Opcional

Campos Condicionados ao Tipo de Instrumento:

A. Parâmetros de Opções e Termo (Se Campo 5 = 2 ou 3)

Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
24	Valor Base (Notional)	Valor nocional de referência (Decimal).	Condicional
25	Moeda do Nocional	Código ISO 4217.	Condicional



26	Ativo Subjacente	Nome do ativo de referência e local de listagem.	Condicional
27	Mercado de Referência	Referência de mercado (Alfanumérico).	Condicional (Se Campo 26 estiver preenchido)
28	Moeda do Ativo Subjacente	Código ISO 4217.	Condicional (Se Campo 26 estiver preenchido)
29	Vencimento Ativo Subjacente	Data de vencimento do ativo de referência (AAAA-MM-DD).	Condicional (Se Campo 26 estiver preenchido)
30	Preço / Taxa da Operação	Custo unitário, taxa fixa ou spread (Decimal).	Condicional
31	Unidade de Preço	Unidade de medida do ativo precificado.	Condicional (Se Campo 30 estiver preenchido)
32	Tipo de Amortização	1=Bullet 2=Linear 3=Customizada	Condicional

B. Estrutura de Pernas de SWAP e NDF (Se Campo 5 = 1 ou 4)

Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
33/40	Valor Nocional	Valor monetário de referência associado à perna (Decimal).	Condicional
34/41	Moeda	Código ISO 4217.	Condicional
35/42	Preço / Taxa / Spread	Taxa seca ou spread flutuante (Decimal).	Condicional
36/43	Unidade de Preço / Taxa	Unidade de medida do ativo precificado.	Condicional



Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
37/44	Tipo de Amortização	1=Bullet 2=Linear 3=Customizada	Condicional
38/45	Tipo de Regime	1=Fixo 2=Flutuante	Condicional
39/46	Indexador	Índice (ex.: CDI, SOFR) ou PRE (Alfanumérico).	Condicional

Nota: Para os campos apresentados em pares, a primeira numeração refere-se à **Perna Declarante** (campos 33 a 39) e a segunda à **Perna Oposta/Saída** (campos 40 a 46).

C. Parâmetros Exclusivos de Opções (Se Campo 5 = 2)

Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
47	Tipo de Opção	Natureza do direito: 1=Compra (Call) 2=Venda (Put)	Condicional
48	Estilo da Opção / Exercício	1=Americana 2=Europeia 3=Asiática	Condicional
49	Preço de Exercício / Strike	Preço de exercício estipulado para o ativo (Decimal).	Condicional
50	ESTRUTURA_KNOCK_IN	2=UP-AND-IN 4=DOWN-AND-IN 5=N/A	Condicional
51	Barreira - Knock-In	Valor de ativação (Decimal).	Condicional (Se Campo 5 = 2 e Campo 50 ≠ 5)
52	ESTRUTURA_KNOCK_OUT	1=UP-AND-OUT 3=DOWN-AND-OUT 5=N/A	Condicional



Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
53	Barreira - Knock-Out	Valor de desativação (Decimal).	Condicional (Se Campo 5 = 2 e Campo 52 ≠ 5)

Campos de Margem e Garantias:

Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
54	Troca de Margem Bilateral	Há chamada de margem? 1=Sim 0=Não	Obrigatório
55	Depositante de Margem	1=Parte 2=Contraparte 3=Ambas	Condicional (Se Campo 54 = 1)
56	Tipo de Margem Exigida	1=Margem de Variação (VM) 2=Margem Inicial e de Variação (IM+VM) 3=Isento	Condicional (Se Campo 54 = 1)
57	Tipo de Colateral Elegível	1=Caixa 2=Títulos Soberanos 3=Outros	Condicional (Se Campo 54 = 1)
58	Frequência de Reavaliação	1=Diária 2=Semanal 3=Mensal 4=Outra	Condicional (Se Campo 54 = 1)
59	Limite de Isenção (Threshold) - Parte	Valor de exposição abaixo do qual não há chamada (Decimal).	Condicional (Se Campo 55 = 1 ou 3)
60	Moeda do Limite de Isenção (Threshold) - Parte	Código ISO 4217.	Condicional (Se Campo 59 estiver preenchido)



Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
61	Limite de Isenção (Threshold) - Contraparte	Valor de exposição abaixo do qual não há chamada (Decimal).	Condicional (Se Campo 55 = 2 ou 3)
62	Moeda do Limite de Isenção (Threshold) - Contraparte	Código ISO 4217.	Condicional (Se Campo 61 estiver preenchido)

Parâmetros Comerciais Gerais, Tarifas e Eventos do Ciclo de Vida:

Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
63	Taxa/Tarifa Transacional Paga	Tarifas de estruturação pagas antecipadamente (Decimal).	Opcional
64	Moeda da Taxa/Tarifa Transacional	Código ISO 4217.	Condicional (Se Campo 63 estiver preenchido)
65	Propósito da Operação	1=Hedge 2=Arbitragem 3=Especulação	Obrigatório
66	Informações Adicionais	Notas de suporte ou cláusulas customizadas (até 4000 caracteres).	Opcional
67	Preço/Taxa da Cessão	Preço/tarifa adicional cobrado em razão da cessão (Decimal).	Condicional (Se Campo 2 = 4)
68	Data de Amortização	Data em que a amortização foi negociada (AAAA-MM-DD).	Condicional (Se Campo 2 = 5)
69	Valor Nocial Amortizado	Valor de referência associado à amortização realizada.	Condicional (Se Campo 2 = 5)



Nº	Campo	O que preencher / Formato	Exigência
70	Preço/Taxa da Amortização	Preço unitário ou valor financeiro líquido acordado para liquidar a parcela amortizada.	Condicional (Se Campo 2 = 5 e Campo 4 = 2)

Sempre que aplicável, deverão ser utilizados identificadores padronizados:

- UTI (Unique Transaction Identifier); e
- UPI (Unique Product Identifier).

Na ausência, deverá ser utilizado identificador interno rastreável.

VII. Validação das informações pelo BAB para confirmação do registro do DCE

Após o recebimento, o BAB realizará a validação das informações, consistente na verificação do correto preenchimento dos campos obrigatórios, da aderência aos formatos definidos pelo BAB e na análise da coerência entre os dados informados. Essa validação compreende a análise da integridade dos dados, da coerência entre os parâmetros informados e da compatibilidade com os modelos de contratos admitidos para registro pelo BAB, conforme descrito abaixo.

O arquivo apenas será considerado recebido após a verificação de sua correta inserção nos sistemas do BAB.

a) Validação Estrutural

- Campos obrigatórios não podem estar vazios; e
- Tipos de dados devem respeitar o formato definido

b) Validação Lógica

- Data de Vencimento $\geq$ Data de Negociação;
- 0 dias úteis $\leq$ Data de Protocolo - Data de Negociação $\leq$ 2 dias úteis;
- Data de Início/Eficácia $\leq$ Data de Vencimento; e
- Valor Base (Nocional) > 0



c) Rejeição

A operação será rejeitada nas seguintes hipóteses:

- Arquivo inválido;
- Campos obrigatórios ausentes; e
- Inconsistência lógica.

A validação das operações será realizada de forma automatizada pelos sistemas do BAB, contemplando verificações estruturais e lógicas das informações enviadas.

O resultado da validação será disponibilizado ao Participante de Registro por meio da interface do sistema.

A interface do sistema conterá, quando aplicável, a indicação detalhada dos campos com inconsistência, permitindo a correção e reenvio da operação. Caberá ao PR realizar a correção dos ajustes indicados e reenviar a operação, conforme passo II descrito acima. Fluxo, conforme **Anexo I**.

VIII. Recepção do registro do DCE

Não sendo identificadas inconsistências, a operação será considerada válida e apta ao prosseguimento no fluxo operacional correspondente à sua classificação.

IX. Tratamento das Operações por Tipo de Análise

▪ Registro de Operações sem Análise de Preço

Para as operações classificadas pelo PR como não sujeitas à análise de aderência a preço de mercado, o BAB, após a validação operacional, procederá ao registro da operação em seus sistemas.

Nesses casos, o BAB não realiza qualquer avaliação econômica ou validação de preço, limitando-se ao registro da operação com base nas informações fornecidas pelo PR.

A confirmação do registro será disponibilizada ao PR diretamente na interface do sistema, permitindo a exportação do detalhamento em formato de recibo (contendo a



identificação da operação, seu status de registro, entre outras informações). Adicionalmente, essas informações também serão disponibilizadas por meio de relatórios diários.

▪ **Operações com Análise de Aderência a Preço de Mercado**

Para operações classificadas com análise de preço, o BAB avaliará a aderência a preço não apenas na inclusão inicial, mas também nos eventos de Amortização e Cessão — avaliando a compatibilidade do Preço/Taxa da operação com as condições de mercado vigentes.

Essa análise tem por objetivo verificar se as condições de preço da operação são compatíveis com parâmetros observáveis de mercado, considerando as características específicas do DCE submetido a registro.

Os critérios de aceite no âmbito da análise de aderência a preço de mercado observarão o seguinte racional:

- Nas operações cujo ativo, referência ou estrutura apresente liquidez e parâmetros observáveis de mercado, o preço informado no registro será confrontado com as referências disponíveis para a data da operação, como: preços de abertura, fechamento, mínimo e máximo.
- Nas operações associadas a ativo, referência ou estrutura com menor liquidez, a análise poderá considerar, além das referências disponíveis, o histórico de preços, comportamento do ativo subjacente, instrumentos comparáveis e características contratuais, bem como outros dados técnicos que permitam avaliar a razoabilidade econômica do preço informado.
- Na ausência de referências observáveis suficientes ou de mercado com liquidez apta a suportar comparação objetiva, o BAB poderá realizar a avaliação da aderência do preço com base em metodologia própria, considerando a natureza, a estrutura e as particularidades do DCE submetido a registro, bem como os parâmetros técnicos disponíveis.

Concluída a análise, poderão ser observados os seguintes resultados:



- sendo constatada aderência a preço de mercado, a operação será registrada normalmente; ou
- sendo identificada divergência relevante em relação às condições de mercado, o BAB poderá solicitar esclarecimentos ou justificativas adicionais ao PR. Nessa hipótese, a operação permanecerá em status pendente até a avaliação das informações complementares encaminhadas, conforme Anexo II. Caso a divergência não seja sanada por meio das justificativas apresentadas, o registro da operação será negado

X. Conclusão e Comunicação

O BAB disponibilizará ao PR por meio da interface do sistema (e relatório ao final da sessão de negociação) informações referentes ao processamento das operações submetidas, como:

- a confirmação de aceitação do registro do DCE;
- a indicação de rejeição por inconsistência de dados; e
- a solicitação de informações ou esclarecimentos adicionais.

Para operações sujeitas à análise de preço, a interface do sistema disponibilizará também a indicação do resultado da avaliação de aderência a mercado ou eventual necessidade de justificativa.

Na hipótese de rejeição ou solicitação de esclarecimentos, o PR terá o prazo de até 1 (um) Dia Útil para envio das justificativas ou informações complementares. Após o recebimento, o BAB envidará os melhores esforços para realizar a análise e manifestação quanto ao aceite ou rejeição definitiva da operação no prazo de até 1 (um) Dia Útil.

O prazo esperado para processamento e retorno das operações observará o ciclo operacional do BAB e será, em condições usuais, de até 1 (um) Dia Útil a partir do recebimento da operação, sem prejuízo dos prazos adicionais previstos neste Capítulo.

Nota: Os prazos mencionados nesta seção possuem caráter exclusivamente indicativo e de orientação, refletindo o compromisso do BAB com a celeridade do processo, não constituindo obrigação peremptória ou ensejo para a responsabilização das partes em caso de flutuações operacionais.



4. Horário de Funcionamento

O envio, processamento e retorno das operações observarão o Horário de Registro de DCE, que será divulgado por meio de Ofício Circular.

A inclusão, alteração, cancelamento, cessão, amortização e quaisquer outros atos operacionais relativos ao DCE só poderão ser realizados dentro do Horário de Registro de DCE.

5. Disposições Gerais

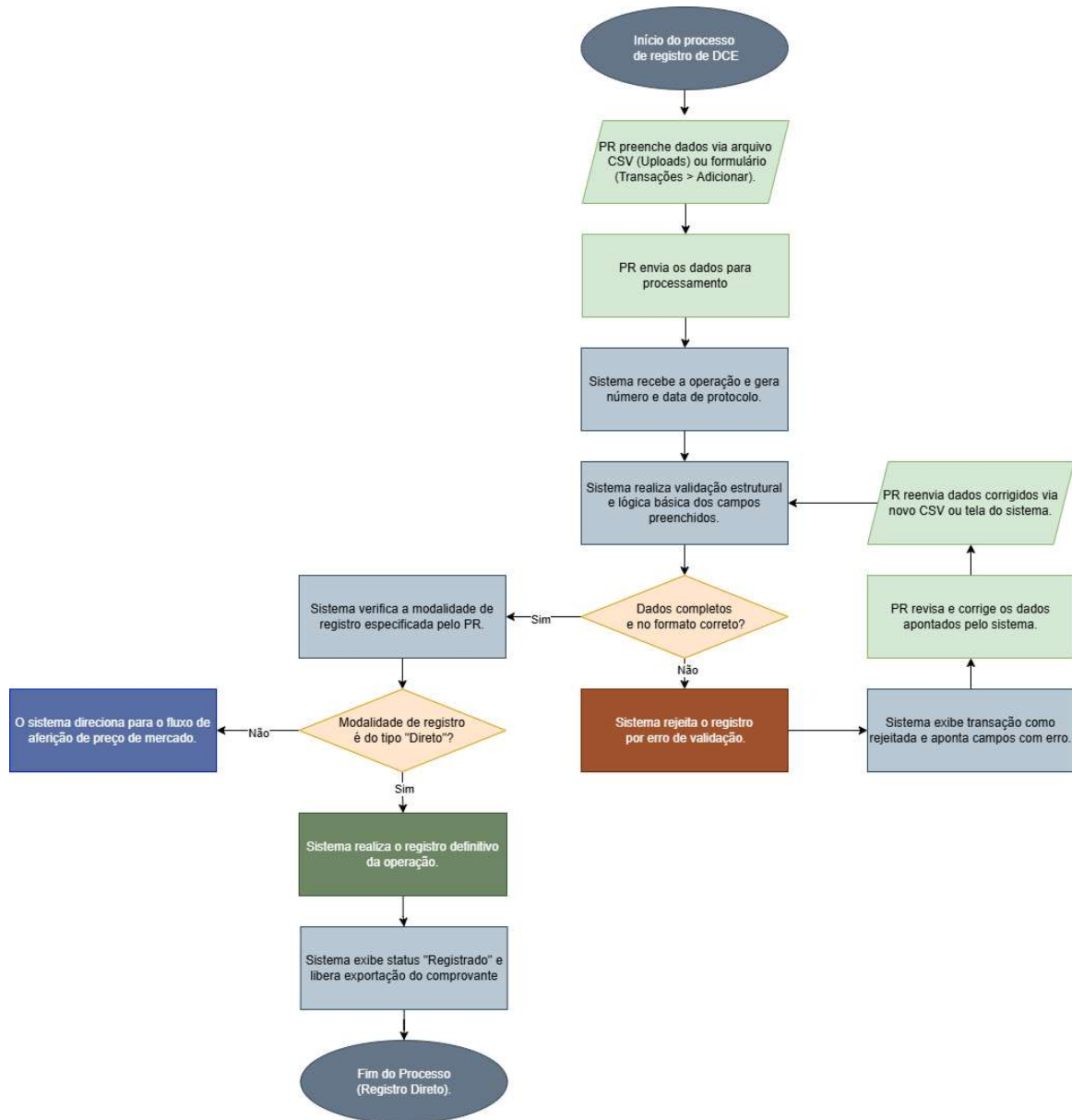
O registro das operações de DCE no ambiente do BAB não altera as condições contratuais pactuadas entre as partes, tampouco interfere na liquidação financeira ou física das operações, que permanecem regidas pelos termos originalmente acordados.

O BAB manterá os registros das operações e das interações associadas pelo prazo e nas condições estabelecidas na regulação aplicável e nos Normativos do BAB, garantindo a rastreabilidade e a integridade das informações.

Os procedimentos descritos neste Guia poderão ser aprimorados ao longo do tempo, em função da evolução do modelo operacional, dos requisitos regulatórios e das necessidades do mercado. As alterações realizadas neste Guia serão divulgadas aos Participantes do BAB por meio de Ofício Circular, a ser disponibilizado no site oficial do BAB.

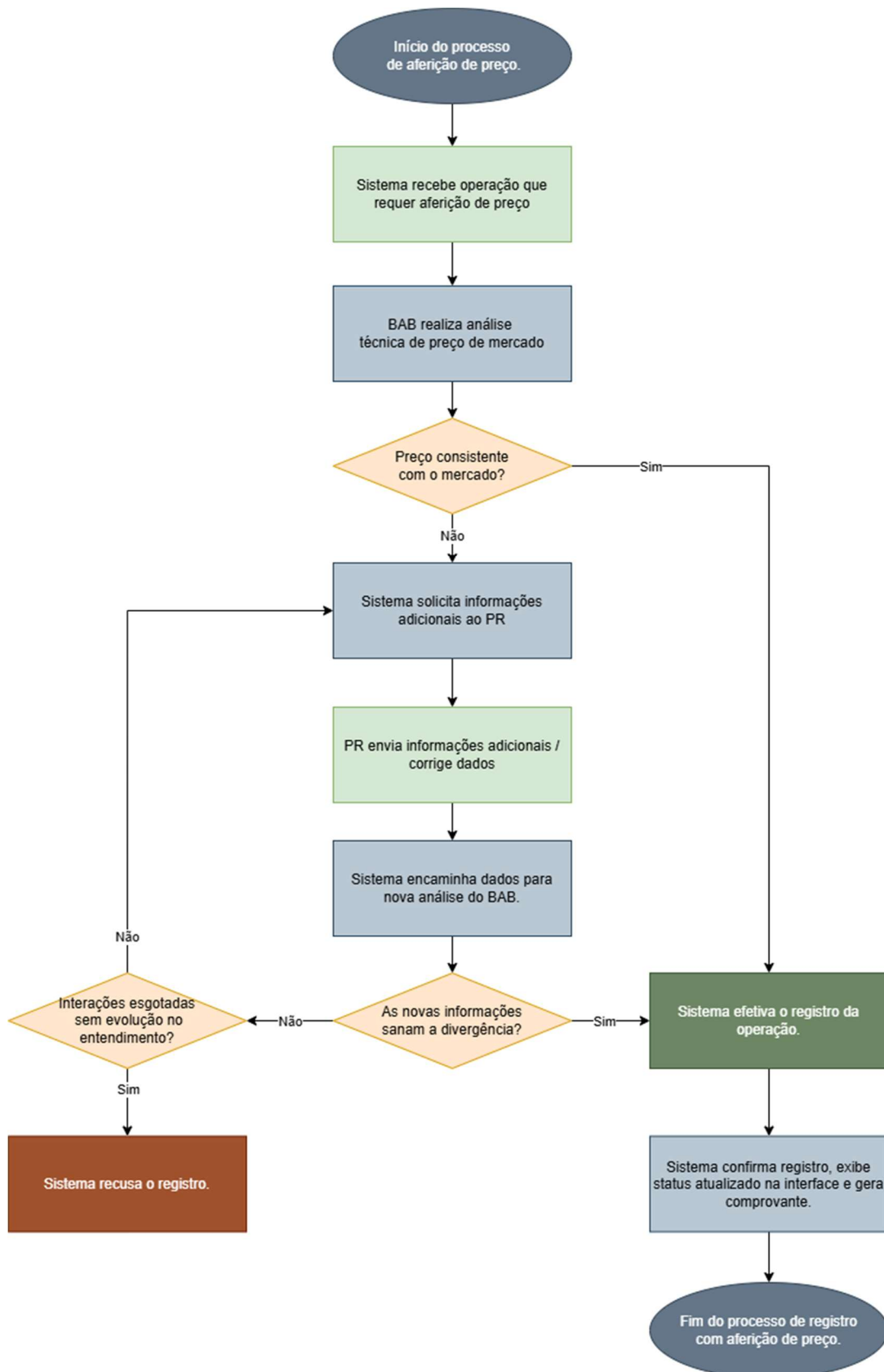


Anexo I – Fluxo Operacional de Validação e Registro de DCE do Tipo “Direto”





Anexo II – Fluxo de Análise de Aderência a Preço de Mercado





Anexo III - Passo a Passo Operacional do Participante de Registro

Esta seção orienta o Participante de Registro (“PR”) sobre o acesso ao sistema do BAB e a utilização das funcionalidades operacionais para envio, consulta e acompanhamento das solicitações de registro de Derivativos Contratados no Exterior (“DCE”).

O Participante de Registro (PR) é integralmente responsável pela veracidade, integridade, consistência e correta classificação das informações submetidas ao BAB, observados os layouts, padrões técnicos e fluxos operacionais vigentes. Antes de qualquer envio, o PR deverá assegurar que os dados da operação estejam completos, coerentes entre si e compatíveis com a natureza do DCE a ser registrado.

1. Acesso ao Sistema

O acesso ao sistema do BAB é realizado mediante credenciais individualizadas, vinculadas ao perfil do usuário autorizado pelo PR.

1. Autenticação Inicial: Na tela de acesso, o usuário deve informar suas credenciais (login e senha).

2. Segundo Fator de Autenticação: Em seguida, o sistema enviará um código de uso único (OTP - One-Time Pin) para o e-mail cadastrado do usuário.



Balcão Agrícola do Brasil

DCE Portal

Sign in with a broker or administrator account.

A one-time PIN has been sent to [masked email]

OTP expires at 2026-06-22T14:20:36.3206176Z.

One-Time PIN

[input field]

Verify OTP

3. Paine! Principal: Após a validação do código, o usuário será direcionado à página principal, onde estarão disponíveis as páginas de envio em lote e de transações.

Redefinição de Senha: Caso o usuário não se lembre da senha e necessite redefini-la, basta clicar no link “Esqueceu a senha” (logo abaixo do botão “Entrar”) e fornecer o e-mail cadastrado para receber as instruções de recuperação.

Balcão Agrícola do Brasil

Portal DCE

Entre com uma conta de corretora ou administrador.

Usuário

[input field]

Senha

[input field]

Entrar

[Esqueceu a senha?](#)

Email para recuperar senha

[input field]

Enviar link de redefinição

Se este email existir, um link de redefinição foi enviado.





2. Preparação das Informações para Envio

Antes de iniciar qualquer envio, o PR deve estruturar as informações da operação de acordo com o layout e os padrões técnicos definidos pelo BAB. É fundamental atentar-se aos detalhes explicados anteriormente neste guia, garantindo, entre outros itens, a definição correta do tipo de registro desejado.

O envio das informações pode ser realizado por duas modalidades: em lote (via arquivo CSV) ou individualmente (diretamente pela interface do sistema).

Opção A: Envio em Lote (via arquivo CSV)

O envio em lote é realizado por meio do carregamento de um arquivo CSV na página de Envios, seguindo as etapas abaixo:

Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Envio de Registro DCE

Logado como: [nome] (Corretor)

Envios Transações Notificações

Enviar CSV

[Escolher Arquivo] Nenhum arquivo escolhido [Enviar e Validar]

Envios Recentes

Search...

Lote	Arquivo	Enviado Por	Enviado Em (UTC-3)	Total	Validos	Invalidos
19	20_layout_values_with_leading_trailing_spaces.csv		2026-06-19 16:06:44	3	3	0
18	19_layout_crlf_line_endings.csv		2026-06-19 16:06:23	3	3	0
17	18_layout_blank_lines_between_records.csv		2026-06-19 16:06:02	2	2	0
16	17_layout_header_only.csv		2026-06-19 16:05:40	0	0	0
15	14_layout_column_order_swapped.csv		2026-06-19 16:03:27	1	1	0
14	12_layout_extra_column.csv		2026-06-19 16:02:51	1	1	0
13	10_layout_utf8_bom.csv		2026-06-19 15:58:43	3	3	0
12	09_layout_valid_email_domain_limit.csv		2026-06-19 15:58:27	30	30	0

Passo 1: Clique em "Escolher Arquivo" e selecione o arquivo CSV desejado em seu computador.

Passo 2: Clique em "Enviar e Validar". O sistema gerará uma prévia com o resultado das validações automáticas dos registros antes da transmissão definitiva, detalhando os campos com erro, se houver. Além de listar todas as operações — indicando o status de "Válida" ou "Inválida" conforme a análise sistêmica de seus parâmetros —, a tela exibirá uma contagem total no topo.

Passo 3: Confirme a operação. Na parte inferior da tela, ao final da lista de registros validados, clique no botão de Envio para finalizar ou em Cancelar para abortar a ação.

Opção B: Inclusão Individual de Registro

Passo 1: Acesse a tela de Transações e clique no botão "Adicionar".



Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Transacoes

Logado como [nome]

Envios Transacoes Notificacoes

Data inicial: 22/06/2025 Data final: 22/06/2026 Tipo: Todos

Selecionar todos **Adicionar** Alterar Exportar Transacoes Selecionadas Exportar Recibo da Transacao

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total	5200	Cancelado	1	Registro Pendente	1300	Registrado	3564	Rejeitado	335
-------	------	-----------	---	-------------------	------	------------	------	-----------	-----

Auditoria	UTI (Identificador Único da Transação)	Tipo de Registro	Status do Registro ^	Data de Protocolo	Ultima Atualizacao	ID de registro BAB	Data de R
☐ Ver Auditoria	LIFE_ORDER_001	Direto	Cancelado	2026-06-19 15:30:36	2026-06-19 15:37:50	-	-
☐ Ver Auditoria	DCEEXPPERF04996	Com validacao de preco	Registro Pendente	2026-06-19 15:56:11	2026-06-19 15:56:11	-	-

Passo 2: Na tela de inserção que se abrirá, preencha todos os campos obrigatórios e opcionais aplicáveis à operação.

Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Transacoes

Logado como [nome]

Envios Transacoes Notificacoes

Data inicial: 22/06/2025 Data final: 22/06/2026 Tipo: Todos

Selecionar todos **Adicionar** Alterar Exportar Transacoes Selecionadas Exportar Recibo da Transacao

Adicionar Transacao

UTI (Unique Trade Identifier): [input]

Registration Type: [dropdown]

Nature of the operation: [dropdown]

Reporting Party Identification: [input]

Reporting Party Name / Corporate Name: [input]

Reporting Party E-Mail: [input]

Reporting Party Country of Origin: [input]

Identified Counterparty (Y/N): [dropdown]

Counterparty E-Mail: [input]

Tax Party Identification: [input]

Trade Date: dd/mm/aaaa [input]

Effective Date: dd/mm/aaaa [input]

Maturity Date: dd/mm/aaaa [input]

Instrument Type: [dropdown]

Settlement Method: [dropdown]

Settlement Currency: [input]

Base Value (Notional): [input]

Quantity: [input]

Multiplier: [input]

Buy/Sell: [dropdown]

Functionality / Purpose: [input]

Bilateral Margin Exchange: [input]

Enviar Por: [input]

Cancelar

Passo 3: Após o preenchimento, clique no botão de confirmação localizado na parte inferior da janela.



Passo 4: Uma janela pop-up de confirmação será exibida. Confirme a ação para concluir o processo.

3. Visualização de Operações Submetidas a Registro

Na página de Transações, é possível fazer a gestão das operações submetidas a registro por meio das seguintes funcionalidades:

- a) Acompanhamento de Status: Visualização do status de cada registro do subsistema de DCE, de forma individual ou por meio do contador geral no centro da página.



Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Transacoes

Logado como (Corretor)

Envios Transacoes Notificacoes

Data inicial: 22/06/2025 Data final: 22/06/2026 Tipo: Todos

Buscar

Selecionar todos Adicionar Alterar Exportar Transacoes Seleccionadas Exportar Recibo da Transacao

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total	5200	Cancelado	1	Informacao Necessaria	1	Registro Pendente	1300	Registrado	3563	Rejeitado	335
-------	------	-----------	---	-----------------------	---	-------------------	------	------------	------	-----------	-----

Auditoria	UTI (Identificador Único da Transação)	Tipo de Registro	Status do Registro ^	Data de Protocolo	Ultima Atualizacao
☐ Ver Auditoria	LIFE_ORDER_001	Direto	Cancelado	2026-06-19 15:30:36	2026-06-19 15:37:50
☐ Ver Auditoria	DCEEXPPERF04522	Direto	Informacao Necessaria	2026-06-19 15:56:11	2026-06-22 11:48:38
☐ Ver Auditoria	DCEEXPPERF04996	Com validacao de preco	Registro Pendente	2026-06-19 15:56:11	2026-06-19 15:56:11
☐ Ver Auditoria	DCEEXPPERF04992	Com validacao de preco	Registro Pendente	2026-06-19 15:56:11	2026-06-19 15:56:11

- b) Filtros Avançados: Filtragem dos registros e de suas contagens por data de protocolo ou por qualquer outra informação contida no documento (ex: Parte, Instrumento, etc.).

Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Transacoes

Logado como (Corretor)

Envios Transacoes Notificacoes

Data inicial: 22/06/2025 Data final: 22/06/2026 Tipo: Todos

Buscar

Selecionar todos Adicionar Alterar Exportar Transacoes Seleccionadas Exportar Recibo da Transacao

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total	5200	Cancelado	1	Informacao Necessaria	1	Registro Pendente	1300	Registrado	3563	Rejeitado	335
-------	------	-----------	---	-----------------------	---	-------------------	------	------------	------	-----------	-----

Auditoria	UTI (Identificador Único da Transação)	Tipo de Registro	Status do Registro ^	Data de Protocolo	Ultima Atualizacao	ID de registro BAB
☐ Ver Auditoria	LIFE_ORDER_001	Direto	Cancelado	2026-06-19 15:30:36	2026-06-19 15:37:50	-

- c) Exportação de Relatórios: *Download* da visualização atual em formato Excel através da função “Exportar Transações Seleccionadas”.



Balcão Agrícola do Brasil
DCE Registration Subsystem

Transactions

Logged in as: [User Name]

Uploads Transactions Notifications

From date: 21/08/2025 To date: 21/08/2026 Type: All Retrieve Filter Clear filters

Select all Add Amend Assignment Amortization **Export Selected Transactions** Export Transaction Receipt Cancel

REGISTRATION STATUS SUMMARY

Total	5394	Cancelled	5	Pending Registration	5238	Registered	69	Rejected	82
-------	------	-----------	---	----------------------	------	------------	----	----------	----

Audit	Protocol ID	Operation ID or UTI	Registration Type	Registration Status	Protocol Date	Last Updated	BAB Registration ID	Registration Date	Upload
☒ View Audit	FB8B14	FER2060820TESTE0001	Direct	Registered	2026-08-20 13:33:23	2026-08-20 13:33:23	TRN-20260820-DCE064	2026-08-20 13:33:23	Broker/
☐ View Audit	11E458	FER2060820TESTE0002	Direct	Registered	2026-08-20 13:44:21	2026-08-20 13:44:21	TRN-20260820-9806A7	2026-08-20 13:44:21	Broker/
☐ View Audit	BD13F6	FER2060820TESTE0002C	Direct	Registered	2026-08-20 14:33:24	2026-08-20 14:33:24	TRN-20260820-B21C48	2026-08-20 14:33:24	Broker/
☐ View Audit	06E411	FER2060820TESTE0002CC	Direct	Registered	2026-08-20 14:37:40	2026-08-20 14:37:40	TRN-20260820-E30DD3	2026-08-20 14:37:40	Broker/
☐ View Audit	C4293D	FER2060820TESTE0001A	Direct	Registered	2026-08-20 14:39:46	2026-08-20 14:39:46	TRN-20260820-4862A9	2026-08-20 14:39:46	Broker/
☐ View Audit	373310	FER2060820TESTE0001A2	Direct	Registered	2026-08-20 14:42:38	2026-08-20 14:42:38	TRN-20260820-D46FE8	2026-08-20 14:42:38	Broker/

- d) Emissão de Recibo: Exportação do recibo de uma transação cadastrada e submetida.

Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Transacoes

Logado como: [User Name] (Corretor)

Envios Transacoes Notificacoes

Data inicial: 23/06/2025 Data final: 23/06/2026 Tipo: Todos Buscar

Selecionar todos Adicionar Alterar Exportar Transacoes Selecionadas **Exportar Recibo da Transacao**

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total	100	Informacao Necessaria	2	Registro Pendente	21	Registrado	72	Rejeitado	5
-------	-----	-----------------------	---	-------------------	----	------------	----	-----------	---

☒ Ver Auditoria	DCEXPERF04996	Com validacao de preco	Registrado	2026-06-19 15:56:11	2026-06-23 12:03:44	TRN-20260623-D8E464
---	---------------	------------------------	------------	---------------------	---------------------	---------------------

4. Alteração de Operação Submetida a Registro

A funcionalidade de alteração é utilizada para solicitar a modificação de um registro enviado anteriormente.

Regra de Aprovação: Exceto em casos de correção de operações “Rejeitadas” (por campos inválidos), todas as demais solicitações de alteração exigem a justificativa da mudança e passam pela avaliação de mérito do BAB antes de serem efetivadas.



De forma semelhante à inclusão de operações (detalhada na Seção 2), os procedimentos para alteração seguem duas modalidades:

- Em lote (via arquivo): Utiliza-se o arquivo CSV com o campo “Natureza da Operação” preenchido com o valor 2 (Alteração).
- Pela interface do sistema: Selecione o registro desejado na tela e clique no botão “Alterar”, conforme exemplificado abaixo:

Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Transacoes

Logado como [nome] (Corretor)

Envios Transacoes Notificacoes

Data inicial: 23/06/2025 Data final: 23/06/2026 Tipo: Todos

Selecionar todos Adicionar **Alterar** Responder Exportar Transacoes Selecionadas Exportar Recibo da Transacao

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total	100	Informacao Necessaria	1	Registro Pendente	23	Registrado	71	Rejeitado	5
-------	-----	-----------------------	---	-------------------	----	------------	----	-----------	---

Auditoria	UTI (Identificador Único da Transação)	Tipo de Registro	Status do Registro ^	Data de Protocolo	Ultima Atualizacao	ID de registro BAB	Data de Registro
☒ Ver Auditoria	DCEXPPPERF04522	Direto	Informacao Necessaria	2026-06-19 15:56:11	2026-06-22 11:48:38	-	-

Ao clicar no botão “Alterar”, uma janela será exibida permitindo a edição dos campos do registro.

Alterar Transacao

UTI (Unique Trade Identifier): DCEXPPPERF04522

Registration Type: Direto

Nature of the operation: Inclusao

Reporting Party Identification: 51004785000101

Reporting Party Name / Corporate Name: Empresa Brasileira Teste 125221 SA

Reporting Party E-Mail: teste12522@empresa.com.br

Reporting Party Country of Origin: BR

Identified Counterparty (Y/N): Sim

Counterparty Identification: 5493000000000318259

Counterparty Name / Corporate Name: Counterparty Global 12522 Ltd

Affiliate Counterparty: No

Counterparty Country of Origin: DE

Counterparty E-Mail: ops12522@counterparty.de

Tax Party Identification:

Trade Date: 21/06/2026

Effective Date: 22/06/2026

Maturity Date: 29/01/2027

Instrument Type: Termos

Settlement Method: Liquidacao Fisica

Underlying Asset: ICE SUGAR

Underlying Asset Currency: USD

Underlying Asset Maturity: 19/10/2026

EN PT BR

Salvar

Cancelar

Enviado Per

Na parte inferior dessa janela, clique em “Salvar” para gravar as alterações. O sistema exibirá uma mensagem de confirmação e, em seguida, dará andamento ao processo.



The screenshot shows the 'Transações' (Transactions) section of the DCE System. A modal dialog is open asking 'Salvar alterações desta transação?' (Save changes to this transaction?). The dialog has 'OK' and 'Cancelar' (Cancel) buttons. The background form shows details for a transaction, including 'Trade Date' (21/06/2026), 'Maturity Date' (29/01/2027), 'Settlement Method' (Liquidação Física), 'Underlying Asset' (ICE SUGAR), and 'Underlying Asset Maturity' (19/10/2026).

5. Cessão de uma Operação Submetida a Registro

A funcionalidade de cessão é utilizada para registrar a transferência de titularidade (integral ou parcial) de uma operação ativa para uma nova contraparte.

De forma semelhante à alteração de operações (detalhada na Seção 4), os procedimentos para cessão seguem duas modalidades:

- Em lote (via arquivo): Utiliza-se o arquivo CSV com o campo "Natureza da Operação" preenchido com o valor 4 (Cessão), informando o ID/UTI da operação mãe/conectada/cedida (Campo 3) e o Preço/Taxa da Cessão (Campo 67).
- Pela interface do sistema: Selecione o registro desejado na tela de Transações e clique no botão "Cessão", conforme exemplificado abaixo:

The screenshot shows the 'Transações' (Transactions) section of the DCE System. A table of transactions is displayed, and the 'Cessão' button is highlighted in red. The table has columns for 'Auditoria', 'ID do Protocolo', 'ID da Operação ou UTI', 'Tipo de Registro', 'Status do Registro', 'Data de Protocolo', 'Última Atualização', 'ID de registro BAB', 'Data de Registro', 'Enviado Por', and 'Natureza da operação'.

Auditoria	ID do Protocolo	ID da Operação ou UTI	Tipo de Registro	Status do Registro	Data de Protocolo	Última Atualização	ID de registro BAB	Data de Registro	Enviado Por	Natureza da operação
Ver Auditoria	49C372	FER2060820TESTE0002CCA1C1	Direct	Registrado	2026-08-20 15:26:23	2026-08-20 15:26:23	TRN-20260820-54FFD7	2026-08-20 15:26:23		Assignment
Ver Auditoria	E323CE	FER2060820TESTE0001A3C1	Direct	Registrado	2026-08-20 14:51:00	2026-08-20 14:51:00	TRN-20260820-67D626	2026-08-20 14:51:00		Assignment
Ver Auditoria	2101C6	FER2060820TESTE0002CCA1	Direct	Registrado	2026-08-20 14:49:19	2026-08-20 14:49:19	TRN-20260820-4A638F	2026-08-20 14:49:19		Amortization
Ver Auditoria	7AF410	FER2060820TESTE0001A4A1	Direct	Registrado	2026-08-20 14:46:38	2026-08-20 14:46:38	TRN-20260820-8A28FF	2026-08-20 14:46:38		Amortization
Ver Auditoria	AD8280	FER2060820TESTE0001A4	Direct	Registrado	2026-08-20 14:44:54	2026-08-20 14:44:54	TRN-20260820-944002	2026-08-20 14:44:54		Amortization
Ver Auditoria	B28FF9	FER2060820TESTE0001A3	Direct	Registrado	2026-08-20 14:43:29	2026-08-20 14:43:29	TRN-20260820-FD980F	2026-08-20 14:43:29		Amortization
Ver Auditoria	373310	FER2060820TESTE0001A2	Direct	Registrado	2026-08-20 14:42:38	2026-08-20 14:42:38	TRN-20260820-D46FE8	2026-08-20 14:42:38		Amortization
Ver Auditoria	C4293D	FER2060820TESTE0001A	Direct	Registrado	2026-08-20 14:39:46	2026-08-20 14:39:46	TRN-20260820-4862A9	2026-08-20 14:39:46		Amortization
Ver Auditoria	066411	FER2060820TESTE0002CC	Direct	Registrado	2026-08-20 14:37:40	2026-08-20 14:37:40	TRN-20260820-E30D03	2026-08-20 14:37:40		Assignment
Ver Auditoria	B013F6	FER2060820TESTE0003C	Direct	Registrado	2026-08-20 14:33:24	2026-08-20 14:33:24	TRN-20260820-B21C48	2026-08-20 14:33:24		Assignment
Ver Auditoria	56EF04	FER2060820TESTE00004	With price validation	Registro Pendente	2026-08-20 14:28:23	2026-08-20 14:28:23	-	-		Inclusion
Ver Auditoria	21Q490	FER2060820TESTE00003	With price validation	Registro Pendente	2026-08-20 13:46:28	2026-08-20 13:46:28	-	-		Inclusion
Ver Auditoria	11E458	FER2060820TESTE00002	Direct	Registrado	2026-08-20 13:44:21	2026-08-20 13:44:21	TRN-20260820-9806A7	2026-08-20 13:44:21		Inclusion
Ver Auditoria	F88B14	FER2060820TESTE00001	Direct	Registrado	2026-08-20 13:33:23	2026-08-20 13:33:23	TRN-20260820-DCE064	2026-08-20 13:33:23		Inclusion



Ao clicar no botão “Cessão”, uma janela *pop-up* será exibida permitindo a edição das partes e o preenchimento dos dados do contrato cedido.

Na parte inferior dessa janela, clique em “Salvar” para gravar as alterações. O sistema exibirá uma mensagem de confirmação e dará andamento ao processo.

6. Amortização de uma Operação Submetida a Registro

A funcionalidade de amortização é utilizada para registrar a liquidação parcial do valor nominal ao longo da vigência do contrato.

De forma semelhante à alteração de operações (detalhada na Seção 4), os procedimentos para amortização seguem duas modalidades:

- Em lote (via arquivo): Utiliza-se o arquivo CSV com o campo “Natureza da Operação” preenchido com o valor 5 (Amortização), informando a Data de Amortização (Campo 68), o Valor Nominal Amortizado (Campo 69) e o Preço/Taxa da Amortização (Campo 70).
- Pela interface do sistema: Selecione o registro desejado na tela de Transações e clique no botão “Amortização”, conforme exemplificado abaixo:



Envios Transações Notificações 15:07:02 UTC-3 Aberto Fechar em 10:00 EN PF-ENL

Data Inicial 28/08/2025 Data final 28/08/2026 Tipo Todos Buscar Filtros

Selecionar todos Adicionar Alterar Cadastrar Amortização Exportar Transações Selecionadas Exportar Recibo da Transação Cancelar

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total	14	Registro Pendente	2	Registrado	12
-------	----	-------------------	---	------------	----

Auditoria	ID do Protocolo	ID da Operação ou UTI	Tipo de Registro	Status do Registro	Data de Protocolo	Ultima Atualizacao v	ID de registro BAB	Data de Registro	Enviado Por	Natureza da operação
☐ Ver Auditoria	49C372	FER2060820TESTE0002CCA1C1	Direct	Registrado	2026-08-20 15:26:23	2026-08-20 15:26:23	TRN-20260820-54FD07	2026-08-20 15:26:23		Assignment
☐ Ver Auditoria	E323CE	FER2060820TESTE0001A3C1	Direct	Registrado	2026-08-20 14:51:00	2026-08-20 14:51:00	TRN-20260820-67D626	2026-08-20 14:51:00		Assignment
☐ Ver Auditoria	2101C6	FER2060820TESTE0002CCA1	Direct	Registrado	2026-08-20 14:49:19	2026-08-20 14:49:19	TRN-20260820-4A638F	2026-08-20 14:49:19		Amortization
☐ Ver Auditoria	7AF410	FER2060820TESTE0001A4A1	Direct	Registrado	2026-08-20 14:46:38	2026-08-20 14:46:38	TRN-20260820-8A28FF	2026-08-20 14:46:38		Amortization
☐ Ver Auditoria	AD6280	FER2060820TESTE0001A4	Direct	Registrado	2026-08-20 14:44:54	2026-08-20 14:44:54	TRN-20260820-9440D2	2026-08-20 14:44:54		Amortization
☐ Ver Auditoria	828FF9	FER2060820TESTE0001A3	Direct	Registrado	2026-08-20 14:43:29	2026-08-20 14:43:29	TRN-20260820-FD980F	2026-08-20 14:43:29		Amortization
☐ Ver Auditoria	373310	FER2060820TESTE0001A2	Direct	Registrado	2026-08-20 14:42:38	2026-08-20 14:42:38	TRN-20260820-D46F8	2026-08-20 14:42:38		Amortization
☐ Ver Auditoria	C4293D	FER2060820TESTE0001A	Direct	Registrado	2026-08-20 14:39:46	2026-08-20 14:39:46	TRN-20260820-4862A9	2026-08-20 14:39:46		Amortization
☐ Ver Auditoria	06E411	FER2060820TESTE0002CC	Direct	Registrado	2026-08-20 14:37:40	2026-08-20 14:37:40	TRN-20260820-E300D3	2026-08-20 14:37:40		Assignment
☐ Ver Auditoria	8D13F6	FER2060820TESTE0002C	Direct	Registrado	2026-08-20 14:33:24	2026-08-20 14:33:24	TRN-20260820-B21C48	2026-08-20 14:33:24		Assignment
☐ Ver Auditoria	56EF04	FER2060820TESTE00004	With price validation	Registro Pendente	2026-08-20 14:28:23	2026-08-20 14:28:23	-	-		Inclusion
☐ Ver Auditoria	21DA90	FER2060820TESTE00003	With price validation	Registro Pendente	2026-08-20 13:46:28	2026-08-20 13:46:28	-	-		Inclusion
☐ Ver Auditoria	11E458	FER2060820TESTE00002	Direct	Registrado	2026-08-20 13:44:21	2026-08-20 13:44:21	TRN-20260820-9806A7	2026-08-20 13:44:21		Inclusion
☒ Ver Auditoria	F8B814	FER2060820TESTE00001	Direct	Registrado	2026-08-20 13:33:23	2026-08-20 13:33:23	TRN-20260820-DCE064	2026-08-20 13:33:23		Inclusion

Ao clicar no botão “Amortização”, uma janela *pop-up* será exibida contendo os campos específicos para inserção do valor amortizado e das condições pactuadas.

Envios Transações Notificações 15:07:54 UTC-3 Aberto Fechar em 10:00 EN PF-ENL

Data Inicial 28/08/2025 Data final 28/08/2026 Tipo Todos Buscar Filtros

Selecionar todos Adicionar Alterar Cadastrar Amortização Exportar Transações Selecionadas Exportar Recibo da Transação Cancelar

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total	14	Registro Pendente	2	Registrado	12
-------	----	-------------------	---	------------	----

Auditoria	ID do Protocolo	ID da Operação ou UTI
☐ Ver Auditoria	49C372	FER2060820TESTE0002CCA1C1
☐ Ver Auditoria	E323CE	FER2060820TESTE0001A3C1
☐ Ver Auditoria	2101C6	FER2060820TESTE0002CCA1
☐ Ver Auditoria	7AF410	FER2060820TESTE0001A4A1
☐ Ver Auditoria	AD6280	FER2060820TESTE0001A4
☐ Ver Auditoria	828FF9	FER2060820TESTE0001A3
☐ Ver Auditoria	373310	FER2060820TESTE0001A2
☐ Ver Auditoria	C4293D	FER2060820TESTE0001A
☐ Ver Auditoria	06E411	FER2060820TESTE0002CC
☐ Ver Auditoria	8D13F6	FER2060820TESTE0002C
☐ Ver Auditoria	56EF04	FER2060820TESTE00004
☐ Ver Auditoria	21DA90	FER2060820TESTE00003
☐ Ver Auditoria	11E458	FER2060820TESTE00002
☒ Ver Auditoria	F8B814	FER2060820TESTE00001

Transação de Amortização

IDENTIFICAÇÃO BÁSICA 1

ID da Operação ou UTI * Natureza da operação *

ID ou UTI da Operação Mãe / Conectada/Cedida * Tipo de Registro *

Tipo de Instrumento * Tipo de Mercado *

Termo *

IDENTIFICAÇÃO BÁSICA 2

Data de Negociação * Data de Início/Eficácia *

Data de Vencimento * Forma de Liquidação *

Compra/Venda * Moeda de Liquidação *

Compra *

Informações das Partes

Identificação da Parte * Nome/Razão Social (Parte) *

Pais de Origem (Parte) * E-Mail (Parte) *

Contraparte Identificada (S/N) * E-Mail (Contraparte) *

Identificação da Parte Fiscal *

PARAMETRIZAÇÃO OPÇÕES E TERMO

Na parte inferior dessa janela, clique em “Salvar” para gravar as alterações. O sistema exibirá uma mensagem de confirmação e, em seguida, dará andamento ao processo.

7. Envio de Solicitação de Cancelamento

A funcionalidade de cancelamento será utilizada para submissão de pedidos de cancelamento de uma solicitação ou de um registro, conforme aplicável.

De forma semelhante à inclusão de operações (detalhada na Seção 2), os procedimentos para cancelamento seguem duas modalidades:



- Em lote (via arquivo): Utiliza-se o arquivo CSV com o campo 'Natureza da Operação' preenchido com o valor 3 (Cancelamento).
- Pela interface do sistema: Selecione o registro desejado na tela e clique no botão "Cancelar", conforme exemplificado abaixo:

Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Logado como Corretor

Envios Transações Notificações

Data inicial: 23/06/2025 Data final: 23/06/2026 Tipo: Todos

Selecionar todos Adicionar Alterar Exportar Transações Seleccionadas Exportar Recibo da Transação Cancelar

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total	100	Informação Necessária	1	Registro Pendente	23	Registrado	71	Rejeitado	5
-------	-----	-----------------------	---	-------------------	----	------------	----	-----------	---

Auditoria	UTI (Identificador Único da Transação)	Tipo de Registro	Status do Registro ^	Data de Protocolo	Última Atualização	ID de registro BAB	Data de Registro
☐ Ver Auditoria	DCEEXPPERF04522	Direto	Informação Necessária	2026-06-19 15:56:11	2026-06-22 11:48:38	-	-
☒ Ver Auditoria	DCEEXPPERF04996	Com validação de preço	Registro Pendente	2026-06-19 15:56:11	2026-06-19 15:56:11	-	-

Ao clicar em "Cancelar", o sistema exibirá uma mensagem de confirmação e, após o consentimento do usuário, o cancelamento será efetivado.

Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Logado como Corretor

Envios Transações Notificações

Data inicial: 23/06/2025 Data final: 23/06/2026 Tipo: Todos

Selecionar todos Adicionar Alterar Exportar Transações Seleccionadas Exportar Recibo da Transação Cancelar

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total	100	Informação Necessária	1	Registro Pendente	23	Registrado	71	Rejeitado	5
-------	-----	-----------------------	---	-------------------	----	------------	----	-----------	---

Auditoria	UTI (Identificador Único da Transação)	Tipo de Registro	Status do Registro ^	Data de Protocolo	Última Atualização	ID de registro BAB	Data de Registro
☐ Ver Auditoria	DCEEXPPERF04522	Direto	Informação Necessária	2026-06-19 15:56:11	2026-06-22 11:48:38	-	-
☒ Ver Auditoria	DCEEXPPERF04996	Com validação de preço	Registro Pendente	2026-06-19 15:56:11	2026-06-19 15:56:11	-	-
☐ Ver Auditoria	DCEEXPPERF04992	Com validação de preço	Registro Pendente	2026-06-19 15:56:11	2026-06-19 15:56:11	-	-

8. Envio de Resposta para Registros com Status "Informação Necessária"

O status "Informação Necessária" será aplicado em duas situações:

1. Quando uma alteração for realizada em um registro com status diferente de "Rejeitado"; ou



- Quando, durante o processo de aferição de preços praticados no mercado, o BAB precisar de mais informações sobre a operação do que as que constam no registro.

A resposta a esse status deve ser enviada exclusivamente pela interface do sistema. Para isso, acesse a página de Transações, selecione o registro desejado e clique no botão “Responder”, conforme abaixo:

Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Transacoes

Logado como (Corretor)

Envios Transacoes Notificacoes

Data inicial: 23/06/2025 Data final: 23/06/2026 Tipo: Todos

Selecione todos Adicionar Alterar **Responder** Exportar Transacoes Selecionadas Exportar Recibo da Transacao

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total 100 Informacao Necessaria 1 Registro Pendente 23 Registrado 71 Rejeitado 5

Auditoria	UTI (Identificador Único da Transação)	Tipo de Registro	Status do Registro ^	Data de Protocolo	Última Atualizacao	ID de registro BAB	Da
☒ Ver Auditoria	DCEEXPPERF04522	Direto	Informacao Necessaria	2026-06-19 15:56:11	2026-06-22 11:48:38	-	-

Ao clicar em “Responder”, uma nova janela será exibida contendo:

- Um campo de texto obrigatório para a inserção da resposta;
- O botão “Escolher Arquivo”, para inclusão de anexos (opcional); e
- Todos os campos do registro abertos para edição, permitindo a alteração de valores, caso necessário.



Na parte inferior desta janela, clique no botão “Responder” para enviar as informações. O sistema exibirá uma janela *pop-up* para confirmação da ação antes do envio definitivo.

9. Auditoria do Processo de Registro e Consulta a Informações Submetidas

A funcionalidade de Auditoria, disponível na tela de Transações para cada linha de registro, permite:

a) Histórico Cronológico de Ações: Consulta detalhada e em ordem cronológica de todas as ações realizadas pelos usuários (como inclusão, alterações solicitadas, respostas fornecidas ou cancelamentos). Também exibe as respectivas devolutivas do



sistema (solicitações de informação, rejeições por campos inválidos e status finais de protocolo, como “Registrado” ou “Registro Não Aceito”).

b) Visualização de Documentos e Comentários: Acesso a todos os documentos e comentários inseridos via interface durante o processo, sejam eles enviados pelo usuário ou como devolutiva do BAB.

Como acessar a Auditoria:

1. Selecione o protocolo ou registro de interesse na tabela;
2. Clique no botão “Ver Auditoria”.

Balcão Agrícola do Brasil
DCE System

Transacoes
Logado como fernando.sampaio@balcaoagricola.com.br (Corretor)

Envios Transacoes Notificacoes

Data inicial: 23/06/2025 Data final: 23/06/2026 Tipo: Todos

Selecionar todos Adicionar Alterar Exportar Transacoes Selecionadas Exportar Histórico da Transacao Cancelar

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO
Total 100 Informacao Necessaria 2 Registro Pendente 21 Registrado 72 Rejeitado 5

Auditoria	UTI (Identificador Único da Transação)	Tipo de Registro	Status do Registro	Data de Protocolo	Ultima Atualizacao v	ID de registro BAB	Data de Registro	Enviado Por	Natureza
Ver Auditoria	DCEEXPERF04996	Com validacao de preco	Registrado	2026-06-19 15:56:11	2026-06-23 12:03:44	TRN-20260623-D8E464	2026-06-19 15:56:11	Broker/alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br	Inclusao
Ver Auditoria	DCEEXPERF04992	Com validacao de preco	Informacao Necessaria	2026-06-19 15:56:11	2026-06-23 11:50:10	-	-	Broker/alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br	Inclusao
Ver Auditoria	DCEEXPERF04522	Direto	Informacao Necessaria	2026-06-19 15:56:11	2026-06-22 11:48:38	-	-	Broker/alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br	Inclusao
Ver Auditoria	DCEEXPERF05000	Com validacao de preco	Registrado	2026-06-19 15:56:11	2026-06-19 16:41:39	TRN-20260619-2A1482	2026-06-19 15:56:11	Broker/alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br	Inclusao
Ver Auditoria	DCEEXPSPACE003	Direto	Registrado	2026-06-19 16:06:44	2026-06-19 16:06:44	TRN-20260619-38DD187E3389	2026-06-19 16:06:44	Broker/alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br	Inclusao
Ver Auditoria	DCEEXPSPACE002	Direto	Registrado	2026-06-19 16:06:44	2026-06-19 16:06:44	TRN-20260619-30917628F903	2026-06-19 16:06:44	Broker/alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br	Inclusao
Ver Auditoria	DCEEXPSPACE001	Direto	Registrado	2026-06-19 16:06:44	2026-06-19 16:06:44	TRN-20260619-F81699D2C37	2026-06-19 16:06:44	Broker/alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br	Inclusao
Ver Auditoria	DCEEXPERF04999	Direto	Registrado	2026-06-19 15:56:11	2026-06-19 15:56:11	TRN-20260619-214D66FFA864	2026-06-19 15:56:12	Broker/alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br	Inclusao
Ver Auditoria	DCEEXPERF04998	Direto	Registrado	2026-06-19 15:56:11	2026-06-19 15:56:11	TRN-20260619-20D5D1874E08	2026-06-19 15:56:12	Broker/alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br	Inclusao

Imediatamente abaixo do registro selecionado, serão exibidas linhas detalhando cada ação do processo, além de links para a consulta dos documentos enviados. Para fechar o histórico e retornar à visualização padrão de transações, basta clicar no botão “Ocultar Auditoria”.



Balção Agrícola do Brasil

DCE System

ENPT-BR

Sair

Transacoes

Logado como fernando.sampaio@balcaoagricola.com.br (Corretor)

EnviosTransacoesNotificacoes

Data inicial23/06/2025Data final23/06/2026BuscarTodos

Selecionar todosAdicionarAlterarExportar Transacoes SelecionadasExportar Recibo da TransacaoCancelar

RESUMO DOS STATUS DE REGISTRO

Total 100Informacao Necessaria 2Registro Pendente 21Registrado 72Rejeitado 5

Auditoria	UTI (Identificador Único da Transação)	Tipo de Registro	Status do Registro	Data de Protocolo	Ultima Atualizacao v	ID de registro BAB	Data de Registro	Enviado Por	Nat	
☒	Ocultar Auditoria	DCEXPPERFO4996	Com validacao de preco	Registrado	2026-06-19 15:56:11	2026-06-23 12:03:44	TRN-20260623-D8E464	2026-06-19 15:56:11	Broker/alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br	Inclu
Quando (UTC-3)	Acao	Autor	Detalhes	Documento						
2026-06-19 15:56:12	Enviado	alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br (Broker)	Transacao enviada por alexandre.carretero+broker@balcaoagricola.com.br.	-						
2026-06-19 15:56:12	Registro Pendente	System (System)	A transacao esta com registro pendente.	-						
2026-06-23 12:01:13	Informacao Solicitada pelo Administrador	admin1 (Administrator)	informação necessária com anexo obs1 enviado	-						
2026-06-23 12:02:07	Corretor Respondeu Solicitacao de Informacoes	fernando.sampaio@balcaoagricola.com.br (Broker)	Corretor respondeu a solicitacao de informacoes. Explicacao: envio para registro com informação necessária fornecida no anexo obs2.	-						
2026-06-23 12:02:07	Registro Pendente	System (System)	A transacao voltou para registro apos resposta do corretor.	-						
2026-06-23 12:03:44	Registrado pelo Administrador	admin1 (Administrator)	Transacao registrada por acao do administrador.	-						

10. Observações Gerais

O registro de DCE no ambiente do BAB não implica liquidação da operação, acompanhamento financeiro posterior ou assunção de qualquer tipo de posição por parte do BAB. Cabe exclusivamente ao PR assegurar a exatidão das informações submetidas e acompanhar o tratamento de cada solicitação até sua conclusão definitiva.



Anexo IV – Layout CSV

Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
1	ID da Operação ou UTI	Todos	Identificador global único da operação (padrão internacional).	Alfanumérico	Obrigatório
2	Natureza da Operação	Todos	Tipo de evento regulatório reportado.	Numérico (Enum): 1=Inclusão 2=Alteração 3=Cancelamento 4=Cessão 5=Amortização	Obrigatório
3	ID ou UTI da Operação Mãe / Conectada/Cedida	Todos	Identificador global da operação mãe, conectada ou cedida, conforme aplicável.	Alfanumérico	Condicional (Obrigatório se Campo 2 = 4 ou 5; opcional se Campo 2 = 1, 2 ou 3)
4	Tipo de Registro	Todos	Fluxo de registro do contrato.	Numérico (Enum): 1=Direto 2=Com validação de preço	Obrigatório
5	Tipo de Instrumento	Todos	Classificação do instrumento financeiro.	Numérico (Enum): 1=Swaps 2=Opções 3=Termo 4=NDF	Obrigatório



Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
6	Tipo de Mercado	Todos	Tipo de mercado em que o contrato foi negociado.	Numérico (Enum): 1=OTC 2=Bolsa 3=Outro	Obrigatório
7	Data de Negociação	Todos	Data de fechamento da operação (Data de Negociação).	Data (AAAA-MM-DD)	Obrigatório
8	Data de Início/Eficácia	Todos	Data de início da apuração/dos fluxos (Data de Início/Eficácia).	Data (AAAA-MM-DD)	Obrigatório
9	Data de Vencimento	Todos	Data de liquidação/término do contrato (Data de Vencimento).	Data (AAAA-MM-DD)	Obrigatório
10	Forma de Liquidação	Todos	Forma de liquidação financeira ou contratual.	Numérico (Enum): 1=Liquidação Financeira Bilateral 2=Entrega Física 3=Liquidação Financeira via Contraparte Central	Obrigatório
11	Compra/Venda	Todos	Sentido da operação para o titular (Compra ou Venda).	Numérico (Enum): 1=Compra 2=Venda	Obrigatório



Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
12	Moeda de Liquidação	Todos	Moeda efetiva de liquidação financeira.	Alfanumérico (Código ISO 4217)	Obrigatório
13	Identificação da Parte	Todos	Identificador cadastral (CNPJ ou LEI) da instituição titular.	CNPJ (14 dígitos) ou LEI (20 caracteres)	Obrigatório
14	Nome/Razão Social (Parte)	Todos	Razão social completa da entidade titular nacional.	Alfanumérico	Obrigatório
15	País de Origem (Parte)	Todos	País de domicílio fiscal da parte informante.	Alfanumérico (Código ISO 3166-1 Alpha-2)	Obrigatório
16	E-mail (Parte)	Todos	E-mail de contato do titular.	Alfanumérico	Opcional
17	Contraparte Identificada (S/N)	Todos	Indica se a contraparte estrangeira será identificada no registro.	Booleano: 1=Sim 0=Não	Obrigatório
18	Identificação da Contraparte	Todos	Identificador internacional (LEI ou ID) da contraparte.	LEI (20 caracteres) ou ID equivalente	Condicional (Campo 17 = 1)
19	Contraparte Coligada	Todos	Indica se a contraparte pertence ao mesmo grupo econômico.	Booleano: 1=Sim 0=Não	Condicional (Campo 17 = 1)



Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
20	Nome/Razão Social (Contraparte)	Todos	Razão social completa da contraparte estrangeira.	Alfanumérico	Condicional (Campo 17 = 1)
21	País de Origem (Contraparte)	Todos	País de domicílio fiscal da contraparte.	Alfanumérico (Código ISO 3166-1 Alpha-2)	Condicional (Campo 17 = 1)
22	E-mail (Contraparte)	Todos	E-mail de contato da contraparte externa.	Alfanumérico	Opcional
23	Identificação da Parte Fiscal	Todos	Identificador cadastral do titular fiscal da operação.	CNPJ (14 dígitos)	Opcional
24	Valor Base (Notional)	Opções, Termo	Valor nocional de referência para os fluxos do contrato.	Decimal	Condicional (Campo 5 = 2 ou 3)
25	Moeda do Nocional	Opções, Termo	Moeda do valor nocional.	Alfanumérico (Código ISO 4217)	Condicional (Campo 5 = 2 ou 3)
26	Ativo Subjacente	Opções, Termo	Ativo de referência e local de listagem.	Alfanumérico	Condicional (Campo 5 = 2 ou 3)
27	Mercado de Referência	Opções, Termo	Fonte de preços neutros e auditáveis adotada (ex.: CME, B3).	Alfanumérico	Condicional (Campo 26 não estiver vazio)



Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
28	Moeda do Ativo Subjacente	Opções, Termo	Moeda de precificação do ativo de referência.	Alfanumérico (Código ISO 4217)	Condicional (Campo 26 não estiver vazio)
29	Vencimento Ativo Subjacente	Opções, Termo	Data de vencimento do ativo de referência.	Data (AAAA-MM-DD)	Condicional (Campo 26 não estiver vazio)
30	Preço / Taxa da Operação	Opções, Termo	Custo unitário, taxa fixa ou spread contratado.	Decimal	Condicional (Campo 5 = 2 ou 3)
31	Unidade de Preço	Opções, Termo	Unidade de medida do ativo precificado.	Alfanumérico	Condicional (Campo 30 estiver preenchido)
32	Tipo de Amortização	Opções, Termo	Tipo de cronograma de amortização (Bullet, Linear, Customizada).	Númerico (Enum): 1=Bullet 2=Linear 3=Customizada	Condicional (Campo 5 = 2 ou 3)
33	Valor Nominal - Perna Declarante	Swap, NDF	Valor monetário de referência associado à perna declarante.	Decimal	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
34	Moeda - Perna Declarante	Swap, NDF	Código internacional da moeda da perna declarante.	Alfanumérico (Código ISO 4217)	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)



Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
35	Preço/Taxa - Perna Declarante	Swap, NDF	Taxa seca ou spread flutuante da perna declarante.	Decimal	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
36	Unidade de Preço/Taxa - Perna Declarante	Swap, NDF	Unidade de medida da perna declarante precificada.	Alfanumérico	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
37	Tipo de Amortização - Perna Declarante	Swap, NDF	Tipo de cronograma de amortização da perna declarante.	Númérico (Enum): 1=Bullet 2=Linear 3=Customizada	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
38	Tipo de Regime - Perna Declarante	Swap, NDF	Regime fixo ou flutuante da perna declarante.	Númérico (Enum): 1=Fixo 2=Flutuante	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
39	Indexador - Perna Declarante	Swap, NDF	Indexador ou taxa de referência da perna declarante.	Alfanumérico	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
40	Valor Ncional - Perna Oposta/Saída	Swap, NDF	Valor monetário de referência associado à perna oposta/de saída.	Decimal	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)



Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
41	Moeda - Perna Oposta/Saída	Swap, NDF	Código internacional da moeda da perna oposta/de saída.	Alfanumérico (Código ISO 4217)	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
42	Taxa/Spread - Perna Oposta/Saída	Swap, NDF	Taxa seca ou spread flutuante da perna oposta/de saída.	Decimal	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
43	Unidade de Taxa/Spread - Perna Oposta/Saída	Swap, NDF	Unidade de medida da perna oposta/de saída precificada.	Alfanumérico	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
44	Tipo de Amortização - Perna Oposta/Saída	Swap, NDF	Tipo de cronograma de amortização da perna oposta/de saída.	Numérico (Enum): 1=Bullet 2=Linear 3=Customizada	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
45	Tipo de Regime - Perna Oposta/Saída	Swap, NDF	Regime fixo ou flutuante da perna oposta/de saída.	Numérico (Enum): 1=Fixo 2=Flutuante	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)
46	Indexador - Perna Oposta/Saída	Swap, NDF	Indexador ou taxa de referência da perna oposta/de saída.	Alfanumérico	Condicional (Campo 5 = 1 ou 4)



Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
47	Tipo de Opção	Opções	Natureza do direito (Call ou Put).	Numérico (Enum): 1=Compra (Call) 2=Venda (Put)	Condicional (Campo 5 = 2)
48	Estilo da Opção / Exercício	Opções	Modelo de exercício (Americana, Europeia, Asiática).	Numérico (Enum): 1=Americana 2=Europeia 3=Asiática	Condicional (Campo 5 = 2)
49	Preço de Exercício / Strike	Opções	Preço de exercício estipulado para o ativo (Strike).	Decimal	Condicional (Campo 5 = 2)
50	ESTRUTURA_KNOCK_IN	Opções	Tipo de estrutura da barreira knock-in.	Numérico (Enum): 2=UP-AND-IN 4=DOWN-AND-IN 5=N/A	Condicional (Campo 5 = 2)
51	Barreira - Knock-In	Opções	Valor da barreira de ativação (Knock-in).	Decimal	Condicional (Campo 5 = 2 e Campo 50 ≠ 5)
52	ESTRUTURA_KNOCK_OUT	Opções	Tipo de estrutura da barreira knock-out.	Numérico (Enum): 1=UP-AND-OUT 3=DOWN-AND-OUT 5=N/A	Condicional (Campo 5 = 2)
53	Barreira - Knock-Out	Opções	Valor da barreira de desativação (Knock-out).	Decimal	Condicional (Campo 5 = 2 e Campo 52 ≠ 5)



Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
54	Troca de Margem Bilateral	Todos	Aplicabilidade de chamadas de margem entre as partes.	Booleano: 1=Sim 0=Não	Obrigatório
55	Depositante de Margem	Todos	Indica qual parte deposita a margem.	Enum: 1=Parte 2=Contraparte 3=Ambas	Condicional (Campo 54 = 1)
56	Tipo de Margem Exigida	Todos	Modalidade de colateralização estruturada no contrato.	Númerico (Enum): 1=Margem de Variação (VM) 2=Margem Inicial e de Variação (IM+VM) 3=Isento	Condicional (Campo 54 = 1)
57	Tipo de Colateral Elegível	Todos	Ativos aceitos para chamadas de margem.	Númerico (Enum): 1=Caixa 2=Títulos Soberanos 3=Outros	Condicional (Campo 54 = 1)
58	Frequência de Reavaliação	Todos	Periodicidade acordada para reavaliação a mercado (mark-to-market).	Númerico (Enum): 1=Diária 2=Semanal 3=Mensal 4=Outra	Condicional (Campo 54 = 1)
59	Limite de Isenção (Threshold) - Parte	Todos	Exposição mínima para chamada obrigatória de margem (Parte).	Decimal	Condicional (Campo 55 = 1 ou 3)



Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
60	Moeda do Limite de Isenção (Threshold) - Parte	Todos	Moeda do limite de isenção (threshold) da parte.	Alfanumérico (Código ISO 4217)	Condicional (Campo 59 não estiver vazio)
61	Limite de Isenção (Threshold) - Contraparte	Todos	Exposição mínima para chamada obrigatória de margem (Contraparte).	Decimal	Condicional (Campo 55 = 2 ou 3)
62	Moeda do Limite de Isenção (Threshold) - Contraparte	Todos	Moeda do limite de isenção (threshold) da contraparte.	Alfanumérico (Código ISO 4217)	Condicional (Campo 61 não estiver vazio)
63	Taxa/Tarifa Transacional Paga	Todos	Tarifas de estruturação pagas antecipadamente.	Decimal	Opcional
64	Moeda da Taxa/Tarifa Transacional	Todos	Código ISO da moeda da tarifa/taxa transacional.	Alfanumérico (Código ISO 4217)	Condicional (Campo 63 não estiver vazio)
65	Propósito da Operação	Todos	Finalidade macroeconômica da operação (ex.: Hedge, Especulação).	Numérico (Enum): 1=Hedge 2=Arbitragem 3=Especulação	Obrigatório



Nº	Campo	Tipo de Operação	Conceito	Tipo de Dado / Domínio	Exigência
66	Informações Adicionais	Todos	Texto livre para cláusulas customizadas ou observações de suporte.	Alfanumérico: 4000 caracteres	Opcional
67	Preço/Taxa da Cessão	Todos	Preço/tarifa adicional cobrado em razão da cessão.	Decimal	Condicional (Campo 2 = 4)
68	Data de Amortização	Todos	Data em que a amortização foi negociada.	Data (AAAA-MM-DD)	Condicional (Campo 2 = 5)
69	Valor Nominal Amortizado	Todos	Valor de referência associado à amortização realizada.	Decimal	Condicional (Campo 2 = 5)
70	Preço/Taxa da Amortização	Todos	Preço unitário ou valor financeiro líquido acordado para liquidar a parcela amortizada.	Decimal	Condicional (Campo 2 = 5 e Campo 4 = 2)

Atualizações da versão

Versão	Emissão/Atualização	Atualização
1.0	04/05/2026	Primeira versão do Guia Operacional.
1.1	21/08/2026	Inclusão de operações de Cessão e Amortização, e ajuste de campos de preenchimento.