BBCE

TRANSFORMANDO ENERGIA EM INOVAÇÃO

Manual do Usuário da **Plataforma Derivativos**

BBCE – BALCÃO BRASILEIRO DE COMERCIALIZAÇÃO DE ENERGIA S.A.

Índice

1. OBJETIVO 4
2. RECURSOS TÉCNICOS 4
3. HORÁRIO DE FUNCIONAMENTO 4
4. CADASTROS 5
5. PRIMEIRO ACESSO 6
6. TELA DE LOGIN 7
7. DEFINIÇÃO DE SENHA 7
8. RECUPERAÇÃO DE SENHA 9
9. DEFINIÇÃO DE ASSINATURA ELETRÔNICA 11
10. ALTERAÇÃO DE ASSINATURA ELETRÔNICA 13
11. ASSINATURA DOS DOCUMENTOS DA PLATAFORMA 14
12. ATUALIZAÇÃO DE DOCUMENTOS E DADOS CADASTRAIS 15
13. CADASTRO DE USUÁRIOS DO PARTICIPANTE CREDENCIADO 15
14. PLATAFORMA DERIVATIVOS 17
15. LIMITE OPERACIONAL 22
16. LANÇAMENTO DE OFERTA 29
17. TÚNEL DE PREÇOS 31
18. OFERTAS 33
19. TODOS NEGÓCIOS 36
20. NEGOCIAÇÕES (OPERAÇÕES REALIZADAS NA PLATAFORMA DERIVATIVOS) 37
21. REGISTROS OU OPERAÇÕES PREVIAMENTE REALIZADAS E REGISTRO DE GARANTIA 39
22. CÁLCULO DA LIQUIDAÇÃO 45
23. CESSÃO 48
24. SUBSTITUIÇÃO 48
25. ADITAMENTO 48
26. ANTECIPAÇÃO 49
27. CANCELAMENTO 49
28. INADIMPLEMENTO ENTRE CONTRAPARTES 49
29. ATENDIMENTO 50
30. ESTRUTURAS ESPECIAIS 50
31. CONTROLE DE VERSÕES 51

1. Objetivo

O objetivo desse manual é apoiar os Usuários da Plataforma Derivativos BBCE na utilização de todos os recursos oferecidos.

Os termos, definições e siglas, no singular ou plural, com a primeira letra maiúscula e em negrito que estão presentes no presente documento, tem o significado constante do Glossário BBCE – Mercado de Derivativos, disponível no sítio eletrônico www.bbce.com.br.

2. Recursos técnicos

A Plataforma Derivativos BBCE é executada por meio de navegadores Web e está preparada para ser suportada pelos navegadores Google Chrome, Internet Explorer (a partir da versão 11), Safari e Opera. A BBCE indica o navegador Google Chrome para utilização da Plataforma Derivativos.

3. Horário de funcionamento

As negociações na Plataforma Derivativos BBCE e registro de Contratos Padronizados, Contratos Não Padronizados e Instrumentos de Constituição de Garantia ocorrem de segunda-feira a sexta-feira, das 09h às 18h, exceto nos feriados nacionais.

Fora do horário, a Plataforma Derivativos BBCE está disponível para visualização das operações e extração de relatórios.

4. Cadastros

Procedimento de Admissão do Participante Credenciado e do Assinante

Os Assinantes e os Participantes Credenciados serão autorizados a ter acesso à Plataforma Derivativos BBCE após Procedimento de Admissão do Participante Credenciado e do Assinante, conforme o caso, que consistirá na análise:

i. Comprovante de inscrição no Cadastro Nacional de Pessoa Jurídica do Ministério da Fazenda – CNPJ/MF;
ii. Não vedação em seu documento societário (estatuto social ou contrato social) de realizar operações com derivativos;
iii. Documentos dos representantes legais e/ou procuradores (Registro Geral/RG, Cadastro de Pessoa Física do Ministério da Fazenda/CPF);
iv. Documento de autorização do Órgão Regulador, conforme a natureza, ou seja, agente do mercado livre, instituição financeira e fundo de investimento;
v. Preenchimento do Questionário de Conformidade do Potencial Assinante e do Potencial Participante Credenciado.

A Autorização de Acesso, conforme o resultado da análise da respectiva documentação, atendidos os requisitos necessários e atendimento do Regulamento do Mercado.

A interação entre a BBCE e o Potencial Participante Credenciado ou Potencial Assinante, será eletrônica, não implicando no acesso à Plataforma Derivativos BBCE antes da conclusão do Procedimento de Admissão.

O Potencial Participante Credenciado e/ou Potencial Assinante não será admitido à Plataforma Derivativos BBCE no caso de descumprimento de qualquer requisito acima exposto ou ausência de documento necessário.

Ato subsequente, será solicitado treinamento por meio da ferramenta de suporte da BBCE para os Usuários.

Com a conclusão do treinamento, então, o Participante Credenciado passará a ter o status ativo na Plataforma Derivativos BBCE.

5. Primeiro Acesso

Concluído satisfatoriamente o Procedimento de Admissão, o(s) representante (s) legal (is) do Participante Credenciado ou Assinante, receberá(ão) eletronicamente a Senha Provisória, que será substituída, obrigatoriamente, pelo (s) representante (s) legal (is) em seu primeiro acesso à Plataforma Derivativos BBCE, por uma Senha de Acesso Permanente, utilizada em todos os seus acessos à Plataforma Derivativos BBCE. A Senha de Acesso Permanente será, obrigatoriamente, alterada a cada 90 (noventa) dias. A senha de acesso é pessoal e intrasferível, a BBCE não se responsabiliza pela transferência da Senha Provisória e/ou Senha de Acesso Permanente.

Os Usuários cadastrados pelo(s) representante (s) legal (is) do Participante Credenciado ou Assinante, bem como aqueles Usuários que forem cadastrados por Usuários especificamente autorizados, também receberá(ão) eletronicamente a Senha Provisória, que será substituída, obrigatoriamente, pelos respectivos novos Usuários em seu primeiro acesso à Plataforma Derivativos BBCE, por uma Senha de Acesso Permanente, utilizada em todos os seus acessos à Plataforma Derivativos BBCE. A Senha de Acesso Permanente será, obrigatoriamente, alterada a cada 90 (noventa) dias. A senha de acesso é pessoal e intrasferível, a BBCE não se responsabiliza pela transferência da Senha Provisória e/ou Senha de Acesso Permanente

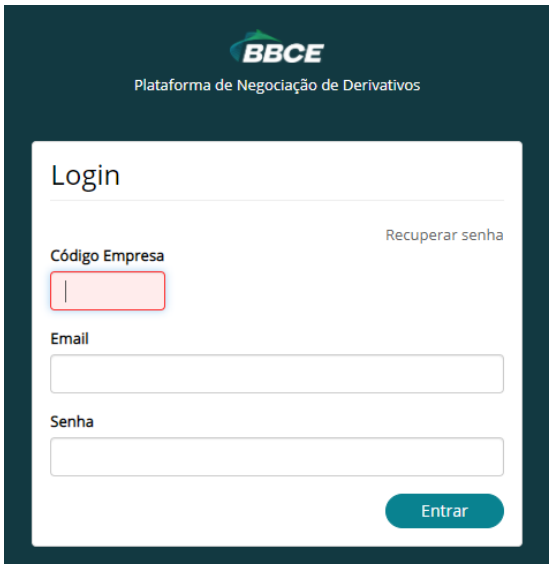
6. Tela de login

Ao acessar a URL da Plataforma Derivativos BBCE, o sistema direciona o Usuário para a tela principal de autenticação, onde ele próprio deverá informar o código empresa, e-mail e a senha. Se for o primeiro acesso, a senha que deve ser utilizada é a Senha Provisória recebida no e-mail, caso contrário, o Usuário deverá usar a Senha de Acesso Permanente

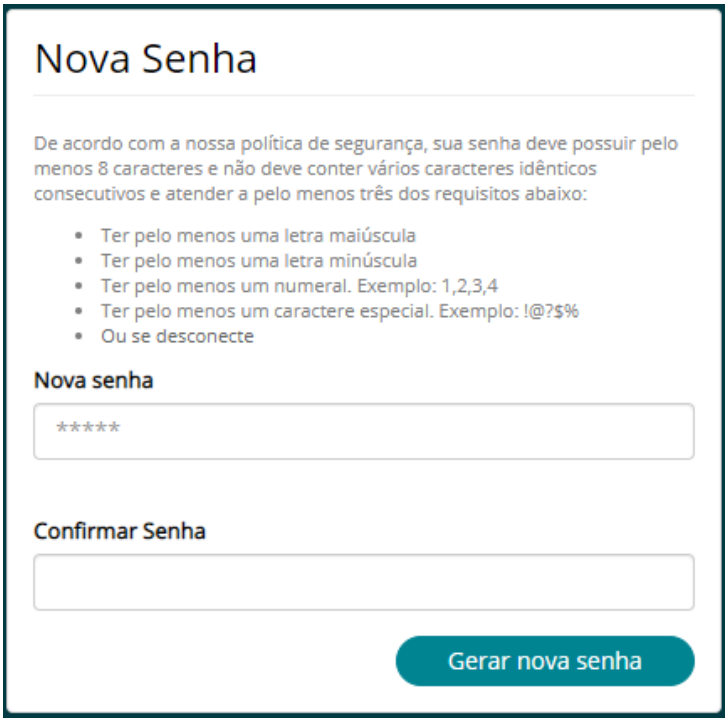
7. Definição de Senha

A Senha Provisória do Usuário corresponderá a um código alfanumérico e será enviada pela BBCE para o e- mail cadastrado do Usuário.

Após isso, o Usuário será direcionado para a Plataforma Derivativos BBCE e será permitido o acesso com a Senha Provisória.

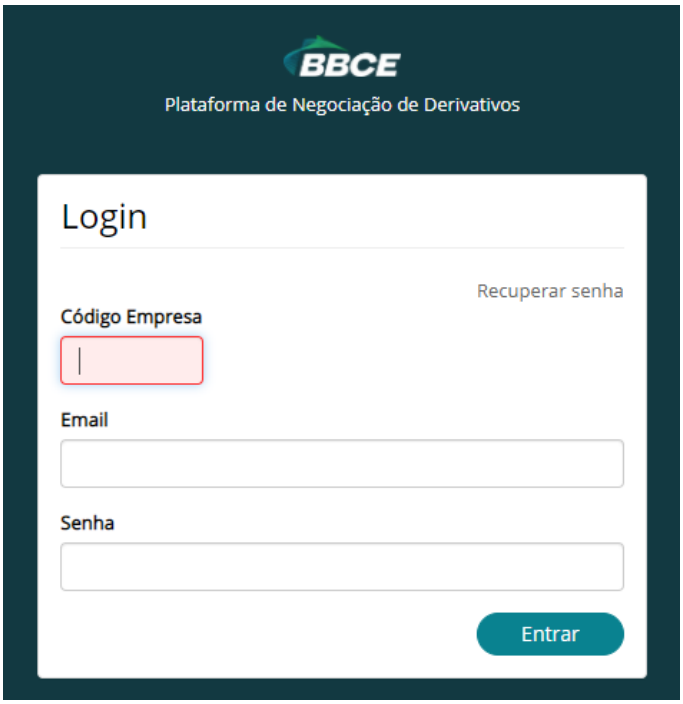


Ao digitar o e-mail cadastrado e inserir a Senha Provisória, o Usuário será obrigado a criar uma nova, esta será a Senha de Acesso Permanente.

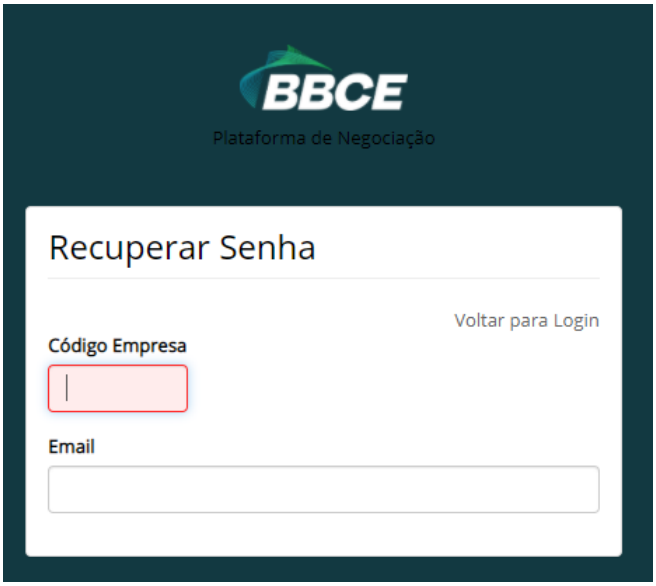


8. Recuperação de Senha

Para recuperar a senha, o Usuário deverá escolher a opção Recuperar Senha na tela de Login.



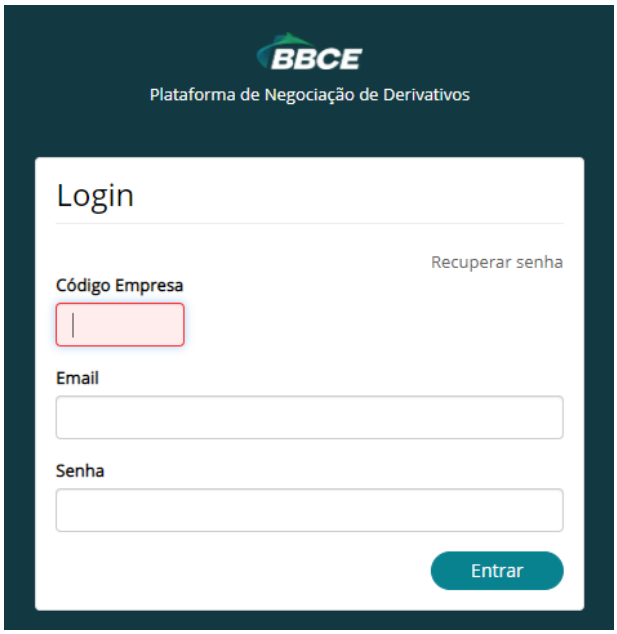
O Usuário deverá preencher Código Empresa e E-mail.



Após preencher Código Empresa e E-mail, o Usuário deverá preencher o CPF.

A Senha Provisória do Usuário corresponderá a um código alfanumérico e será enviada pela BBCE para o e-mail cadastrado do Usuário.

Após, o Usuário será direcionado para a Plataforma Derivativos BBCE e será permitido o acesso com a Senha Provisória.



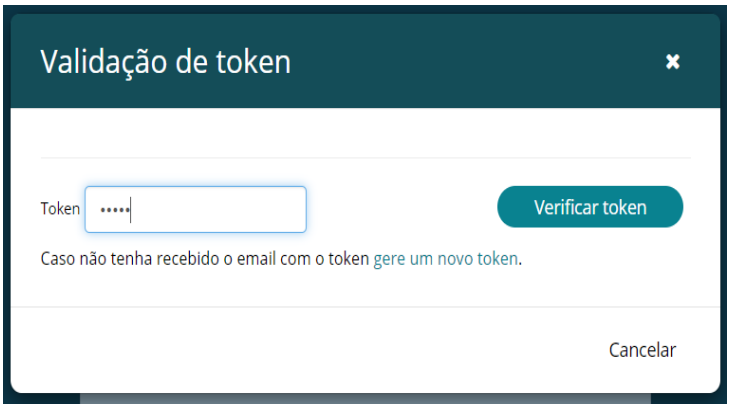
Ao digitar o e-mail cadastrado e inserir a Senha Provisória, o Usuário será obrigado a criar uma nova. Esta será a Senha de Acesso Permanente. Nesse momento, o Usuário será desbloqueado.

9. Definição de Assinatura Eletrônica

Após o Usuário definir sua nova senha, ele será direcionado para a tela de criação da Assinatura Eletrônica, que será utilizada para:

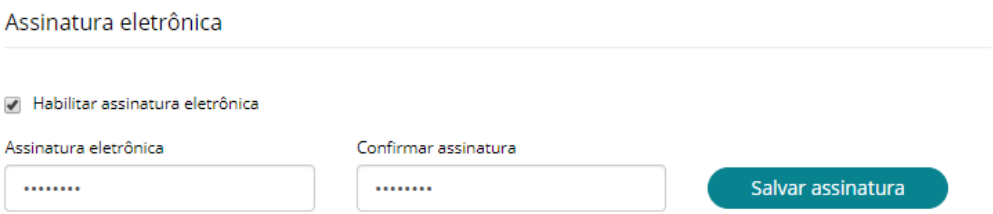
i. Aprovação da documentação do 1º acesso e demais atualizações
ii. Operação de Ofertas
iii. Registro de Contratos Padronizados e de Contratos Não Padronizados
iv. Aprovação de Limites Operacionais dos Usuários

Ao clicar em Salvar Assinatura, um *token* de validação será enviado para o e-mail do Usuário e deverá ser transcrito na tela apresentada.

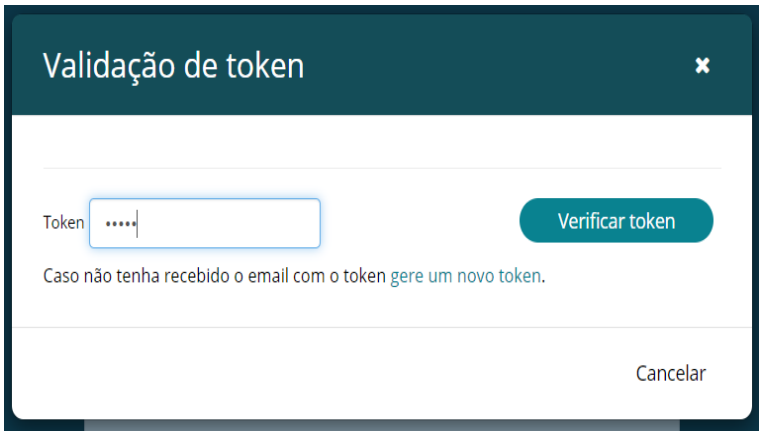


10. Alteração de Assinatura Eletrônica

Para alterar a Assinatura Eletrônica, o Usuário deverá acessar o menu Configurações e Minha Conta. Nessa tela, ele digitará a nova Assinatura Eletrônica.



Ao clicar em Salvar Assinatura, um *token* de validação será enviado para o e-mail do Usuário e deverá ser transcrito na tela apresentada.



11. Assinatura dos Documentos da Plataforma

Após a criação da assinatura eletrônica, os Usuários deverão ler os documentos da Plataforma Derivativos BBCE e assiná-los eletronicamente, confirmando a sua leitura e aceite. Somente após a assinatura eletrônica, os Usuários serão direcionados à tela inicial da Plataforma Derivativos BBCE. Caso já tenham realizado a assinatura eletrônica dos documentos anteriormente, serão direcionados diretamente à tela inicial.

Importante: É obrigatório que os representantes legais do Participante Credenciado e do Assinante acessem a Plataforma Derivativos BBCE e assinem eletronicamente os documentos, seja no momento do cadastro do Participante Credenciado ou quando ocorrer a atualização da documentação na Plataforma Derivativos BBCE. A falta de assinatura da documentação por parte dos representantes legais acarretará a impossibilidade de negociação de todos os Usuários cadastrados pelo Participante Credenciado.

Observação: Esta tela será exibida ao Usuário em seu primeiro acesso e sempre que ocorrerem alterações na documentação da Plataforma Derivativos BBCE.

12. Atualização de Documentos e Dados Cadastrais

O Participante Credenciado e o Assinante poderão atualizar os dados cadastrais, bem como realizar upload de atualização de documentos na própria Plataforma Derivativos BBCE. Realizada a atualização de dados e documentos, o status do documento ficará "Em Aprovação".

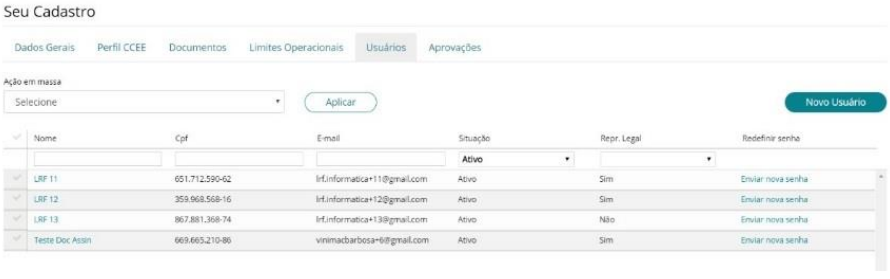
A visualização e edição dos dados pelo Usuário estarão condicionadas à prévia permissão para cada uma das funcionalidades, o que será feito pelos representantes legais do Participante Credenciado ou do Assinante, conforme o caso.

A BBCE analisará os documentos e, constatados que estão preenchidos os requisitos necessários, o status do documento será atualizado na Plataforma Derivativos BBCE para "Aprovado". Caso a análise da documentação tenha repercussão para o Mercado, a BBCE realizará, ostensivamente, o aviso aos demais Participantes Credenciados.

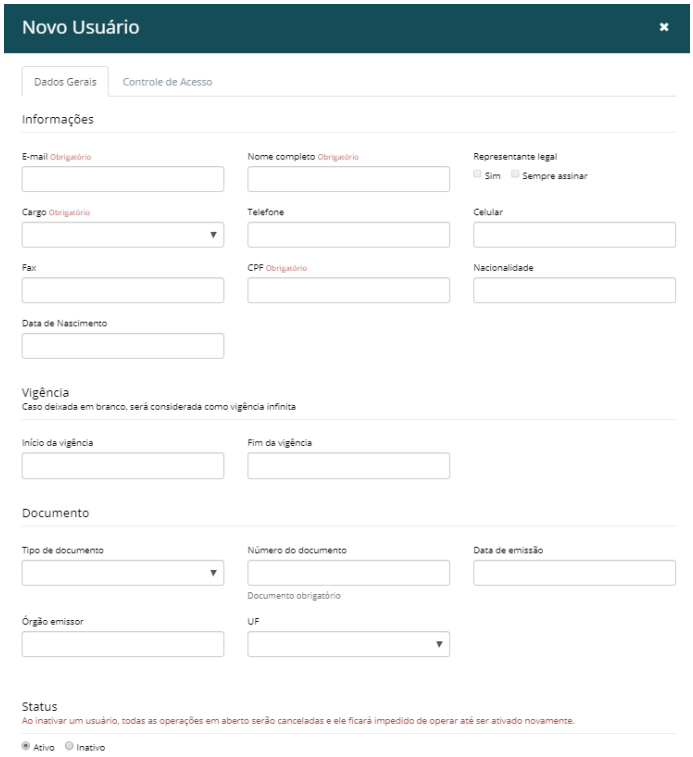
A Plataforma Derivativos BBCE dispõe de funcionalidade para confirmação de dados cadastrais cuja obrigatoriedade está prevista nos Atos Normativos – Mercado de Derivativos.

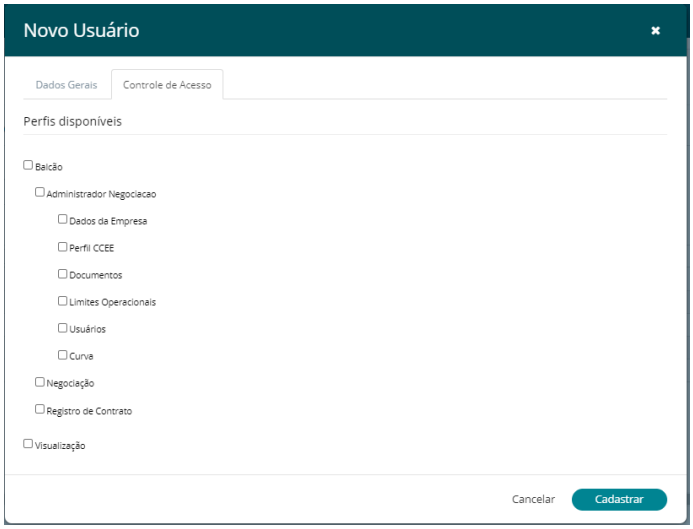
13. Cadastro de Usuários do Participante Credenciado

O Usuário que seja representante legal poderá criar Usuários (Operadores). Cada Usuário operará de acordo com o perfil que o representante legal definir.

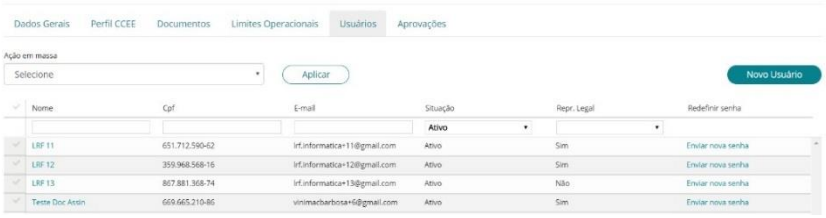


Para a inclusão de um novo Usuário, basta o Usuário clicar na opção novo Usuário e um formulário será aberto para preenchimento dos dados do Usuário, conforme apresentado abaixo.





Após a conclusão do cadastro, a tela é atualizada com o nome do novo Usuário.



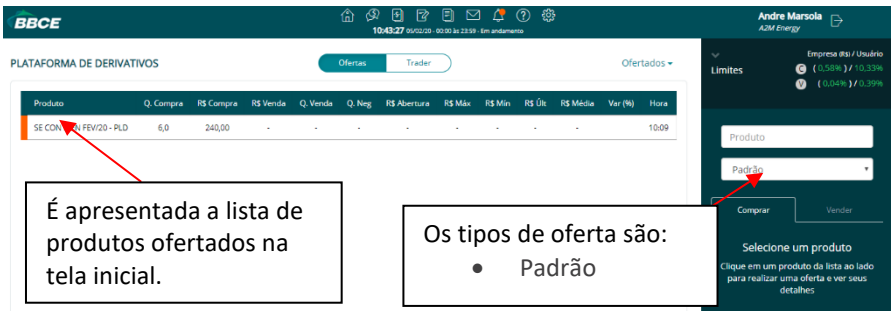
Algumas ações na tela poderão ser tomadas, tais como enviar uma nova senha para o Usuário já cadastrado. A nova senha será encaminhada para o e-mail cadastrado do Usuário.

O Usuário poderá também ativar ou inativar um determinado Usuário ou aplicar a ação em massa, selecionando outros Usuários. Lembrando que o Usuário representante legal não pode ser inativado na Plataforma Derivativos BBCE, sem que ocorram os devidos procedimentos para desligamento ou substituição.

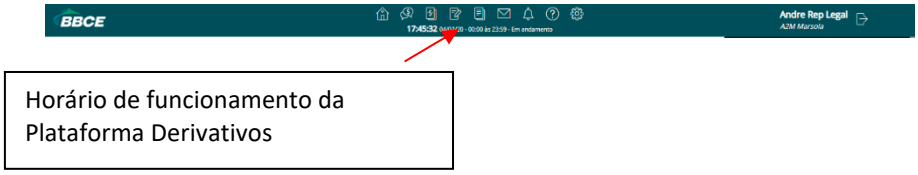
14. Plataforma Derivativos BBCE

Após a assinatura eletrônica dos documentos, o representante legal do Participante Credenciado ou Assinante será direcionado para a tela inicial da Plataforma Derivativos BBCE. No primeiro acesso não será possível ainda negociar em decorrência de algumas configurações preliminares requeridas.

A primeira tela da Plataforma Derivativos BBCE exibida logo após a autenticação, apresenta vasta opção de atalhos, o modo de visualização das Ofertas, a lista de produtos ofertados, o limite de compra e venda do Participante Credenciado e do operador e as opções de negociação.



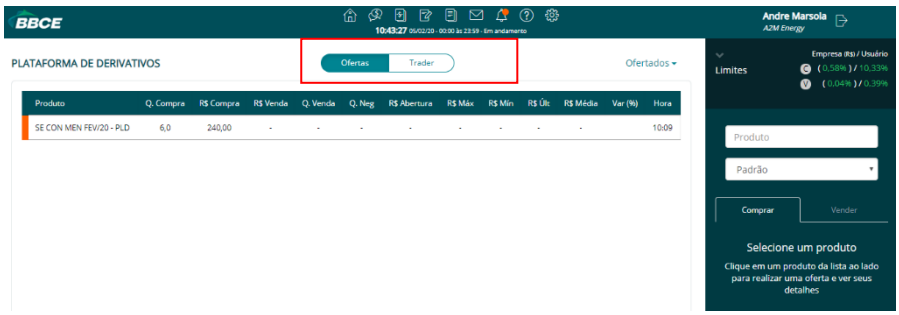
A imagem destacada logo abaixo apresenta a guia de operação da Plataforma Derivativos BBCE.



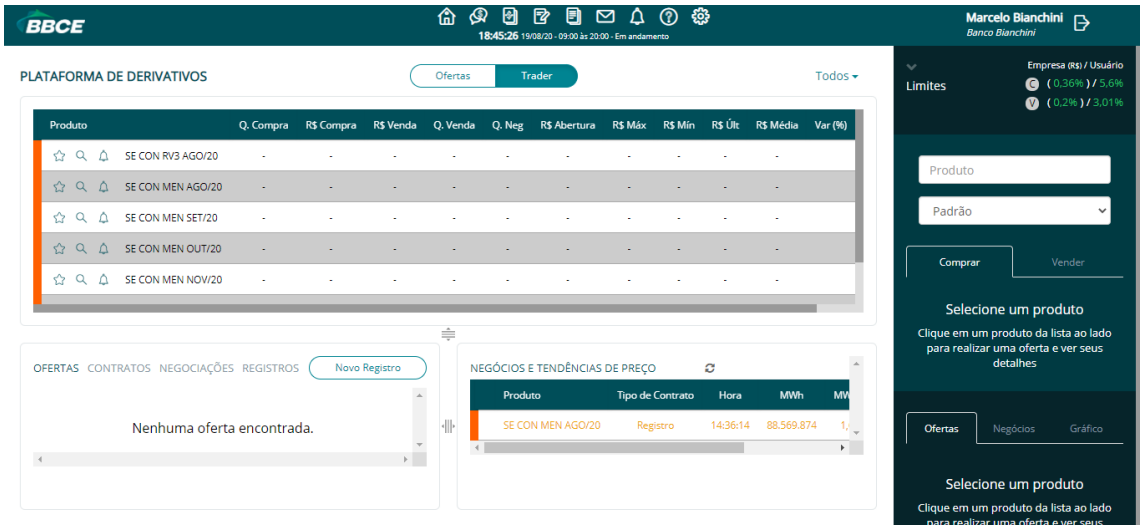
	Este ícone representa a página inicial da Plataforma Derivativos BBCE e quando clicado deve sempre apresentar a tela de operação, na visão de Ofertas ou

	Trader. A apresentação da visão está condicionada a ser exibida de acordo com o último acesso.
	Este ícone dará acesso a tela de todas as Ofertas realizadas pelo Participante Credenciado na Plataforma Derivativos BBCE de acordo com o filtro de pesquisa pré-determinado.
	Este ícone dará acesso a tela de todos os negócios realizados no período selecionado (negociações e registros), tanto do próprio Participante Credenciado, quanto de outros Participantes Credenciados.
	Este ícone dará acesso à tela de negociações, onde será possível listar todos os Contratos de Derivativos gerados após negociações na plataforma.
	Este ícone dará acesso a tela de registros, onde o Usuário ou Participante Credenciado poderá gerar registros de Contratos Padronizados, Não Padronizados e Garantias.
	Este ícone dará acesso a todos os avisos enviados na Plataforma Derivativos BBCE.
	Este ícone dará acesso a todos os alertas da Plataforma Derivativos BBCE.
	Este ícone dará acesso as principais perguntas e respostas.
	Este ícone dará acesso a área administrativa do Usuário.

A Plataforma Derivativos BBCE disponibiliza duas opções para a melhor visualização das Ofertas, são elas Ofertas e Trader:



- O modo de visualização de Ofertas (imagem acima) exibe a lista de ofertas inseridas e todas as atualizações que ocorrem em tempo real. A cada negócio ofertado, a tela é atualizada e a linha, cujo produto tenha recebido uma oferta válida, irá destacar em poucos segundos a cor verde sobre a oferta de compra ou venda.



- Na visualização Trader (imagem acima), além das informações descritas na visualização de Ofertas, concede outras informações navegáveis de forma dinâmica como: a lista de ofertas, contratos, negociações, registros e todos os negócios realizados no dia. As ações serão detalhadas na sequência do documento.

Nesta sessão é possível executar algumas ações em lote ou individualmente:

- Suspender Oferta: retira a Oferta da tela de book de Ofertas, deixando de ser visualizada pelos demais Usuários e tendo seu status alterado para "Suspensa";

- Ativar oferta: altera o status da Oferta "Suspensa" para "Aberta", voltando a ser exibida no book de ofertas e visualizada pelos demais Usuários. A Oferta volta para o book com o novo horário da ativação da oferta, ou seja, para o final da fila de Ofertas. Se a oferta não estiver dentro do túnel de preços, seu status será "Fora do Túnel" e não voltará para o book;

- Cancelar Oferta: retira permanentemente a Oferta do book de ofertas, deixando de ser visualizada pelos demais Usuários e tendo seu status alterado para "Cancelada";

- Editar Oferta: edita a Oferta com status em aberto, suspensa, fora do túnel ou atendida parcialmente, após a confirmação, é criada uma nova oferta (aberta, suspensa ou fora do túnel) e cancelada a oferta anterior ficando com o status "Cancelada por edição". Antes da finalização da edição, a Oferta antecedente continua válida e poderá ser agredida durante esse processo;

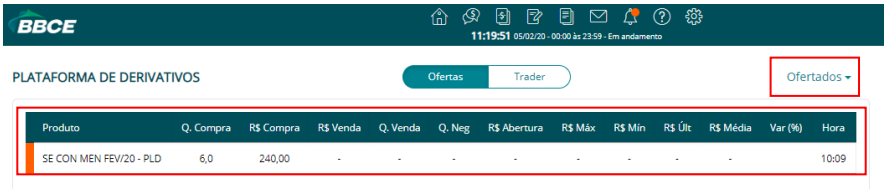
- O quadro à esquerda, na visão Trader, apresenta todas as Ofertas enviadas no dia, contratos, negociações e registros dos Contratos de Derivativos do Participante Credenciado;

- O quadro à direita, na visão Trader, apresenta todas as Operações Realizadas na Plataforma Derivativos BBCE, os negócios e tendências de preço de todas as operações do mercado no dia;

Na Plataforma Derivativos BBCE existem as opções de visualização dos produtos:

- Ofertados: lista de todos os produtos que possuam Ofertas (qualquer status) na Plataforma Derivativos BBCE.
- Favoritos: lista de todos os produtos selecionados pelo Usuário como favoritos.
- Todos: lista de todos os produtos ativos e não vencidos na Plataforma Derivativos BBCE.

Os seguintes detalhes do produto são exibidos:



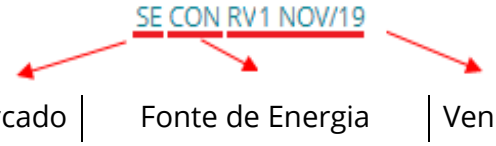
- Produto: é o nome do produto que está disponível para ser negociado;
- Q. Compra: é a quantidade de Oferta de compra de um determinado produto com o melhor preço;
- R$ Compra: é o melhor preço ofertado de compra da Energia de um determinado produto;
- Q. Venda: é a quantidade de Oferta de venda de um determinado produto com o melhor preço;
- R$ Venda: é o melhor preço ofertado de venda da Energia de um determinado produto;
- Q. Neg: é a quantidade negociada deste produto;
- R$ Abertura: é o preço de abertura de um determinado produto no início do pregão;
- R$ Máx: é o preço máximo ofertado de um determinado produto;

- R$ Min: é o preço mínimo ofertado de um determinado produto;
- R$ Útl: é o último preço negociado de um determinado produto;
- R$ Média: é o preço médio de todas as negociações de um determinado produto;
- Var (%): é a variação de preço do último negócio em relação ao preço de abertura, ou, se for o primeiro negócio de dia, em relação ao último negócio;
- Hora: é apresentada a hora em que a última Oferta foi realizada;

O código do produto é configurado da seguinte maneira:

Submercado	Fonte de Energia	Vencimento
SE – Sudeste e Centro-Oeste	CON – convencional	Semanal Mensal Trimestral Semestral Anual
SU – Sul		
NE – Nordeste		
NO – Norte		

Um exemplo da composição do produto:



Vencimentos Mensais:
AA – dois últimos dígitos do ano de referência
JAN/AA – Janeiro
FEV/AA – Fevereiro
MAR/AA – Março
ABR/AA – Abril
MAI/AA – Maio
JUN/AA – Junho
JUL/AA – Julho
AGO/AA – Agosto
SET/AA – Setembro
OUT/AA – Outubro
NOV/AA – Novembro
DEZ/AA – Dezembro

Vencimentos Agrupados:
BIM – bimestral

TRI – trimestral
SEM – semestral
ANU – anual

Os Vencimentos Agrupados irão conglobar os Vencimentos Mensais utilizando as respectivas regras. A negociação ou registro de um produto agrupado, gerará N contratos mensais.

Eventos de cessão, substituição, aditamento, cancelamento e liquidação antecipada, de um contrato que pertence a uma operação agrupada, não poderá ocorrer de forma individual. Por exemplo, uma vez cancelado um contrato referente a uma operação agrupada, os demais deverão ser cancelados.

Vencimento Semanais:
RV0

- Início: Primeiro sábado após a divulgação do primeiro PLD semanal do mês de referência
- Finaliza: Sexta-feira após divulgação do PLD semanal referente a semana subsequente (RV1)

RV1

- Início: Primeiro sábado posterior a divulgação do PLD semanal da RV00
- Finaliza: Sexta-feira após divulgação do PLD semanal referente a semana subsequente (RV2)

RV2

- Início: Primeiro sábado posterior a divulgação do PLD semanal da RV1
- Finaliza: Sexta-feira após divulgação do PLD semanal referente a semana subsequente (RV3)

RV3

- Início: Primeiro sábado posterior a divulgação do PLD semanal da RV2
- Finaliza: Sexta-feira após divulgação do PLD semanal referente a semana subsequente (RV4)

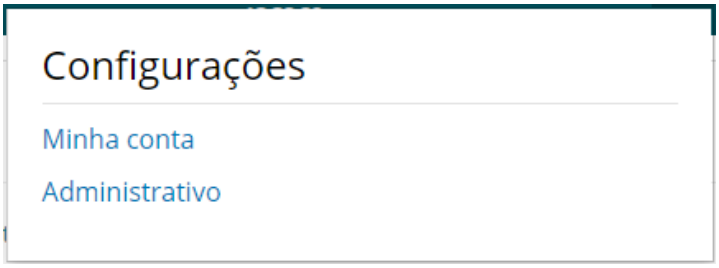
RV4

- Início: Primeiro sábado posterior a divulgação do PLD semanal da RV3
- Finaliza: Sexta-feira após divulgação do PLD semanal referente a semana do mês subsequente (RV0)
-

15. Limite Operacional

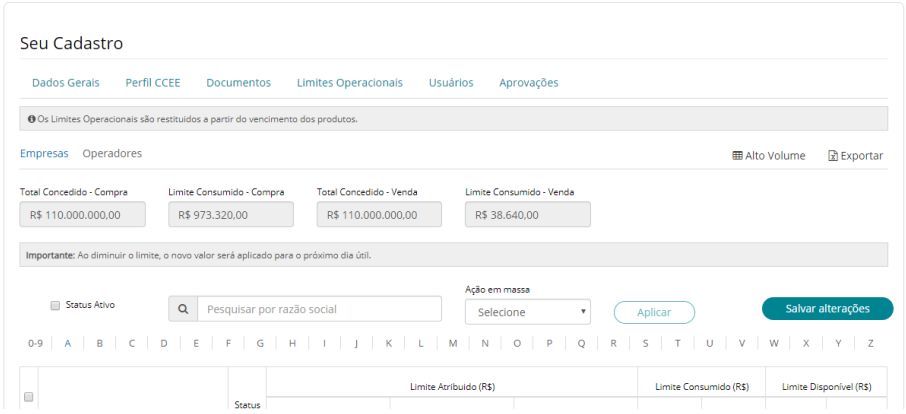
O Participante Credenciado só poderá operar no Ambiente de Negociações da Plataforma Derivativos BBCE se receber limite de uma quantidade mínima de Participantes Credenciados. Essa quantidade mínima de Participantes Credenciados é definida pela BBCE e divulgada por meio de comunicado.

Na parte superior da tela da guia de Acesso Rápido, ao clicar na engrenagem, serão exibidas as informações de "Minha Conta" e "Administrativo".



Acessando a seção "Administrativo", será exibida a tela com os dados do Participante Credenciado:

Acessando a Aba de "Limites Operacionais", será exibida a tela abaixo:



A Plataforma Derivativos BBCE disponibiliza a opção de concessão de limite para os Participantes Credenciados e Usuários. Onde para conceder o limite para os Usuários, deve ser dado limite os Participantes Credenciados inicialmente.

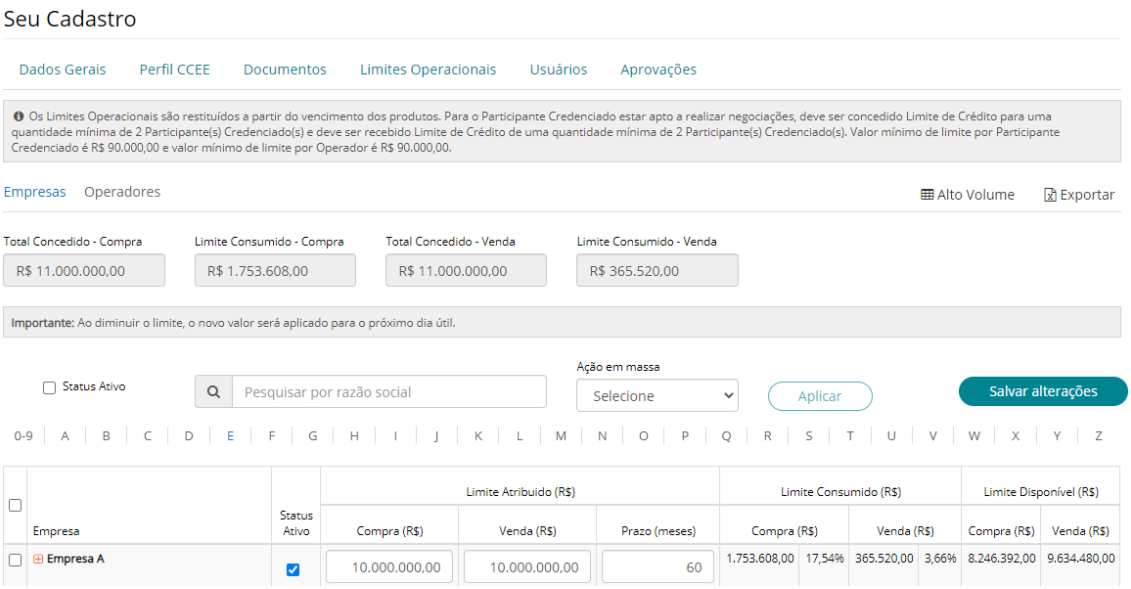
A Plataforma Derivativos BBCE disponibiliza o totalizador concedido de compra e venda e o total consumido de compra e venda.

O filtro de pesquisa também permite consultar os Participantes Credenciados usando a ferramenta de busca ou selecionando a letra inicial dos Participantes Credenciados.

15.1. Limite Operacional entre Participantes Credenciados

Para o Participante Credenciado estar apto a realizar negociações, deve ser recebido Limite Operacional para uma quantidade mínima de Participantes Credenciados. Essa quantidade mínima de Participantes Credenciados é definida pela BBCE.

O Usuário pode utilizar o filtro de pesquisa para identificar os demais Participantes Credenciados para os quais pretende conceder o Limite Operacional.



Os Limites Operacionais entre os Participantes Credenciados poderão ser estabelecidos quanto aos valores de compra/venda e quanto ao período de Contrato de Derivativos (período em meses). O prazo determina a vigência máxima (em meses) para um Contrato de Derivativo com o Participante Credenciado indicado. A concessão dos referidos limites dependerá da confirmação do status “Status Ativo”, preenchimento dos demais campos e clique no botão “Salvar Alterações”.

A somatória dos limites de compra e de venda deve respeitar o limite mínimo estipulado.

O Limite Operacional concedido pode ser aumentado ou reduzido durante a Sessão de Negociação, sendo que a alteração será refletida imediatamente.

A inativação do Limite Operacional pode ocorrer a qualquer momento durante a Sessão de Negociação, fazendo com que a Empresa fique imediatamente proibida de negociar com a contraparte.

A reativação do Limite Operacional pode ocorrer a qualquer momento durante a Sessão de Negociação, sendo que apenas será refletida a partir da abertura da próxima Sessão de Negociação.

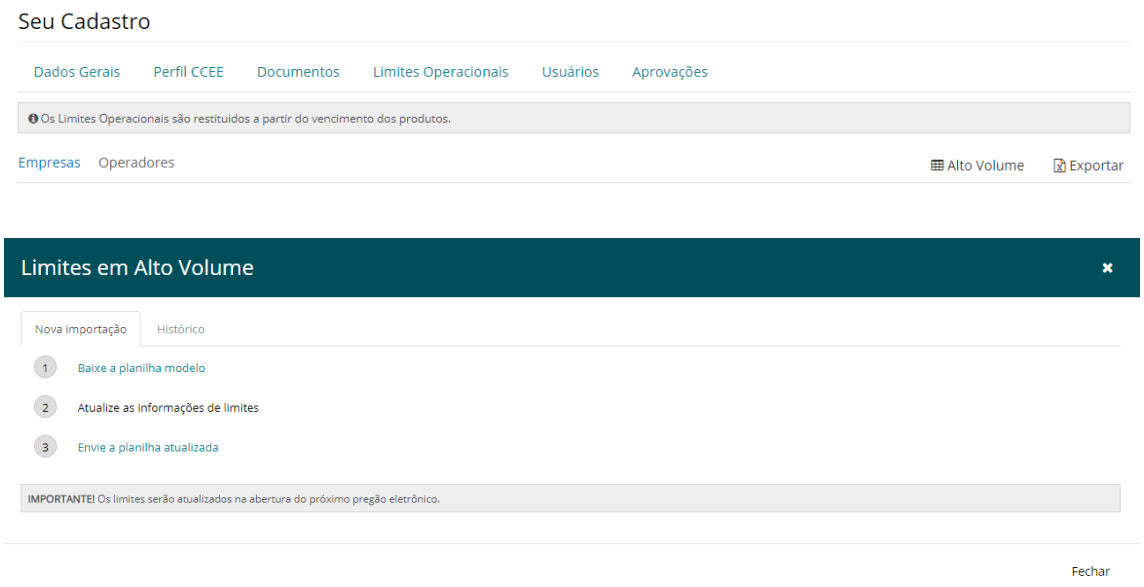
A restituição do Limite Operacional pode ocorrer em duas situações, a primeira é logo após a Liquidação e o valor da restituição equivale ao Valor de Liquidação. A segunda opção é a restituição manual, que poderá ocorrer a qualquer momento. Mesmo em caso de inadimplência, o valor da restituição continuará a ser atualizado automaticamente, cabendo as partes inativar a Contraparte Inadimplente.

O inadimplemento de um Contrato de Derivativos deverá ser informado pela Contraparte Afetada à BBCE imediatamente.

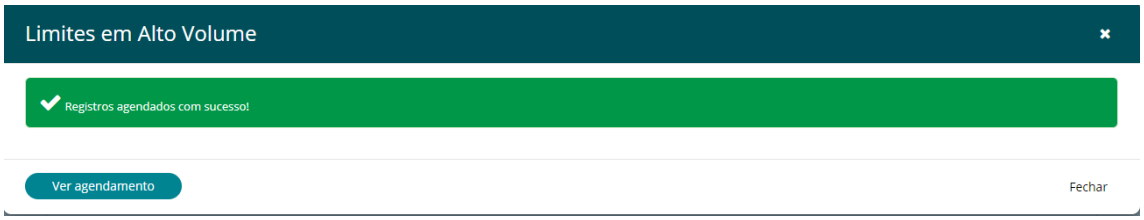
Importante: O Participante Credenciado apenas poderá operar na Plataforma Derivativos BBCE se receber limite mínimo de Participantes Credenciados. Essa quantidade mínima de Participantes Credenciados é definida pela BBCE e divulgada por meio de comunicado.

15.2. Configuração em lote de Limites Operacional entre Participantes Credenciados.

Para Participante Credenciado configurar em lote (alto volume) os limites operacionais, deverá selecionar a opção “Alto Volume” e seguir os passos do pop-up “Limites em Alto Volume”.



Após baixar e preencher a planilha modelo e enviar com sucesso, será exibida e seguinte mensagem e será possível ver o agendamento (também é possível ver o agendamento selecionando a opção "Histórico" no pop-up Limites em Alto Volume").



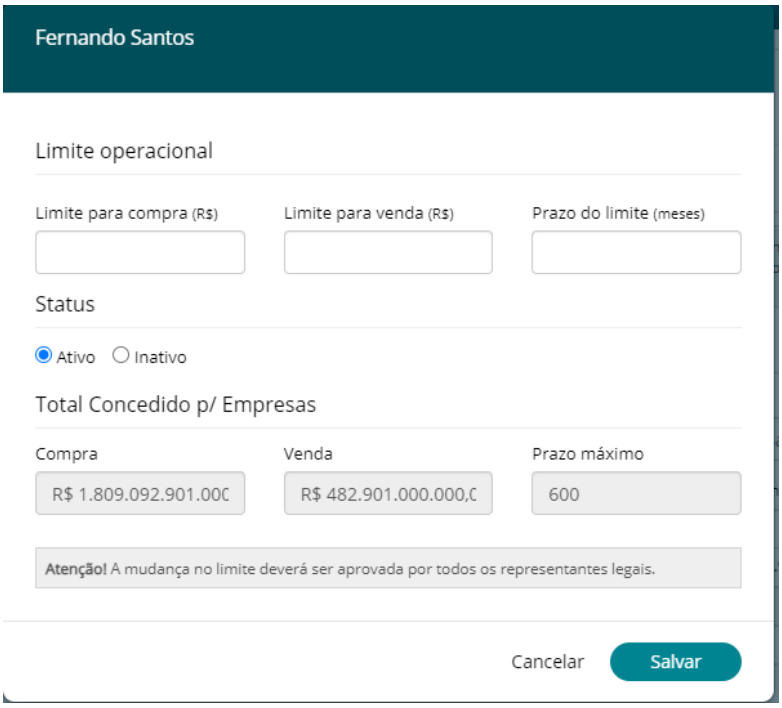
Neste grid é possível excluir agendamento, visualizar e baixar planilha. Também são exibidos os detalhes como data, hora, usuário, planilha, quantidade de contrapartes e status.

15.3. Limite Operacional para os Operadores

Após a inclusão de Limites Operacional para os demais Participantes Credenciados, o Usuário, com as permissões inerentes, poderá conceder Limite Operacional para os seus Usuários clicando no link operadores:

O campo de busca à direita da tela possibilita identificar os Usuários do Participante Credenciado que não possuem Limite Operacional concedido.

Após selecionar o nome do Usuário, será exibida uma tela para inclusão dos valores:

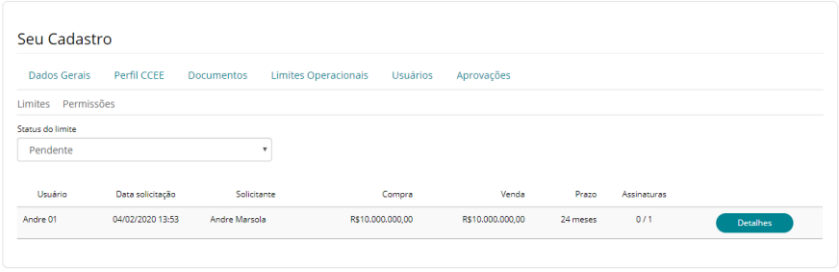


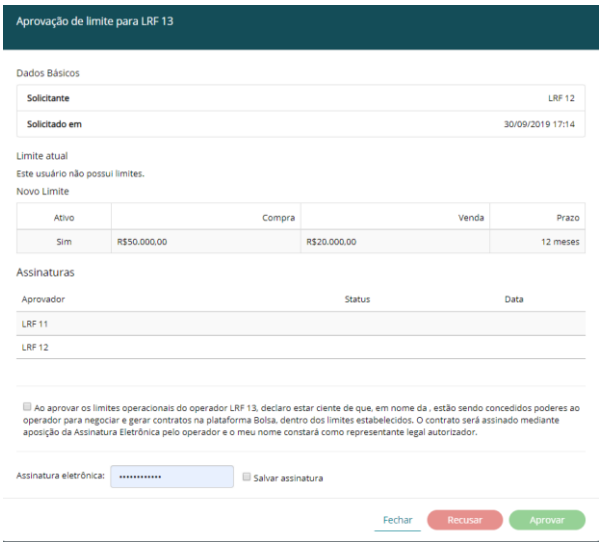
Os Limites Operacionais para os Usuários poderão ser estabelecidos quanto aos valores de compra/venda e quanto ao período de Contrato de Derivativos (período em meses). O prazo determina a vigência máxima (em meses) para um Contrato de Derivativo negociado pelo Usuário indicado.

Os Limites Operacionais para os Usuários deverão ser menores ou iguais ao Total Concedido para empresas tanto em R$ quanto em Prazo.

Após o cadastro dos valores do Limite Operacional para o Usuário, será necessário aprovar os respectivos limites concedidos.

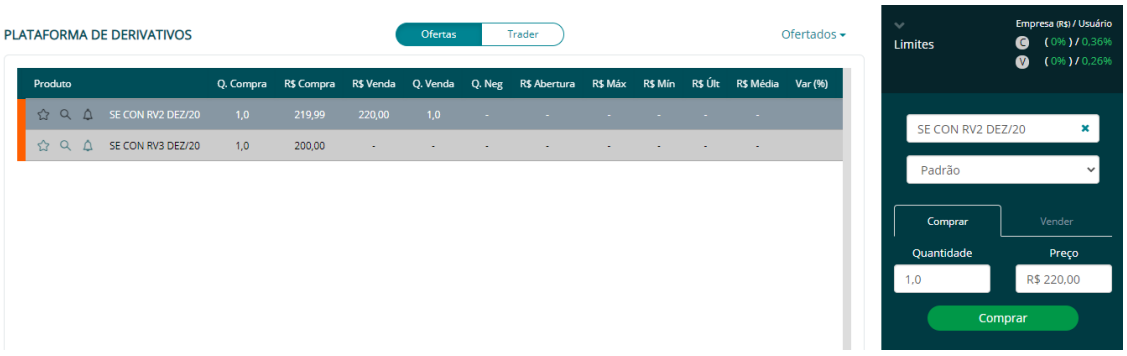
O Usuário deverá acessar a aba de "Aprovações" que exibirá a tela abaixo:





Nesta tela o Usuário que tiver perfil de representante legal deverá marcar a aprovação e incluir sua Assinatura Eletrônica para aprovar o limite cadastrado. As Ofertas inseridas na Plataforma Derivativos BBCE em nome do Participante Credenciado respeitarão os valores cadastrados como Limite Operacionais para os respectivos Usuários que inserirem a Oferta.

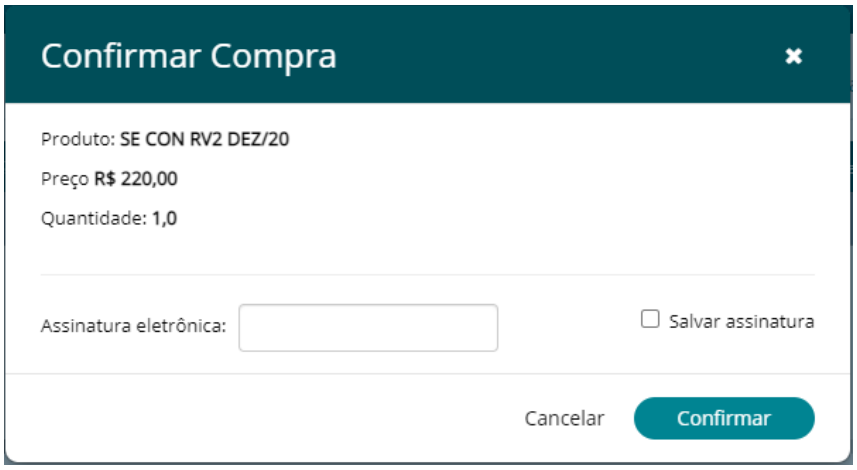
16. Lançamento de Oferta



Para inserir uma Oferta, o Usuário deve escolher um produto existente na lista de Produtos ou informar o nome do Produto. Ao informar o nome do produto, a Plataforma Derivativos BBCE inicia um filtro restringindo os produtos existentes na tela de operação, conforme imagem destacada acima.

A Plataforma Derivativos BBCE apresenta uma opção para inserir a Oferta:

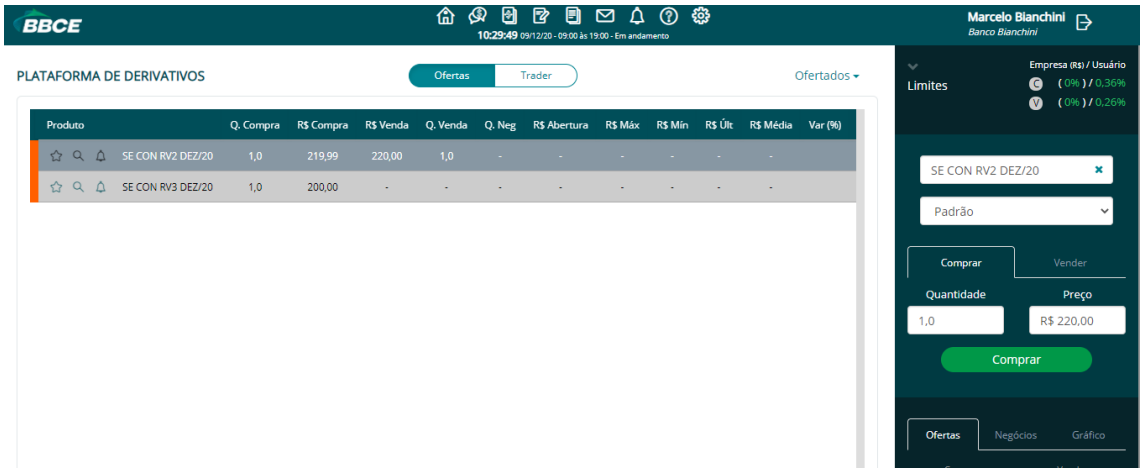
- Padrão: Oferta simples, com quantidade e preço exibidos em tempo real na Plataforma Derivativos BBCE para todos os Participantes Credenciados.



A Oferta inserida pelo Usuário pode ou não estar dentro do Túnel de Preços. Para as Ofertas que estiverem fora, o sistema aceita a Oferta, porém, não as exibirá na lista de Ofertas para outros Usuários. Essa Oferta somente ficará disponível enquanto o valor estiver dentro do Túnel de Preços durante a Sessão de Negociação. Há um lote mínimo exigido no momento da inserção da Oferta no campo quantidade de 1,00 MWm.

As Ofertas inseridas poderão ser alteradas, sendo possível modificar a quantidade ou preço.

As Ofertas inseridas poderão ser agredidas parcialmente ou em sua totalidade. No caso de uma Oferta parcial, subentende-se que ainda resta um saldo de Derivativos que pode ser negociado.



Pela Plataforma Derivativos BBCE é possível visualizar as Ofertas realizadas, os negócios fechados e o gráfico acompanhamento dos negócios.

Na guia de Ofertas, é possível visualizar a quantidade de Derivativos e preço das Ofertas de compra e venda, bem como comparar os preços lançados e não atendidos.

Na guia de Negócios, é possível verificar o histórico de negócios do produto, desde o momento do seu lançamento até o vencimento. As Operações são apresentadas a partir do mais recente até o primeiro negócio, desde que o produto foi disponibilizado para negociação.

Na guia Gráfico, é possível acompanhar a curva de negociação do produto no decorrer de todas as negociações.

17. Túnel de Preços

O Túnel de Preço é a variação admitida em relação ao preço do último negócio ou referente ao vértice da curva válido para um determinado produto, dentro de um limite percentual previamente estipulado. Esse limite é determinado sistemicamente para que no momento do lançamento da Oferta, o preço ofertado seja comparado com o preço do túnel.

O Túnel de Preço é dinâmico e se altera a cada novo negócio realizado ou cancelado.

O objetivo do Túnel de Preço é controlar a variação de preços dentro dos limites percentuais pré-definidos, de forma que seu dinamismo é aplicado considerando o preço do último negócio celebrado na Plataforma Derivativos BBCE para o produto em questão, portanto, o túnel vai se alterando a cada negócio realizado, sempre respeitando os limites estipulados pelo sistema.

Consideremos que o último negócio do produto abaixo foi:

Produto	Origem	Preço
SE CON MEN JUL/19 JUL/19 PREÇO FIXO	Compra	150,00

Os Túneis de Preço serão divulgados pela BBCE. Exemplificativamente, se cadastrados os parâmetros de variação positiva de 20% e de variação negativa de 20%, teremos a classificação das Ofertas abaixo:

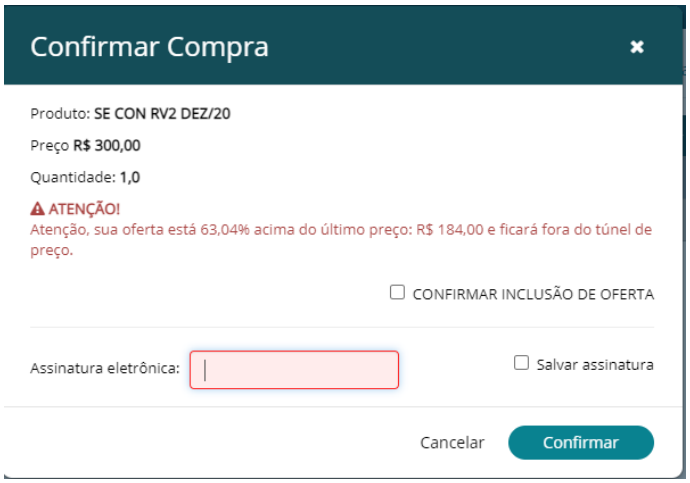
Produto	Status	Valor	Variação
SE CON MEN JUL/19 JUL/19 PREÇO FIXO	Fora do Túnel	R$ 200,00	33%
SE CON MEN JUL/19 JUL/19 PREÇO FIXO	Aberta	R$ 168,00	12%
SE CON MEN JUL/19 JUL/19 PREÇO FIXO	Aberta	R$ 140,00	-7%
SE CON MEN JUL/19 JUL/19 PREÇO FIXO	Fora do Túnel	R$ 110,00	-27%

As Ofertas que estão com variação dentro dos limites do túnel (+20% -20%) serão incluídas na Plataforma Derivativos BBCE, estarão visíveis a todos os Usuários e poderão gerar novos negócios. As Ofertas que estão com variação fora do limite serão classificadas com o status "Fora do Túnel" e ficarão em espera, sendo que não poderão ser visualizadas por outros Usuários e não estarão disponíveis para negociação naquele momento.

Como dito anteriormente, o Túnel de Preço é dinâmico e se altera constantemente, com isso, Ofertas que antes estavam "dentro" do túnel, podem ter seu status alterado para "Fora do Túnel" de acordo com a variação sofrida. Caso uma Oferta saia do Túnel de Preço, ela ficará em espera, para o caso de se tornar apta novamente, ou seja, se o Túnel de Preço variar de forma que aquela Oferta se torne válida novamente:

Consideremos que o novo negócio do produto foi celebrado com o preço abaixo:

Produto	Origem	Preço
SE CON MEN JUL/19 JUL/19 PREÇO FIXO	Compra	180,00



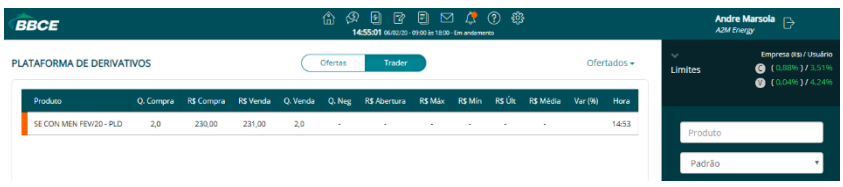
As Ofertas anteriores serão alteradas para o status abaixo:

Produto	Status	Valor	Variação
SE CON MEN JUL/19 JUL/19 PREÇO FIXO	Aberta	R$ 200,00	11%
SE CON MEN JUL/19 JUL/19 PREÇO FIXO	Aberta	R$ 168,00	-7%
SE CON MEN JUL/19 JUL/19 PREÇO FIXO	Fora do Túnel	R$ 140,00	-22%
SE CON MEN JUL/19 JUL/19 PREÇO FIXO	Fora do Túnel	R$ 110,00	-39%

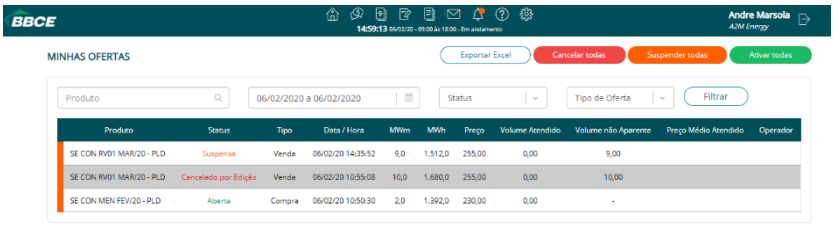
As Operações Previamente Realizadas não serão afetadas pelo Túnel de Preço, sendo todas as operações analisadas posteriormente pela Área de Supervisão e Monitoramento de Mercado (SMM).

18. Ofertas

Após a inserção de Ofertas na Plataforma Derivativos BBCE, é possível acompanhá-las por meio da tela de Ofertas, por meio de clique no botão relacionado a consulta de Ofertas, conforme destacado abaixo:



A seguir é apresentada a tela das Ofertas.



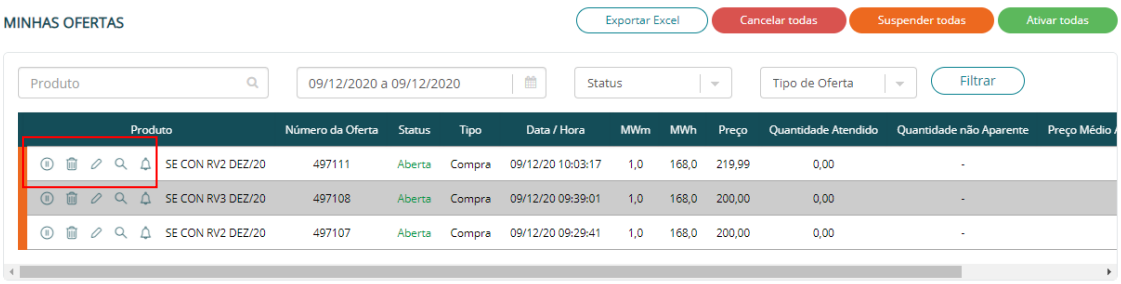
A tela apresenta as ações disponíveis, os filtros de pesquisa e o detalhamento da tela de Ofertas, conforme descrito abaixo:

- Produto – nome do produto ofertado;
- Status – status atual da Oferta;
- Tipo – tipo de operação (Compra e Venda);
- Data/Hora – data e hora da inserção da Oferta;
- MWm – quantidade de energia ofertada em MWm;
- MWh – quantidade de energia ofertada em MWh;
- R$/MWh – preço ofertado;
- Volume atendido – quantidade de Energia atendida na Oferta;
- Preço médio atendido – é a média dos preços quando são fechadas mais de 1 operação para a mesma Oferta com valores por MWh diferentes;
- Operador – nome do Usuário que inseriu a Oferta.

Nesta tela é possível executar algumas ações em lote para as Ofertas:

- Exportar Excel – permite exportar todas as ofertas para um arquivo Excel;
- Cancelar todas as Ofertas – a ação executada cancela todas as ofertas existentes na tela, com exceção das Ofertas já canceladas;
- Suspender todas as Ofertas – a ação executada suspende todas as ofertas existentes na tela, com exceção das ofertas já suspensas;
- Ativar todas as Ofertas – a ação executada ativa todas as ofertas existentes na tela, com exceção das Ofertas já ativas ou canceladas.

A partir da Oferta, também é possível executar individualmente as ações:



- Suspender: retira a Oferta da tela do book de ofertas, deixando de ser visualizada pelos demais Usuários e tendo seu status alterado para "Suspensa";
- Ativar: altera o status da Oferta "Suspensa" para "Aberta", voltando a ser exibida no book de ofertas e visualizada pelos demais Usuários. A Oferta volta para o book com o novo horário da ativação da Oferta, ou seja, para o final da fila de Ofertas. Se a Oferta não estiver dentro do Túnel de Preços, seu status será "Fora do Túnel" e não voltará para o book;
- Cancelar: retira definitivamente a Oferta do book de Ofertas, deixando de ser visualizada pelos demais Usuários e tendo seu status alterado para "Cancelada";
- Editar: edita a Oferta com status em aberto, suspensa, fora do túnel ou atendida parcialmente, após a confirmação, é criada uma nova oferta (aberta, suspensa ou fora do túnel) e cancelada a oferta anterior ficando com o status "Cancelada por edição". Antes da finalização da edição, a Oferta antecedente continua válida e poderá ser agredida durante esse processo;
- Detalhes: exibe as informações da Oferta cadastrada.
- Alertas: cadastra alertas para este produto com os parâmetros informados.

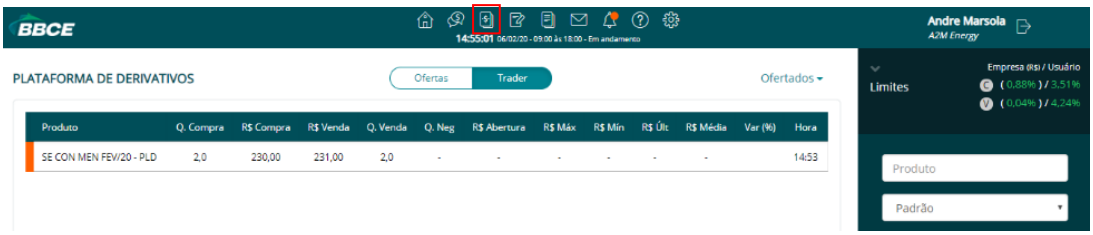
Lista de Status das Ofertas:

- Aberta: oferta inserida ou ativada pelo Usuário dentro do Túnel de Preços, a qual não foi agredida (ou agrediu), cancelada, editada ou suspensa (status somente exibido no mesmo dia da inserção da Oferta);
- Expirado: oferta aberta, suspensa ou fora do túnel, após o dia da inserção da Oferta;
- Cancelado: oferta cancelada pelo Usuário ou BBCE;
- Atendido: oferta que agrediu ou foi agredida totalmente por outra(s) Oferta(s);
- Atendido Parcialmente: oferta que agrediu ou foi agredida parcialmente por outra(s) Oferta(s) (status somente exibido no mesmo dia da inserção da Oferta);
- Executado Parcialmente: oferta que agrediu ou foi agredida parcialmente por outra(s) Oferta(s) (status somente exibido após o dia da inserção da Oferta);

- Suspensa: Oferta suspensa pelo Usuário (status somente exibido no mesmo dia da inserção da Oferta);
- Cancelado por Edição: oferta que sofreu edição;
- Fora do Túnel: oferta inserida fora do Túnel de Preços (status somente exibido no mesmo dia da inserção da Oferta);

19. Todos Negócios

Ao clicar no ícone de negócio da guia de acesso rápido, será exibida a tela com todos as negociações e registros da Plataforma Derivativos BBCE.



A seguir é apresentada a tela de todos negócios.

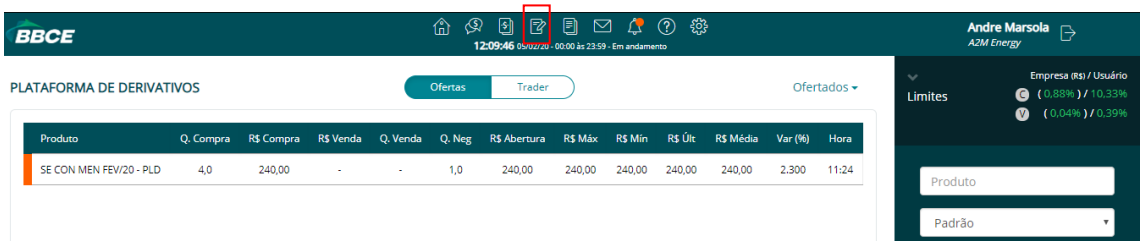
Nesta tela é possível visualizar o detalhamento de todas as negociações e registros, abaixo é apresentado a descrição de cada informação apresentada na tela acima.

- Produto – Nome do produto negociado
- Produto Agrupador – Nome do produto agrupador
- Tipo de Contrato – Negócio ou Registro
- Data/Hora – Data e hora do registro do Contrato de Derivativos
- MWm – Volume de Energia contratada em MWm
- MWh – Volume de Energia contratada em MWh

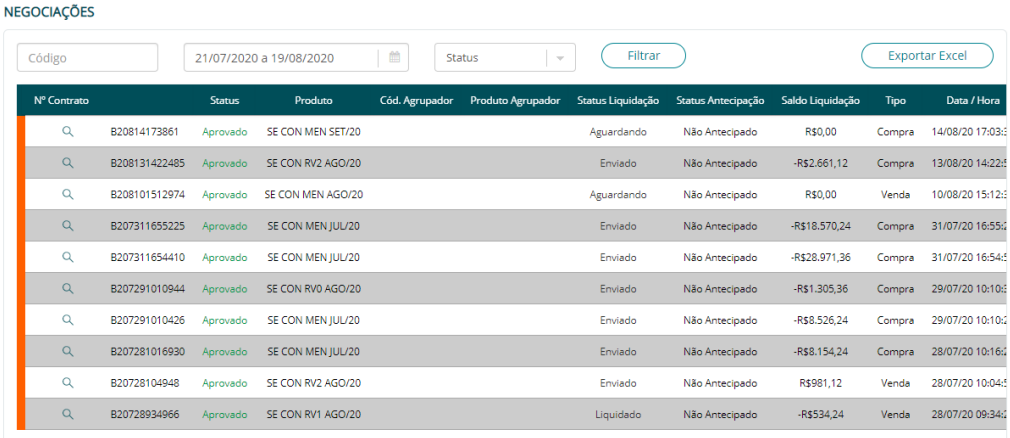
- Preço – Preço do Contrato de Derivativos
- Tend. Neg – direção do ataque das operações realizadas (negociações)
- Se a Oferta de Compra foi agredida, é apresentado a direção de venda
- Se a Oferta de Venda foi agredida, é apresentado a direção de compra
- Se registro, é exibido em branco

20. Negociações (Operações Realizadas na Plataforma Derivativos BBCE)

Ao clicar no ícone de negociações da guia de acesso rápido será exibida a tela com os Contratos de Derivativos do Participante Credenciado fechados na Plataforma Derivativos BBCE:

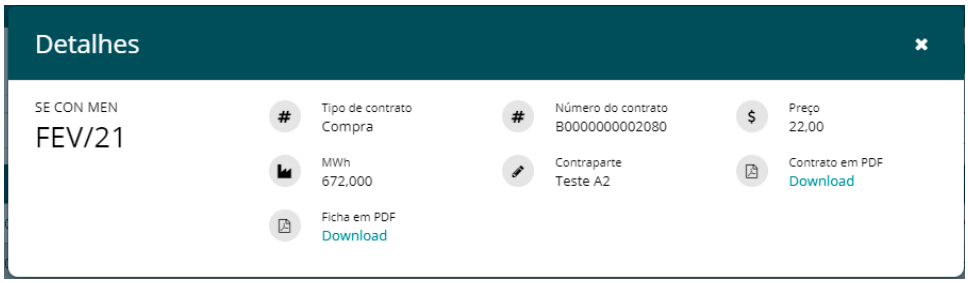


A seguir é apresentada a tela de “negociações”, nesta tela é apresentada a lista de todos os contratos gerados após negociações na plataforma. De acordo com o filtro de pesquisa, é possível localizar todos os contratos desejados.



Nº Contrato	Status	Produto	Cód. Agrupador	Produto Agrupador	Status Liquidação	Status Antecipação	Saldo Liquidação	Tipo	Data / Hora
B20814173861	Aprovado	SE CON MEN SET/20			Aguardando	Não Antecipado	R$0,00	Compra	14/08/20 17:03:
B20813422485	Aprovado	SE CON RV2 AGO/20			Enviado	Não Antecipado	-R$2.661,12	Compra	13/08/20 14:22:
B20810512974	Aprovado	SE CON MEN AGO/20			Aguardando	Não Antecipado	R$0,00	Venda	10/08/20 15:12:
B20731655225	Aprovado	SE CON MEN JUL/20			Enviado	Não Antecipado	-R$18.570,24	Compra	31/07/20 16:55:
B20731654410	Aprovado	SE CON MEN JUL/20			Enviado	Não Antecipado	-R$28.971,36	Compra	31/07/20 16:54:
B20729010944	Aprovado	SE CON RV0 AGO/20			Enviado	Não Antecipado	-R$1.305,36	Compra	29/07/20 10:10:
B20729010426	Aprovado	SE CON MEN JUL/20			Enviado	Não Antecipado	-R$8.526,24	Compra	29/07/20 10:10:
B20728016930	Aprovado	SE CON MEN JUL/20			Enviado	Não Antecipado	-R$8.154,24	Compra	28/07/20 10:16:
B20728104948	Aprovado	SE CON RV2 AGO/20			Enviado	Não Antecipado	R$981,12	Venda	28/07/20 10:04:
B20728934966	Aprovado	SE CON RV1 AGO/20			Liquidado	Não Antecipado	-R$534,24	Venda	28/07/20 09:34:

Nesta tela é possível visualizar o detalhamento do Contrato de Derivativos, inclusive filtrar os contratos usando o código, o período e / ou o seu status.

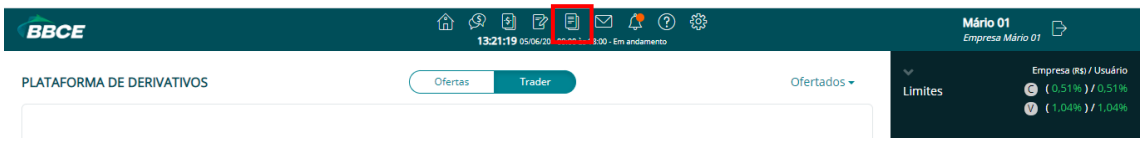


Ao clicar no ícone de detalhes será exibida uma tela com as informações do Contrato de Derivativos, um link para download do contrato no formato "PDF" e um link para download da ficha de liquidação (se disponível) no formato "PDF".

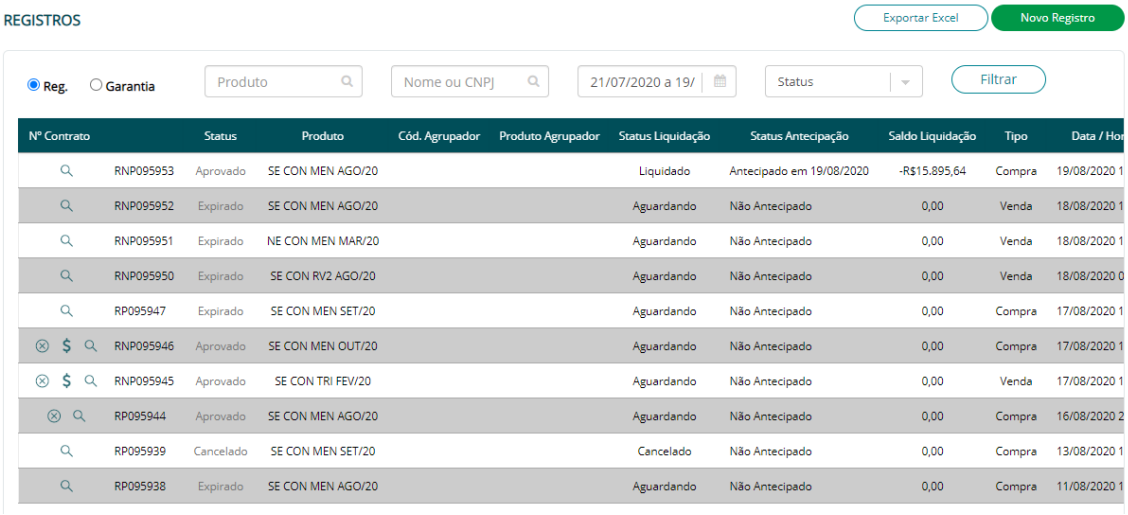
- Nº Contrato – número do Contrato de Derivativos registrado;
- Status – status do andamento do Contrato de Derivativos;
- Produto – nome do produto negociado;
- Cód. Agrupador – código do agrupamento negociado;
- Produto Agrupador – nome do produto agrupado;
- Status da Liquidação – Status atual da liquidação;
- Status Antecipação – Indica se houve antecipação;
- Saldo da Liquidação – Saldo após a liquidação;
- Tipo – tipo de transação realizada na operação (compra e venda);
- Data/Hora – Data e hora do registro do Contrato de Derivativos;
- MWm – Quantidade de Energia contratada em MWm;
- MWh – Quantidade de Energia contratada em MWh;
- Preço – Preço do Contrato de Derivativos;
- Contraparte – Nome da Contraparte cujo Contrato de Derivativos foi registrado;
- Conta C. – número conta da Contraparte na BBCE;
- CNPJ – CNPJ da Contraparte que está realizando o negócio;
- Banco – nome do banco da Contraparte;
- Agência – número da agência da Contraparte no banco;
- Conta – número da conta da Contraparte no banco;
- Operador – Nome do Usuário que submeteu o Contrato de Derivativos a registro;
- Canc. Solic. Por. – Usuário responsável pela solicitação de cancelamento;
- Canc. Aprovado Por – Usuário responsável pela aprovação do cancelamento do Contrato de Derivativos.

21. Registros ou Operações Previamente Realizadas e Registro de Garantia

Ao clicar no ícone de registros da guia de acesso rápido será exibida a tela com os registros dos Contratos de Derivativos do Participante Credenciado:



A seguir é apresentada a tela de Registros dos Contratos Padronizados, Contratos Não Padronizados e as Garantias, onde é possível exportar os dados para Excel e realizar um novo registro.



Na imagem acima, são apresentadas também as ações existentes em cada registro;

- Cancelar – cancela o registro de um contrato com ou sem a aprovação da Contraparte, alterando o status de "Aprovado"/"Aprovar", respectivamente, para "Cancelado", observando as seguintes regras abaixo.

Conforme previsto nos Atos Normativos BBCE – Mercado de Derivativos, é possível solicitar o cancelamento até 3 (três) dias corridos após o registro do contrato, conforme segue:

  - A Parte cancelar seu próprio lançamento de registro de um Contrato de Derivativos antes da aprovação da Contraparte, mediante justificativa; e

- A Parte solicitar cancelamento do registro de um Contrato de Derivativos após a aprovação da Contraparte, mediante justificativa, sendo que a Contraparte terá que aprovar o cancelamento do contrato dentro do prazo estabelecido para cancelamento.

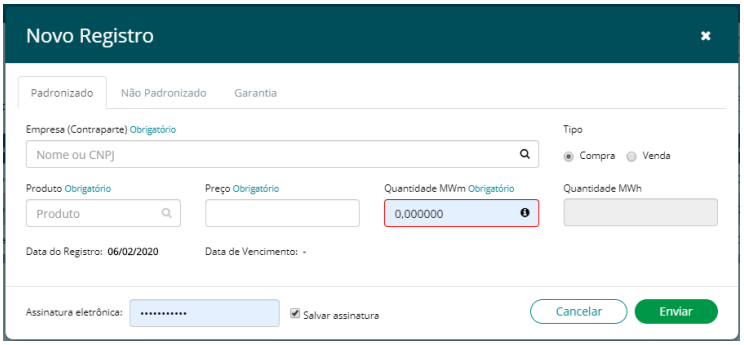
- Detalhes – exibe as informações do registro
- Nº Contrato – Número do Contrato de Derivativos registrado
- Status – Possíveis status do registro ou Operações Previamente Realizadas:
  - Aprovar
  - Aprovado
  - Aguardando cancelamento
  - Cancelado
  - Processado
- Produto – nome do produto registrado
- Cód. Agrupador – código do agrupamento negociado;
- Produto Agrupador – nome do produto agrupado;
- Status Liquidação – status da liquidação do registro, sendo possível, os seguintes status:
  - Aguardando
  - Liquidado
  - Inadimplente
  - Enviado
  - Cancelado
- Status Antecipação – Indica se houve antecipação;
- Saldo Liquidação – volume financeiro da liquidação;
- Tipo – tipo de transação realizada na operação (compra e venda);
- Data Hora – Data e hora do registro;
- MWm – volume de Energia registrado, em MWm. O volume em MWm é registrado com 6 (seis) casas decimais
- MWh – volume de Energia registrado. O volume em MWh é registrado com 3 (três) casas decimais
- Preço – preço registrado
- Contraparte – Nome da Contraparte do registro

- Conta C. – número conta da Contraparte na BBCE;
- CNPJ – CNPJ da Contraparte que está realizando o negócio;
- Banco – nome do banco da Contraparte;
- Agência – número da agência da Contraparte no banco;
- Conta – número da conta da Contraparte no banco;
- Operador – Nome do Usuário que submeteu o Contrato de Derivativos a registro;
- Canc. Solic. Por. – Usuário responsável pela solicitação de cancelamento;
- Canc. Aprovado Por – Usuário responsável pela aprovação do cancelamento do Contrato de Derivativos.
- Tipo Registro – Tipo do registro, sendo possível
    - Padronizado
    - Não padronizado

Caso o Usuário deseje criar um novo registro (Operação Previamente Realizada) deverá clicar no botão Novo Registro (no relatório de registros ou não Visão Trader) que será exibida uma tela para escolha do tipo de registro desejável:

21.2. Registro Padronizado

Registro de uma Operação Previamente Realizada, utilizando os produtos padronizados da Plataforma Derivativos BBCE, sendo possível gerar um Contrato de Derivativos com base no CGD BBCE e permitindo à BBCE ser o Agente de Cálculo da negociação no momento da Liquidação:

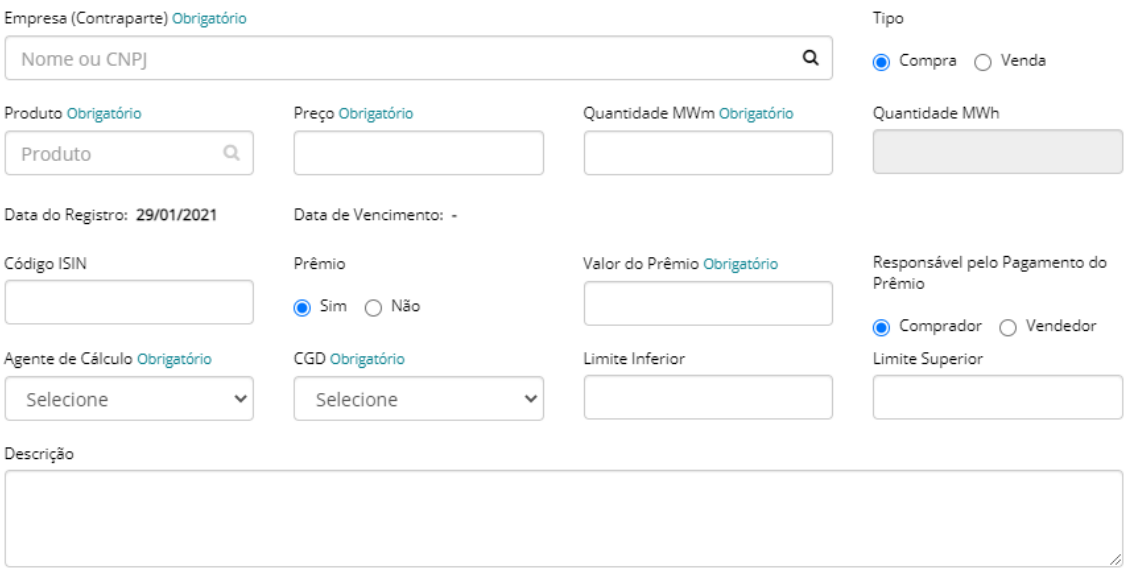


- Contraparte – Nome do Participante Credenciado que está disponibilizando o Contrato Padronizado para registro;
- Tipo – Tipo da operação (compra ou venda)
- Produto – Nome do produto que está sendo negociado

- Preço – Preço negociado para registro
- Quantidade MWm – volume de Energia registrado, em MWm. O volume em MWm é registrado com 6 (seis) casas decimais
- Quantidade MWh – volume de Energia registrado. O volume em MWh é registrado com 3 (três) casas decimais
- Data do registro – data do registro do Contrato Padronizado. Essa data sempre será igual à data da inclusão do registro no sistema, sendo proibido o registro retroativo ou com prazo futuro.
- Data de Vencimento – data de vencimento do Contrato Padronizado, o vencimento corresponde a data de vencimento do produto.
- Assinatura Eletrônica – Assinatura Eletrônica para validação do registro do Contrato Padronizado

21.3. Registro Não Padronizado

Registro de uma Operação Previamente Realizada com Contrato Não Padronizado, isto é, utilizando um produto personalizado entre as Contrapartes, não funcionando a BBCE, neste caso, como Agente de Cálculo:



As partes do Contrato Não Padronizado deverão informar até o último dia útil do mês à BBCE o valor atualizado do MTM (Mark to Market ou Marcação a Mercado) por meio do e-mail operacoes@bbce.com.br. A ausência da informação no prazo estabelecido será considerada falta regulamentar do Participante Credenciado e estará sujeito a penalidades, conforme definido no Art. 47 do Regulamento Processual da Estrutura de Supervisão e Monitoramento de Mercado.

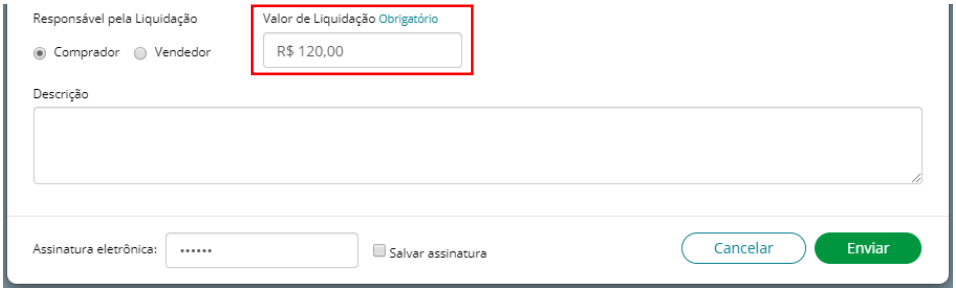
Abaixo será detalhado todos os campos da tela de registro:

- Contraparte – Nome do Participante Credenciado que está disponibilizando o contrato para registro (Contrato Não Padronizado);
- Tipo – Tipo da operação (compra ou venda);
- Produto – Nome do produto que está sendo negociado;
- Preço – preço de registro do contrato não padronizado;
- Quantidade MWm – volume de Energia registrado, em MWm. O volume em MWm é registrado com 6 (seis) casas decimais;
- Quantidade MWh – volume de Energia registrado. O volume em MWh é registrado com 3 (três) casas decimais;
- Data do registro – data do registro do Contrato Não Padronizado. Essa data sempre será igual à data da inclusão do registro no sistema, sendo proibido o registro retroativo ou com prazo futuro.
- Data de Vencimento – data de vencimento do Contrato Não Padronizado. O vencimento corresponde a data de vencimento do produto.
- Código ISIN – International Securities Identification Number significa o código internacional de um ativo estabelecido para padronização de papeis, inclusive de Contratos Não Padronizados (se não houver código, o campo não deve ser preenchido);
- Prêmio – as opções são Sim ou Não;
- Valor do prêmio – valor do prêmio a ser pago caso o campo "Prêmio" seja preenchido com "Sim";
- Responsável pelo Pagamento do Prêmio – identificação do responsável pelo prêmio (comprador ou vendedor);
- Agente de Cálculo – é a figura responsável pelo cálculo do Contrato Não Padronizado; – as opções são: Comprador, Vendedor ou Ambos;
- CGD – é o contrato global de derivativos. As opções são: Próprio, acordado entre as Contrapartes, ou Padrão BBCE;
    - Para CGD Próprio, há a possibilidade de upload;
- Limite inferior – valor do limite inferior;
- Limite superior – valor do limite superior;
- Descrição – campo livre de preenchimento.

21.4. Informar valor de Liquidação do Registro Não Padronizado

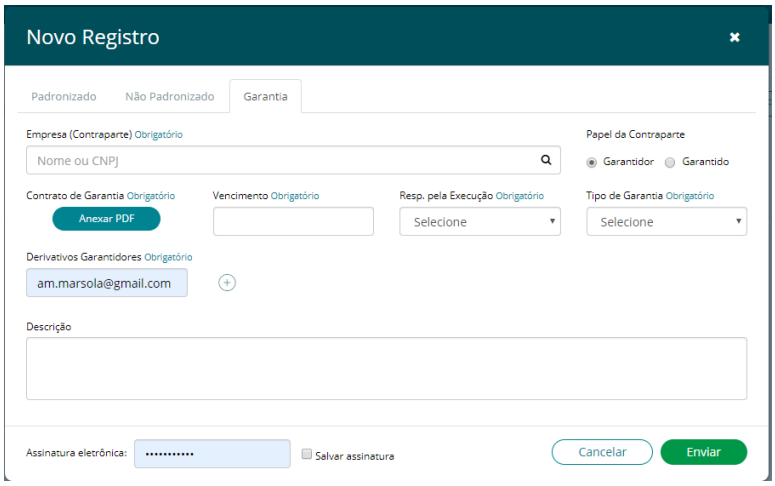
As Contrapartes do Contrato Não Padronizado deverão informar o valor de liquidação na data de vencimento do contrato. A informação do valor de liquidação do contrato deverá ser aprovada pela Contraparte.

Abaixo, é possível informar o valor de liquidação.



21.5. Registro de Garantia

A Plataforma Derivativos BBCE permite o registro de ônus e gravames.



Onde,

- Contraparte – Nome do Participante Credenciado que está disponibilizando o Instrumento de Constituição de Garantia para registro
- Papel da Contraparte – é definido no ato do registro se a Contraparte será o garantidor ou garantido no registro da garantia;
- Contrato de Garantia – é o instrumento de constituição de garantia entre as Contrapartes;
- Vencimento – data de vencimento do Instrumento de Constituição de Garantia;

- Responsável pela execução – é o responsável pela execução da garantia em caso de inadimplência; as opções são: Garantido, Garantido/Garantidor e Ordem Judicial
- Tipo de Garantia – tipo de garantia acordado pelas partes no Instrumento de Constituição de Garantia; as opções são: Penhor, Alienação/ Cessão Fiduciária e Usufruto
- Derivativos garantidores – contratos de derivativos dados em garantia. O contrato não pode ser dado em garantia em outros contratos de garantia.

As Contrapartes do Instrumento de Constituição de Garantia deverão ser as mesmas dos Contratos de Derivativos.

O aditamento, excussão, inclusão ou baixa de ônus e gravames realizadas no Instrumento de Constituição de Garantia após o registro e aprovação do Instrumento de Constituição de Garantia no sistema pela contraparte, só poderá ser realizado pelas contrapartes por meio de solicitação por e-mail à BBCE, conforme orientação do item 25 desse manual.

O cancelamento do Instrumento de Constituição de Garantia deverá seguir os procedimentos descritos no item 27 desse manual.

Os Contratos de Derivativos dados em garantia não poderão ser cancelados.

22. Cálculo da Liquidação

A Ficha de Liquidação é encaminhada por e-mail para todos os endereços eletrônicos registrados no cadastro do Participante Credenciado (envio de ficha de liquidação).

A Ficha de Liquidação é composta por duas sessões, sendo que a primeira sessão é composta por informações das Contrapartes do Contrato de Derivativo.

Contrato padrão de compra e venda de derivativo de energia - BBCE

ANEXO II - FICHA DE LIQUIDAÇÃO

Parte A - Comprador	Empresa Marcelo 2
CNPJ	94.088.850/0001-37
Endereço	Av. dos Aristocratas, 100, - 12460000 - Campos do Jordão/SP
E-mail	mglbianchini@gmail.com
Banco	AGK CC S.A.
Agência	44-4
Número da conta	343-4
Parte B - Vendedor	Empresa Marcelo 3 RS
CNPJ	66.865.121/0001-04
Endereço	Rua Piauí, 426, ap 88 - 01241000 - São Paulo/SP
E-mail	mglbianchini+marcelo3ficha@gmail.com
Banco	ITAÚ UNIBANCO S.A.
Agência	7054-
Número da conta	31254-6

ANEXO II - FICHA DE LIQUIDAÇÃO

Código contrato	RP095896
Indentificador da liquidação	2121
Ativo subjacente	Energia elétrica
Código do produto	5636
Descrição	SE CON MEN JUN/20
Data da operação	03/06/20
Horário da operação	16:32:22
Preço inicial	R$110,00
Quantidade	1,00
Fator	720,000 MWh
Indexador	PLD
Preço final	R$7,32

A Contraparte A e Contraparte B representam as Contrapartes da Ficha de Liquidação, os demais campos são representados por seus respectivos dados cadastrais e dados bancários.

A segunda sessão é composta por informações do Contrato de Derivativo.

Os campos que compõem a segunda parte da Ficha de Liquidação são:

- Código do contrato – código do Contrato de Derivativos a que se refere a Ficha de Liquidação
- Identificador da Liquidação – chave numérica que identifica qual a ficha gerada
- Ativo Subjacente – ativo subjacente referente ao produto
- Código do Produto – código do produto negociado
- Descrição – nome do produto
- Código do Agrupador – código do agrupamento negociado;
- Produto Agrupado – nome do produto agrupado;
- Data da operação – data da operação a ser liquidada

- Horário da operação – horário da operação a ser liquidada
- Preço inicial em R$ – Preço determinado no Contrato de Derivativos
- Quantidade – quantidade de Energia negociado no contrato
- Fator – fator de multiplicação para o Cálculo da liquidação
- Indexador – indexador utilizado para o cálculo da liquidação
- Preço final R$ – preço final do Contrato de Derivativo
- Valor de Liquidação – valor calculado da liquidação
- Data de Cálculo – data de Cálculo da liquidação
- Data de Liquidação – data em que a liquidação será liquidada
- Local de Registro – Local que foi celebrado o Contrato de Derivativos
- Agente de Cálculo – Agente que realizou o Cálculo da liquidação

Todos os Contratos Padronizados registrados na Plataforma Derivativos BBCE (exceto na modalidade Contrato Não Padronizado e antecipações) terão o seu Cálculo efetuado pela Plataforma Derivativos BBCE de forma automática, após a data de publicação do índice de referência (Indexador). Os Contratos de Derivativos serão liquidados na Data de Liquidação tendo como base o PLD divulgado no site da CCEE, por submercado, conforme fórmula abaixo:

$$VL = (PR - PT) \times Q \times F$$

Onde:
VL = Valor de Liquidação, expresso em Reais
PR = PLD referente a Data de Liquidação e submercado, divulgado pela CCEE, em 2 casas decimais
PT = Preço a Termo Negociado, conforme definido no momento do registro do Contrato de Derivativos e expresso em Reais
Q = Quantidade de MWm negociada e definida no momento do registro do Contrato de Derivativos
F = Fator correspondente ao número de horas do mês ou da semana conforme o produto negociado

Caso “VL” seja positivo, o Participante Credenciado, Vendedor pagará o valor ao Participante Credenciado, Comprador. Na hipótese de “VL” ser negativo, o Participante Credenciado, Comprador pagará o valor ao Participante Credenciado, Vendedor.

23. Cessão

A cessão dos direitos e obrigações referentes ao Contrato de Derivativos poderá ser realizada antes da Data de Liquidação. A documentação relacionada a esta

cessão, assinada pelo cedente, cessionário e Contraparte anuente deverá ser encaminhada à BBCE antes da Data de Liquidação, pelo e-mail operacoes@bbce.com.br. Após o envio será gerado automaticamente um chamado no sistema BBCE.

Fluxo consta no Anexo I e Formulários serão disponibilizados no site.

24. Substituição

A substituição poderá ser realizada antes da Data de Liquidação. A documentação relacionada a esta substituição deverá ser encaminhada à BBCE antes da Data de Liquidação, por meio do e-mail operacoes@bbce.com.br. Após o envio, será gerado automaticamente um chamado no sistema da BBCE. Nessa documentação deverá constar o Instrumento que originou a Substituição com assinatura do Anuente e/ou Carta de Anuência da Contraparte.

Fluxo consta no Anexo I e Formulários serão disponibilizados no site.

25. Aditamento

O aditamento do Contrato de Derivativos e/ou de qualquer informação do Instrumento de Constituição de Garantia poderá ocorrer após o respectivo registro na Plataforma Derivativos BBCE e desde que antes da Data de Liquidação. A documentação relativa ao Aditamento deverá ser encaminhada à BBCE antes da Data de Liquidação, por meio do e-mail operacoes@bbce.com.br. Após o envio, será gerado automaticamente um chamado no Sistema BBCE. Nessa documentação deverá constar o termo de aditamento ao Contrato Derivativos e/ou ao Instrumento de Constituição de Garantia assinado por ambas as Contrapartes, além dos demais documentos cabíveis ao caso.

Fluxo consta no Anexo I e Formulários serão disponibilizados no site.

26. Antecipação

A antecipação da liquidação do Contrato de Derivativos poderá ser realizada antes da Data de Liquidação. A documentação relativa à antecipação deverá ser encaminhada à BBCE antes da Data de Liquidação, por meio do e- mail operacoes@bbce.com.br. Após o envio, será gerado automaticamente um chamado para atendimento da equipe de Operações. Nessa documentação deverá constar a solicitação de antecipação da Contraparte e a aprovação da outra Contraparte.

As Contrapartes do Contrato de Derivativo gravado, ao antecipar a liquidação dele, estarão realizando a baixa automática do gravame.

Fluxo consta no Anexo I e Formulários serão disponibilizados no site.

27. Cancelamento

O cancelamento de Operações Realizadas na Plataforma Derivativos BBCE, bem como do Instrumento de Constituição de Garantia só poderá ocorrer no próprio dia da operação, mediante a apresentação de documentação relativa ao cancelamento, desde que previamente autorizado pela BBCE.

A documentação relativa ao cancelamento deverá ser encaminhada à BBCE por meio do e-mail operacoes@bbce.com.br. Após o envio, será gerado automaticamente um chamado para atendimento da equipe de Operações. Nessa documentação, deverá constar o formulário com a solicitação de cancelamento e aprovação da Contraparte, acompanhada da respectiva justificativa, para análise da BBCE.

Esse fluxo consta no Anexo I e o Formulário consta disponibilizado no site.

No caso de Operações Previamente Realizadas e, posteriormente, formalizadas na Plataforma Derivativos BBCE, o cancelamento poderá ser realizado pelas Contrapartes em até 3 (três) dias após o registro do contrato, por meio do ícone de cancelamento na tela de registro. A solicitação deve ser realizada por uma das Contrapartes, mediante justificativa, e após a aprovação da Contraparte, o cancelamento será automaticamente efetivado.

28. Inadimplemento entre Contrapartes

Em caso de inadimplemento financeiro da Contraparte referente ao Contrato de Derivativos, a Contraparte Afetada deverá informar à BBCE quanto ao ocorrido por meio do canal de atendimento (Item Atendimento) em até 3 (três) dias do inadimplemento.

29. Atendimento

Em caso de dúvidas, sugestões e solicitações sobre os processos de utilização da Plataforma Derivativos BBCE, entre em contato por meio dos canais de e-mail

suporte@bbce.com.br e contato@bbce.com.br. Cada e-mail enviado gera um chamado para atendimento da equipe de Operações. Para mais informações, acesse o site www.bbce.com.br.

30. Estruturas Especiais

Conforme mencionado no “Processo Comitê de Estruturas Especiais”, a BBCE possui um comitê de estruturas especiais (CEE) que avalia demandas/necessidades específicas dos seus clientes de operações de derivativos com condições específicas. e no Glossário, De acordo com o documento e o Glossário, Estrutura Especial é uma estratégia de derivativos customizada para atender a operações com condições específicas dos Clientes, ou seja, uma estrutura com alguma variável determinante para definição de preço e liquidação. Ela representa um tipo de Registro Não Padronizado que no momento da solicitação do Cliente não está disponível nos sistemas da BBCE e, portanto, necessita estar devidamente destacada no ambiente de registro. Entretanto, deve sempre ser previamente avaliada e aprovada e, ainda, enquadrada às normas do instrumento financeiro e aos regulamentos internos da BBCE.

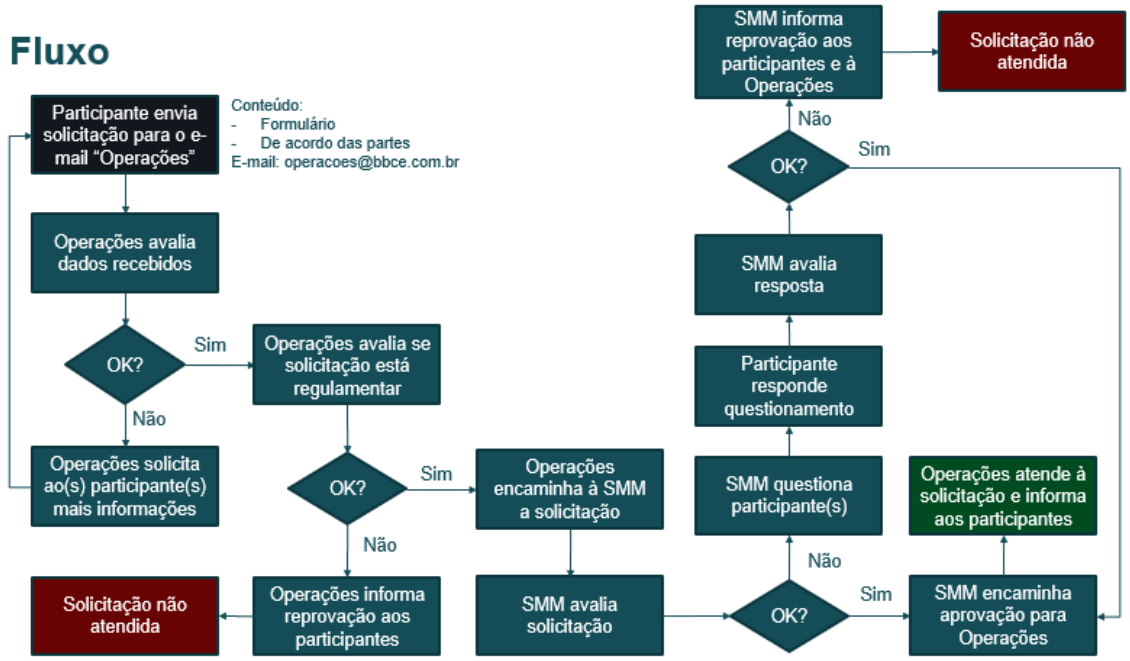
As solicitações de estruturas especiais devem seguir as orientações do documento “Processo Comitê de Estruturas Especiais”, disponível na seção Documentos do site institucional da BBCE (www.bbce.com.br).

A BBCE contribui com o cliente na organização dos materiais a serem apresentados para análise do CEE e deve conter, no mínimo, fundamento econômico, adequação regulatória e planilha de simulação. O material é submetido à avaliação de um grupo formado por diferentes áreas da BBCE.

31. Controle de Versões

Versão	Data	Descrição	Autor(es)
1.00	18/05/2020	Elaboração do Manual do Usuário	Produtos BBCE
1.00	20/05/2020	Aprovação dos Atos Normativos	Conselho de Administração
1.00	10/12/2020	Delegação do Conselho para Diretoria rever a adequação do documento	CEO/Conselho de Administração
1.10	29/01/2021	Desbloqueio senha, nova tela Registro Não Padronizado e redução limite em tempo real	
1.11	18/03/2021	Download da ficha de liquidação	
1.12	11/06/2021	Túnel sobre curva, upload de CGD próprio e melhora na redação do procedimento de cancelamento	
1.13	21/06/2021	Estruturas especiais e referência sobre as penalidades para RNP	

ANEXO I



- Resposta em até 3h (pedidos feitos após as 16h serão respondidos até 12h do dia útil subsequente);
- Questionamentos aos participantes devem ser respondidos em até 1 dia corrido. Se não houver resposta no prazo acordado, a solicitação será encerrada com a justificativa de ausência de resposta.