



26 de setembro de 2013
069/2013-DP

OFÍCIO CIRCULAR

Revogado pelo Ofício Circular nº 047/2017-DP, de 18 de Agosto de 2017

Participantes dos Mercados da BM&FBOVESPA – Segmentos BOVESPA e BM&F

Ref.: Procedimentos para Utilização das Telas de Justificativas das Falhas de Entrega de Ativos e Melhorias no Empréstimo de Ativos – BTC.

Em complemento ao Ofício Circular 012/2013-DO, a BM&FBOVESPA apresenta, no Anexo a este Ofício, as telas do sistema que estarão disponíveis aos participantes de negociação e agentes de compensação para registro das justificativas das falhas de entrega de ativos a partir de 07/10/2013, ou seja, D+4 do pregão de 01/10/2013.

As justificativas deverão ser realizadas no sistema até 18h de D+6 da data da negociação. As falhas não justificadas até o horário-limite incorrerão em cobrança de multa automática em D+7.

A BM&FBOVESPA analisará as justificativas até D+11 e informará o resultado da análise aos participantes por meio das telas utilizadas para realização das justificativas, conforme detalhado no Anexo. Nos casos em que as justificativas apresentadas estejam incompletas ou incorretas, será cobrada multa adicional na janela de liquidação de D+12.

Os participantes poderão acompanhar as multas aplicadas em D+7 e D+12, mediante consulta no sistema Controle de Liquidação Financeira – CLF, utilizando os códigos de lançamento listados a seguir:

Descrição do Código	Código do Lançamento	Prazo da Cobrança da Multa
MULTA COMPL. POR ATRASO (D+3)	855	D+7
MULTA COMPL. POR ATRASO (D+4)	860	D+7
MULTA COMPL. POR ATRASO (D+3)	856	D+12
MULTA COMPL. POR ATRASO (D+4)	861	D+12



069/2013-DP

.2.

Adicionalmente, serão realizadas, a partir de **30/09/2013**, as seguintes melhorias no serviço de Empréstimo de Ativos – BTC:

a) Valor máximo de taxa/comissão

Remoção da limitação atualmente existente dos campos “taxa doadora”, “comissão doadora”, “taxa tomadora” e “comissão tomadora” de 99,99999% ao ano.

b) Ofertas elegíveis para empréstimo compulsório

Revisão dos critérios de elegibilidade das ofertas doadoras para fechamento de contratos de empréstimos compulsórios, permanecendo:

1. ter vencimento igual ou superior a nove dias úteis;
2. não possuir carência na oferta;
3. não possuir direcionamento;
4. não possuir cláusula reversível ao doador igual a “sim”.

Destaca-se que a condição da taxa de remuneração doadora ser inferior a 150% da média mensal calculada dos empréstimos registrados no mês anterior será suprimida.

c) Inadimplência no empréstimo de ativos

No processo atual, o contrato inadimplente pode ser regularizado, com a emissão de recompra, a pedido do doador, a partir da data da inadimplência.

No novo processo, o tomador que não realizar a devolução dos ativos no vencimento do contrato, deverá regularizar a situação até 20h de D+1 da data do vencimento do contrato. Decorrido esse prazo, em D+2 da data do vencimento do contrato, será emitida a recompra em favor do doador na quantidade não regularizada.

Os contratos com vencimento anterior a 30/09/2013 e que se encontrarem em situação de inadimplência deverão ser regularizados até 20h do dia 04/10/2013. Em 07/10/2013, será emitida recompra em favor dos doadores para os contratos não regularizados.

As recompras emitidas em decorrência de inadimplência no empréstimo de ativos podem ser canceladas ou executadas até D+4 do vencimento do contrato. Caso o doador não comunique à BM&FBOVESPA o



069/2013-DP


.3.

cancelamento ou a execução da recompra, esta será automaticamente revertida para liquidação em D+6.


As demais regras para tratamento de contrato inadimplente permanecem inalteradas.

Informações e esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Liquidação, pelos telefones (11) 2565-4757/4255 (para falhas de entrega) ou (11) 2565-4142/4294 (para empréstimo de ativos – BTC).

Atenciosamente,



Edemir Pinto
Diretor Presidente



Cícero Augusto Vieira Neto
Diretor Executivo de Operações,
Clearing e Depositária



069/2013-DP

.4.

Anexo I ao Ofício Circular 069/2013, de 26/09/2013**PROCEDIMENTOS PARA JUSTIFICATIVAS DE FALHAS DE ENTREGA DE ATIVOS**

Conforme descrito no Ofício Circular 012/2013-DO de 02/08/2013, para que as falhas de entrega de ativos sejam caracterizadas como de natureza operacional, os participantes devem prestar declaração e registrar dados adicionais ali detalhados. Tais declarações serão registradas por meio de telas do sistema da BM&FBOVESPA – LQV, a partir de D+4 do pregão de 01/10/2013.

A tela de consulta do sistema poderá ser acessada por participantes de negociação e agentes de compensação, sendo que este último visualizará somente as falhas de seus clientes qualificados.

O sistema exibirá as falhas de D+3 e D+4 agrupadas por investidor e código de negociação. As justificativas para as falhas deverão ser feitas até 18h de D+6 da data do pregão.

Tela para consulta do agente de compensação

Menu do sistema LQV: Liquidação ► Consultar Multas ► Consultar multas AGCO.

■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Consulta Justificativas do Agente de Compensação

Data Preg.: 07/02/2012

Ag. Comp.:

Cli. Qual.:

Part. Neg.:

Inv. PN:

Cód. Neg.:

■ PESQUISAR ■ VOLTAR ■ CANCELAR ■ DOWNLOAD

Página 1 6 Registros: 1 - 6

Status	Part. Neg.	Cód. Neg.	Cód. Invs.	Cód. Cart.	Qte. Falha	Qte. a Reconsiderar	Val
Em Análise	58	BVMF3	24719	21016	100	100	
Rejeitado	58	BVMF3	27877	21016	52	52	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	287	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40823	21016	1.861	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40777	21016	1.100	0	

Esta tela será utilizada apenas pelo agente de compensação do investidor qualificado.



069/2013-DP

.5.

Campos obrigatórios

- **Data Preg.:** deverá ser escolhida a data do pregão do negócio que gerou a falha. (limite D+12).

De acordo com os parâmetros escolhidos, a pesquisa retornará todas as falhas existentes. A coluna “Status” poderá, até D+12 do pregão, conter um dos seguintes valores:

1. **Não justificado:** terão este status as falhas que não tiveram nenhuma justificativa. Caso não seja justificada até D+6, serão cobradas as multas adicionais cabíveis em D+7 do pregão.
2. **Em análise:** sob a análise da BM&FBOVESPA. O prazo para ser aprovado/rejeitado é até D+11 da data do pregão. Não será cobrada a multa adicional em D+7, podendo ser cobrada em D+12 caso a justificativa seja rejeitada.
3. **Aprovado:** os valores de multa adicional não serão cobrados em D+7 ou D+12.
4. **Rejeitado:** o pedido de reconsideração da multa adicional foi rejeitado pela BM&FBOVESPA. Os valores das multas adicionais serão lançados em D+12 da data do pregão. Adicionalmente, este status será atribuído às falhas não justificadas até o final de D+6.

Todos os resultados obtidos em tela poderão ser exportados para o Excel pela função de download.



069/2013-DP

.6.

Tela de consulta do participante de negociação

Menu do sistema LQV: Liquidação ► Consultar Multas ► Consultar multas PRNG.

■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Consulta Justificativas do Participante de Negociação

Data Preg.: 07/02/2012

Part. Neg.:

Inv. PN:

Cód. Neg.:

■ PESQUISAR ■ VOLTAR ■ CANCELAR ■ DOWNLOAD

Página 1 6 Registros: 1 - 6

Status	Cód. Neg.	Cód. Invs.	Cód. Cart.	Qte. Falha	Qte. a Reconsiderar	Valor Multa	Período
Aprovado	BVMF3	24719	21016	100	100	14,53	D:
Rejeitado	BVMF3	27877	21016	52	52	7,55	D:
Em Análise	BVMF3	27877	21016	287	0	41,72	D:
Em Análise	BVMF3	27877	21016	257	200	43,72	D:
Não Justificado	BVMF3	40823	21016	1.861	0	270,51	D:
Não Justificado	BVMF3	40777	21016	1.100	0	159,89	D:

Esta tela será utilizada pelo participante de negociação, quando o cliente não for qualificado.

Campos obrigatórios

- **Data Preg.:** deverá ser escolhida a data do pregão do negócio que gerou a falha. (limite D+12).

De acordo com os parâmetros escolhidos a pesquisa retornará todas as falhas existentes. A coluna "Status" poderá, até D+12 do pregão, conter um dos seguintes valores:

1. **Não justificado:** terão este Status as falhas que não tiveram nenhuma justificativa. Caso não seja justificada até D+6 serão cobradas as multas adicionais cabíveis em D+7 do pregão.
2. **Em análise:** sob a análise da BM&FBOVESPA. O prazo para ser aprovado/rejeitado é até D+11 da data do pregão. Não será cobrada a multa adicional em D+7, podendo ser cobrada em D+12 caso a justificativa seja rejeitada.
3. **Aprovado:** os valores de multa adicional não serão cobrados em D+7 ou D+12.
4. **Rejeitado:** o pedido de reconsideração da multa adicional foi rejeitado pela BM&FBOVESPA. Os valores das multas adicionais serão lançados em D+12 da data do pregão. Adicionalmente, este status será atribuído às falhas não justificadas até o final de D+6.

Todos os resultados obtidos em tela poderão ser exportados para o Excel pela função de download.



■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Detalhe da Multa

Data Pregão: 07/02/2012 Status: NÃO JUSTIFICADO

Participante Negociação:

Part. Neg.:
Cód. Inv.: 40823 Carteira: 21016
Agente:
Compensação:
Cliente Qualificado: 4123

Dados da Operação:

Cód. Negócio: BVMF3 Investidor: 40823 Qte. Ação: 1.861 Qte. Saldo Útil.: 0 Período: D3

Valor da Multa:

Multa (D3/D4): 270,91

Justificativa:

Tipos Justificativas: Decorrentes de erro de alocação de cliente Qte. a Justificar: 1861

Informações Adicionais:

* Informe '0' para campos numéricos e 'N' para campos texto caso não possua informação correspondente.

Cta. Cl. Orig. da ordem no PN	Ag. Cust. Cliente	Cta. Cl. Orig. da ordem no Ag. Cust.	Saldo em Cta. Cli. em D+3
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Demonst. Cumprimento de Regra Alloc. pelo Gestor

Local de Armazenamento da Informação

Decl. saldo foi utilizado para regul. a falha: Não

CONFIRMAR VOLTAR IMPRIMIR

Observação: a tela acima representa a visão do agente de compensação. Para os participantes de negociação, a tela seguirá o mesmo padrão excluindo os campos de “Agente de Compensação” e “Cliente Qualificado”.

Nesta tela, deverá ser escolhida a justificativa para a reconsideração da multa adicional.

Dados da operação

- Qtde. Ação: quantidade total da falha.
- Qte. Saldo Útil: quantidade já justificada.
- Período: indica se a multa é referente à falha de liquidação em D+3 ou D+4.
- **Justificativa:** deverá ser escolhida uma justificativa (todas estão descritas no Ofício Circular 012/2013-DO, de 02/08/2013). Escolher o motivo na caixa “Tipos Justificativas”.
- Quantidade a justificar: preencher com a quantidade da falha que será justificada. Ao selecionar uma falha para fazer a justificativa, o usuário poderá escolher a quantidade do total da falha que será justificada. Caso faça uma justificativa parcial, o sistema irá separar na tela de consulta uma linha para a justificativa feita, que terá o Status alterado de “Não Justificado” para “Em Análise”, e outra para a quantidade que não foi justificada. O usuário poderá



069/2013-DP

.9.

repetir este procedimento até que o total da quantidade justificada seja igual à quantidade da falha, caso seja necessário.

- Cta. Cli. Orig. da ordem no PN: código do cliente que originou a ordem no PN. (sem dígito)
- Ag. Cust. Cliente: o agente de custódia do cliente. (sem dígito)
- Cta. Cli. Orig. da ordem no Ag. Cust.: a conta do cliente que originou a ordem no agente de custódia. (sem dígito)
- Saldo em Cta. Cli. em D+3: o saldo em ativos na depositária em D+3 do cliente que originou a ordem.
- Demonst. Cumprimento regra Alloc. pelo Gestor:
 - Tipo de Registro da Informação: meio de comunicação utilizado pelo gestor para a alocação das operações. Escolher uma das opções disponíveis.
 - Local de Armazenamento da Informação: descrição do local no Participante onde a informação se encontra.
- Decl. saldo foi utilizado para regul. a falha: Sim/Não.

3. Falhas de entrega decorrentes de erro de alocação de conta de custódia de mesma titularidade (por exemplo, quando um cliente possui mais de uma conta de custódia e a alocação da operação é feita para a conta de custódia incorreta, sendo que o investidor, comprovadamente, possui o ativo vendido em outra conta de custódia de mesma titularidade).

Ao selecionar uma falha com o Status “Não Justificado”, o usuário terá acesso à tela de justificativa. Para isto deverá clicar com o mouse sobre a linha correspondente à falha que deseja justificar.

Negócios
 Especificação
 Liquidação
 Movto. Custódia
 Recompra
 Parâmetros

Consulta Justificativas do Agente de Compensação

Data Preg.:	<input type="text" value="07/02/2012"/>
Ag. Comp.:	<input type="text"/>
Cli. Qual.:	<input type="text"/>
Part. Neg.:	<input type="text"/>
Inv. PN:	<input type="text"/>
Cód. Neg.:	<input type="text"/>

PESQUISAR
 VOLTAR
 CANCELAR
 DOWNLOAD

Página 1 6 Registros: 1 - 6

Status	Part. Neg.	Cód. Neg.	Cód. Invs.	Cód. Cart.	Qte. Falha	Qte. a Reconsiderar ↕	Val
Em Análise	58	BVMF3	24719	21016	100	100	
Rejeitado	56	BVMF3	27877	21016	52	52	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	287	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40823	21016	1.861	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40777	21016	1.100	0	



069/2013-DP

.10.

Cada justificativa escolhida poderá abrir diferentes campos para preenchimento dos participantes

Negócios Especificação Liquidação Movto. Custódia Recompria Parâmetros

Detalhe da Multa

Data Pregão: 07/02/2012 Status: NÃO JUSTIFICADO

Participante Negociação:

Part. Neg.:
Cód. Inv.: 40823 Carteira: 21016
Agente
Compensação:
Cliente Qualificado: 4123

Dados da Operação:

Cód. Negócio: Investidor: Qte. Ação: Qte. Saldo Útil.: Período:
BMF3 40823 1.861 0 D3

Valor da Multa:
Multa (D3/D4): 270,51

Justificativa:
Tipos Justificativas: Decorrentes de erro de alocação de conta de custódia de mesma titularidade Qte. a Justificar: 1861

Informações Adicionais:
* Informe '0' para campos numéricos e 'N' para campos texto caso não possua informação correspondente.

Ag. Cust. Cliente	Cta. Cli. no Ag. Cust. com Saldo	Carteira

Saldo em Cta. Cli. em D+3 Decl. saldo foi utilizado para regul. a falha
 Não

CONFIRMAR VOLTAR IMPRIMIR

Observação: a tela acima representa a visão do Agente de Compensação. Para os participantes de negociação, a tela seguirá o mesmo padrão excluindo os campos de “Agente de Compensação” e “Cliente Qualificado”. Nesta tela, deverá ser escolhida a justificativa para a reconsideração da multa adicional.

Dados da operação

- Qtde. Ação: quantidade total da falha.
- Qte. Saldo Útil: quantidade já justificada.
- Período: indica se a multa é referente à falha de liquidação em D+3 ou D+4.
- **Justificativa:** deverá ser escolhida uma justificativa (todas estão descritas no Ofício Circular 012/2013-DO). Escolher o motivo na caixa “Tipos Justificativas”.
- Quantidade a justificar: preencher com a quantidade da falha que será justificada. Ao selecionar uma falha para fazer a justificativa, o usuário poderá escolher a quantidade do total da falha que será justificada. Caso faça uma justificativa parcial, o sistema irá separar na tela de consulta uma linha para a justificativa feita, que terá o Status alterado de “Não Justificado” para “Em Análise”, e outra para a quantidade que não foi justificada. O usuário poderá repetir este procedimento até que o total da quantidade justificada seja igual à quantidade da falha, caso seja necessário.
- Ag. Cust. Cliente: código do agente de custódia do cliente. (sem dígito)
- Cta. Cli. No Ag. Cust. com Saldo: a conta do cliente que possuía saldo na data de liquidação. (sem dígito)



069/2013-DP

.11.

- Carteira: a carteira do cliente que possuía saldo na data de liquidação. (com dígito, ex: 21016)
- Saldo em Cta. Cli. em D+3: o saldo em ativos na depositária em D+3 do cliente que originou a ordem.
- Decl. Saldo foi utilizado para regul. a falha: Sim/Não.

4. Falhas de entrega decorrentes de operações de arbitragem entre futuros de índices de ações e a carteira de ações subjacente, com compra do contrato futuro e venda da carteira de ações subjacente no mesmo instante, ocorrendo falha de entrega em virtude de ausência de ofertas doadoras no BTC.

Ao selecionar uma falha com o Status “Não Justificado”, o usuário terá acesso à tela de justificativa. Para isto, deverá clicar com o mouse sobre a linha correspondente à falha que deseja justificar.

■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Consulta Justificativas do Agente de Compensação

Data Preg.: 07/02/2012

Ag. Comp.:

Ci. Qual.:

Part. Neg.:

Inv. PN:

Cód. Neg.:

■ PESQUISAR ■ VOLTAR ■ CANCELAR ■ DOWNLOAD

Página 1 6 Registros: 1 - 6

Status	Part. Neg.	Cód. Neg.	Cód. Invs.	Cód. Cart.	Qte. Falha	Qte. a Reconsiderar	Val
Em Análise	58	BVMF3	24719	21016	100	100	
Rejeitado	58	BVMF3	27877	21016	52	52	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	287	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40823	21016	1.861	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40777	21016	1.100	0	

Cada justificativa escolhida poderá abrir diferentes campos para preenchimento dos participantes.



■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Detalhe da Multa

Data Pregão: Status: **NÃO JUSTIFICADO**

Participante Negociação:

Part. Neg.:

Cód. Inv.: Carteira:

Agente

Compensação:

Cliente Qualificado:

Dados da Operação:

Cód. Negócio:	Investidor:	Qte. Ação:	Qte. Saldo Util.:	Período:
<input type="text" value="BVMF3"/>	<input type="text" value="40823"/>	<input type="text" value="1.861"/>	<input type="text" value="0"/>	<input type="text" value="D3"/>

Valor da Multa:

Multa (D3/D4):

Justificativa:

Tipos Justificativas: Qte. a Justificar:

* informe '0' para campos numéricos e 'N' para campos texto caso não possua informação correspondente.

+ Informações Adicionais:

Cód. Neg. Contrato Fut.	Corretora ou PLD	Cta. Cli. Corretora ou PLD	Qte. Contrato Fut.
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Hor. 1ª Oper. Compra	Hor. Últ. Oper. Compra	Ded. conforme letra g do item IV, Anexo I do Ofício Circular 012/2013-DO	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text" value="Não"/>	

+ Dados Adicionais para Cada Ação Vendida na Operação de Arbitragem:

Cód. Neg.	PN da Operação	Cta. Cli. no PN	Qte. Vendida	Hor. 1ª Oper. Vda	Hor. Últ. Oper. Vda
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

■ CONFIRMAR ■ VOLTAR ■ IMPRIMIR

Observação: a tela acima representa a visão do agente de compensação. Para os participantes de negociação, a tela seguirá o mesmo padrão excluindo os campos de “Agente de Compensação” e “Cliente Qualificado”. Nesta tela, deverá ser escolhida a justificativa para a reconsideração da multa adicional.



069/2013-DP

.13.

Dados da operação

- Qtde. Ação: quantidade total da falha.
- Qte. Saldo Útil: quantidade já justificada.
- Período: indica se a multa é referente à falha de liquidação em D+3 ou D+4.
- **Justificativa:** deverá ser escolhida uma justificativa (todas estão descritas no Ofício Circular 012/2013-DO, de 02/08/2013). Escolher o motivo na caixa “Tipos Justificativas”.
- Quantidade a justificar: preencher com a quantidade da falha que será justificada. Ao selecionar uma falha para fazer a justificativa, o usuário poderá escolher a quantidade do total da falha que será justificada. Caso faça uma justificativa parcial, o sistema irá separar na tela de consulta uma linha para a justificativa feita, que terá o Status alterado de “Não Justificado” para “Em Análise”, e outra para a quantidade que não foi justificada. O usuário poderá repetir este procedimento até que o total da quantidade justificada seja igual à quantidade da falha, caso seja necessário.

Campos de informações adicionais (contratos futuros)

- Cód. Neg. Contrato Futuro: código de negociação do contrato futuro de índice.
- Corretora ou PLD: código da corretora ou do PLD do cliente que falhou.
- Cta. Cli. Corretora ou PLD: código sob a corretora ou PLD do cliente que falhou.
- Qtde. Contrato Futuro: a quantidade de contratos futuros utilizados na operação de arbitragem.
- Hor. 1ª operação de compra: hora em que foi feita a primeira operação de compra de contrato futuro para a operação de arbitragem.
- Hor. última operação de compra: hora em que foi feita a última operação de compra de contrato futuro para a operação de arbitragem.
- Decl. conforme letra g do item IV, Anexo I do Ofício Circular 012/2013-DO: Sim/Não. Ao preencher “sim”, o Participante declara que (i) as operações de compra de contrato futuro de índice possuem o mesmo valor financeiro das operações de venda de ativos; (ii) tais operações de venda representam, pelo menos, 70% da carteira do índice; e (iii) tais operações de compra e de venda encontram-se em contas do mesmo comitente

Campos de dados adicionais para cada ação vendida na operação de arbitragem

- Cód. Neg.: código de negociação da ação vendida na operação de arbitragem. Para cada ação vendida, deverá ser adicionada uma linha, clicando no símbolo “+” localizado ao lado do título “Dados adicionais para cada ação vendida na operação de arbitragem”.
- PN da operação: código do Participante de Negociação. (sem dígito)
- Cta. Cli. No PN: código do cliente. (sem dígito)
- Qtde. vendida: quantidade vendida total da ação.
- Hor. 1ª operação de venda: hora da primeira operação de venda da ação.
- Hor. Últ. Venda: hora da última operação de venda da ação.



069/2013-DP

.14.

5. Falhas de entrega decorrentes de operações de arbitragem entre ETFs (nacionais e estrangeiros) e a carteira de ações subjacente, com compra do ETF e venda da carteira de ações no mesmo instante, ocorrendo falha de entrega de uma ou mais ações em virtude de ausência de ofertas doadoras no BTC.

Ao selecionar uma falha com o Status “Não Justificado” o usuário terá acesso à tela de justificativa. Para isto deverá clicar com o mouse sobre a linha correspondente à falha que deseja justificar.

Negócios
 Especificação
 Liquidação
 Movto. Custódia
 Recompra
 Parâmetros

Consulta Justificativas do Agente de Compensação

Data Preg.: 07/02/2012

Ag. Comp.:

Cf. Qual.:

Part. Neg.:

Inv. PN:

Cód. Neg.:

PESQUISAR
 VOLTAR
 CANCELAR
 DOWNLOAD

Página 1 6 Registros: 1 - 6

Status	Part. Neg.	Cód. Neg.	Cód. Invs.	Cód. Cart.	Qte. Falha	Qte. a Reconsiderar	Valo
Em Análise	58	BVMF3	24719	21016	100	100	
Rejeitado	58	BVMF3	27877	21016	52	52	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	287	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40823	21016	1.861	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40777	21016	1.100	0	

Cada justificativa escolhida poderá abrir diferentes campos para preenchimento dos participantes.



Tela para justificativa no caso de ETF BM&FBOVESPA

■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Detalhe da Multa

Data Pregão: 07/02/2012 Status: **NÃO JUSTIFICADO**

Participante Negociação:

Part. Neg.:

Cód. Inv.: 40823 Carteira: 21016

Agente

Compensação:

Cliente Qualificado: 4123

Dados da Operação:

Cód. Negócio:	Investidor:	Qte. Ação:	Qte. Saldo Util.:	Período:
BVMF3	40823	1.861	0	D3

Valor da Multa:

Multa (D3/D4): 270,51

Justificativa:

Tipos Justificativas: Decorrentes de operações de arbitragem entre ETFs - BM&FBovespa Qte. a Justificar: 1861

Informações Adicionais:

* Informe '0' para campos numéricos e 'N' para campos texto caso não possua informação correspondente.

Cód. Neg. ETF	PN da Operação	Cta. Cli. no PN	Qte. Comprada ETF
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Hor. 1ª Oper. ETF Hor. Últ. Oper. ETF Decl. conforme letra g do item V, Anexo I do Ofício Circular 012/2013-DO Não

+ Informações Adicionais de Arbitragem:

Cód. Neg.	PN da Operação	Cta. Cli. no PN	Qte. Vendida	Hor. 1ª Oper. Vda	Hor. Últ. Oper. Vda
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

■ CONFIRMAR ■ VOLTAR ■ IMPRIMIR

Observação: a tela acima representa a visão do agente de compensação. Para os participantes de negociação, a tela seguirá o mesmo padrão excluindo os campos de “Agente de Compensação” e “Cliente Qualificado”. Nesta tela, deverá ser escolhida a justificativa para a reconsideração da multa adicional.



069/2013-DP

.16.

Dados da operação

- Qtde. Ação: quantidade total da falha.
- Qte. Saldo Útil: quantidade já justificada.
- Período: indica se a multa é referente à falha de liquidação em D+3 ou D+4.
- **Justificativa:** deverá ser escolhida uma justificativa (todas estão descritas no Ofício Circular 012/2013-DO, de 02/08/2013). Escolher o motivo na caixa “Tipos Justificativas”.
- Quantidade a justificar: preencher com a quantidade da falha que será justificada. Ao selecionar uma falha para fazer a justificativa, o usuário poderá escolher a quantidade do total da falha que será justificada. Caso faça uma justificativa parcial, o sistema irá separar na tela de consulta uma linha para a justificativa feita, que terá o Status alterado de “Não Justificado” para “Em Análise”, e outra para a quantidade que não foi justificada. O usuário poderá repetir este procedimento até que o total da quantidade justificada seja igual à quantidade da falha, caso seja necessário.

Campos de dados adicionais para compra do ETF

- Cód. Neg. ETF: código de negociação do ETF comprado na operação de arbitragem.
- PN da operação: código do participante de negociação. (sem dígito)
- Cta. Cli. No PN: código do cliente. (sem dígito)
- Qtde. comprada ETF: quantidade total de compra do ETF.
- Hor. 1ª operação ETF: hora da primeira operação de ETF.
- Hor. Últ. Oper. ETF: hora da última operação de ETF.
- Decl. conforme letra g do item V, Anexo I do Ofício Circular 012/2013-DO, de 02/08/2013: Sim/Não. Ao preencher “sim”, o participante declara que (i) as operações de compra de ETF possuem o mesmo valor financeiro das operações de venda de ativos; (ii) tais operações de venda representam, pelo menos, 70% da carteira do índice; e (iii) tais operações de compra e de venda encontram-se na mesma conta de comitente.

Campos de dados adicionais para cada ação vendida na operação de arbitragem

- Cód. Neg.: código de negociação da ação vendida na operação de arbitragem. Para cada ação vendida, deverá ser adicionada uma linha, clicando no símbolo “+” localizado ao lado do título “Informações adicionais de arbitragem”.
- PN da operação: código do participante de negociação. (sem dígito)
- Cta. Cli. No PN: código do cliente. (sem dígito)
- Qtde. vendida: quantidade vendida total da ação.
- Hor. 1ª operação de venda: hora da primeira operação de venda da ação.
- Hor. Últ. Venda: hora da última operação de venda da ação.



Tela para justificativa para justificativa de ETFs de outros Mercados

■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Detalhe da Multa

Data Pregão: Status: **NÃO JUSTIFICADO**

Participante Negociação:

Part. Neg.:

Cód. Inv.: Carteira:

Agente

Compensação:

Cliente Qualificado:

Dados da Operação:

Cód. Negócio:	Investidor:	Qte. Ação:	Qte. Saldo Util.:	Período:
<input type="text" value="BVMF3"/>	<input type="text" value="40823"/>	<input type="text" value="1.861"/>	<input type="text" value="0"/>	<input type="text" value="D3"/>

Valor da Multa:

Multa (D3/D4):

Justificativa:

Tipos Justificativas: Qte. a Justificar:

Informações Adicionais:

** Informe '0' para campos numéricos e 'N' para campos texto caso não possua informação correspondente.*

Data Compra ETF	Tipo Identf. ETF	Cód. ETF
<input type="text"/>	<input type="text" value="CUSIP"/>	<input type="text"/>

Descrição ETF Qte. Comprada ETF Decl. de mesma titularidade

Hor. 1ª Oper. ETF Hor. Últ. Oper. ETF Decl. conforme letra g do item V, Anexo I do Ofício Circular 012/2013-DO

Informações Adicionais de Arbitragem:

Cód. Neg.	PN da Operação	Cta. Cli. no PN	Qte. Vendida	Hor. 1ª Oper. Vda	Hor. Últ. Oper. Vda
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

■ CONFIRMAR ■ VOLTAR ■ IMPRIMIR

Observação: a tela acima representa a visão do agente de compensação. Para os participantes de negociação, a tela seguirá o mesmo padrão excluindo os campos de “Agente de Compensação” e “Cliente Qualificado”. Nesta tela, deverá ser escolhida a justificativa para a reconsideração da multa adicional.



069/2013-DP

.18.

Dados da operação

- Qtde. Ação: quantidade total da falha.
- Qte. Saldo Útil: quantidade já justificada.
- Período: indica se a multa é referente à falha de liquidação em D+3 ou D+4.
- **Justificativa:** deverá ser escolhida uma justificativa (todas estão descritas no Ofício Circular 012/2013-DO, de 02/08/2013). Escolher a justificativa na caixa “Tipos Justificativas”.
- Quantidade a justificar: preencher com a quantidade da falha que será justificada. Ao selecionar uma falha para fazer a justificativa, o usuário poderá escolher a quantidade do total da falha que será justificada. Caso faça uma justificativa parcial, o sistema irá separar na tela de consulta uma linha para a justificativa feita, que terá o Status alterado de “Não Justificado” para “Em Análise”, e outra para a quantidade que não foi justificada. O usuário poderá repetir este procedimento até que o total da quantidade justificada seja igual à quantidade da falha, caso seja necessário.

Campos de dados adicionais para compra do ETF

- Data compra ETF: data da compra do ETF.
- Tipo Identf. ETF: o tipo de identificação do ETF no mercado de origem (ISIN, CUSIP, SEDOL, Ticker).
- Cód. ETF: código do ETF comprado na operação de arbitragem, de acordo com a identificação preenchida no campo anterior.
- Descrição ETF: descrição/nome do ETF.
- Qtde. comprada ETF: quantidade total de compra do ETF.
- Decl. Mesma Titularidade: Sim/Não.
- Hor. 1ª operação ETF: hora da primeira operação de ETF.
- Hor. Últ. Oper. ETF: hora da última operação de ETF.
- Decl. conforme letra g do item V, Anexo I do Ofício Circular 012/2013-DO: Sim/Não. Ao preencher “sim”, o Participante declara que (i) as operações de compra de ETF possuem o mesmo valor financeiro das operações de venda de ativos; (ii) tais operações de venda representam, pelo menos, 70% da carteira do índice; e (iii) tais operações de compra e de venda encontram-se na mesma conta de comitente.

Campos de dados adicionais para cada ação vendida na operação de arbitragem

- Cód. Neg.: código de negociação da ação vendida na operação de arbitragem. Para cada ação vendida, deverá ser adicionada uma linha, clicando no símbolo “+” localizado ao lado do título “Informações adicionais de arbitragem”.
- PN da operação: código do participante de negociação. (sem dígito)
- Cta. Cli. No PN: código do cliente. (sem dígito)
- Qtde. vendida: quantidade vendida total da ação.
- Hor. 1ª operação de venda: hora da primeira operação de venda da ação.
- Hor. Últ. Venda: hora da última operação de venda da ação.



- 6. Falhas de entrega decorrentes de operações de arbitragem entre ações e ADRs, com compra de ADRs no exterior e venda de ações no Brasil no mesmo instante, ocorrendo falha de entrega em virtude de descasamento da liquidação da operação a vista com o processo de conversão de ADRs em ações ou em virtude de ausência de ofertas doadoras no BTC.

Ao selecionar uma falha com o Status “Não Justificado”, o usuário terá acesso à tela de justificativa. Para isto, deverá clicar com o mouse sobre a linha correspondente à falha que deseja justificar.

■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Consulta Justificativas do Agente de Compensação

Data Preg.: 07/02/2012

Ag. Comp.:

Cl. Qual.:

Part. Neg.:

Inv. PN:

Cód. Neg.:

■ PESQUISAR ■ VOLTAR ■ CANCELAR ■ DOWNLOAD

Página 1 6 Registros: 1 - 6

Status	Part. Neg.	Cód. Neg.	Cód. Invs.	Cód. Cart.	Qte. Falha	Qte. a Reconsiderar	Val
Em Análise	58	BVMF3	24719	21016	100	100	
Rejeitado	58	BVMF3	27877	21016	52	52	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	287	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40823	21016	1.861	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40777	21016	1.100	0	

Cada justificativa escolhida poderá abrir diferentes campos para preenchimento dos participantes.



■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Detalhe da Multa

Data Pregão: Status: **NÃO JUSTIFICADO**

Participante Negociação:

Part. Neg.:

Cód. Inv.: Carteira:

Agente

Compensação:

Cliente Qualificado:

Dados da Operação:

Cód. Negócio:	Investidor:	Qte. Ação:	Qte. Saldo Util.:	Período:
<input type="text" value="BVMF3"/>	<input type="text" value="40823"/>	<input type="text" value="1.861"/>	<input type="text" value="0"/>	<input type="text" value="D3"/>

Valor da Multa:

Multa (D3/D4):

Justificativa:

Tipos Justificativas: Qte. a Justificar:

Informações Adicionais:

** Informe '0' para campos numéricos e 'N' para campos texto caso não possua informação correspondente.*

Data Compra ADR	Tipo Identf. ADR	Cód. ADR
<input type="text"/>	<input type="text" value="CUSIP"/>	<input type="text"/>
Descrição ADR	Qte. Comprada ADR	Ded. de mesma titularidade
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text" value="Não"/>
Hor. 1ª Oper. ADR	Hor. Últ. Oper. ADR	Motivo da falha de conversão do ADR
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text" value="Falha comunicação Custodiante ou depositário"/>

■ CONFIRMAR ■ VOLTAR ■ IMPRIMIR

Observação: a tela acima representa a visão do agente de compensação. Para os participantes de negociação, a tela seguirá o mesmo padrão excluindo os campos de “Agente de Compensação” e “Cliente Qualificado”. Nesta tela, deverá ser escolhida a justificativa para a reconsideração da multa adicional.

Dados da operação

- Qtd. Ação: quantidade total da falha.
- Qte. Saldo Util: quantidade já justificada.
- Período: indica se a multa é referente à falha de liquidação em D+3 ou D+4.
- **Justificativa:** deverá ser escolhida uma justificativa (todas estão descritas no Ofício Circular 012/2013-DO, de 02/08/2013). Escolher o motivo na caixa “Tipos Justificativas”.
- Quantidade a justificar: preencher com a quantidade da falha que será justificada. Ao selecionar uma falha para fazer a justificativa, o usuário poderá escolher a quantidade do total da falha que será justificada. Caso faça uma justificativa parcial, o sistema irá separar na tela de consulta uma linha para a justificativa feita, que terá o Status alterado de “Não Justificado” para “Em Análise”, e outra para a quantidade que não foi justificada. O usuário poderá repetir este procedimento até que o total da quantidade justificada seja igual à quantidade da falha, caso seja necessário.



069/2013-DP

.21.

Informações adicionais (ADR)

- Data Compra ADR: data da compra do ADR.
- Tipo Identif. ADR: o tipo de código de identificação do ADR. Ex: Ticker, CUSIP, SEDOL, ISIN.
- Cód. ADR: o código do ADR.
- Descrição ADR: o nome da empresa que o ADR representa.
- Qtde. Comprada ADR: quantidade total de compra do ADR para a operação de arbitragem.
- Decl. de mesma titularidade: Sim/Não.
- Hor. 1ª operação de venda: hora da primeira operação de compra de ADR.
- Hor. Últ. Venda: hora da última operação de compra de ADR.
- Motivo da Falha de Conversão do ADR: escolher uma das opções:
 1. Falha de comunicação com custodiante ou depositário do ADR.
 2. Falha de liquidação da operação de compra do ADR.
 3. Suspensão do processo de conversão do ADR.

7. Falhas de entrega decorrentes de operações de arbitragem entre ações e BDRs, com compra de ações no Exterior e venda de BDRs no Brasil no mesmo instante, ocorrendo falha de entrega em virtude de descasamento da liquidação da operação a vista com BDRs com o processo de conversão de ações internacionais em BDRs.

Ao selecionar uma falha com o Status “Não Justificado”, o usuário terá acesso à tela de justificativa. Para isto, deverá clicar com o mouse sobre a linha correspondente à falha que deseja justificar.

Negócios
 Especificação
 Liquidação
 Movto. Custódia
 Recompra
 Parâmetros

Consulta Justificativas do Agente de Compensação

Data Preg.:	<input type="text" value="07/02/2012"/>
Ag. Comp.:	<input type="text"/>
Cli. Qual.:	<input type="text"/>
Part. Neg.:	<input type="text"/>
Inv. PN:	<input type="text"/>
Cód. Neg.:	<input type="text"/>

PESQUISAR
 VOLTAR
 CANCELAR
 DOWNLOAD

Status	Part. Neg.	Cód. Neg.	Cód. Invs.	Cód. Cart.	Qte. Falha	Qte. a Reconsiderar	Val
Em Análise	58	BVMF3	24719	21016	100	100	
Rejeitado	58	BVMF3	27877	21016	52	52	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	287	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40823	21016	1.861	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40777	21016	1.100	0	

Cada justificativa escolhida poderá abrir diferentes campos para preenchimento dos participantes.



■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Detalhe da Multa

Data Pregão: 07/02/2012 Status: **NÃO JUSTIFICADO**

Participante Negociação:

Part. Neg.:

Cód. Inv.: 40823 Carteira: 21016

Agente

Compensação:

Cliente Qualificado: 4123

Dados da Operação:

Cód. Negócio:	Investidor:	Qte. Ação:	Qte. Saldo Util.:	Período:
BVMF3	40823	1.861	0	D3

Valor da Multa:

Multa (D3/D4): 270,51

Justificativa:

Tipos Justificativas: Qte. a Justificar: 1861

Informações Adicionais:

* Informe '0' para campos numéricos e 'N' para campos texto caso não possua informação correspondente.

Data Compra Ação	Tipo Ident. Ação	Cód. Ação
<input type="text"/>	CUSIP	<input type="text"/>
Descrição Ação	Qte. Comprada Ação	Ded. de mesma titularidade
<input type="text"/>	<input type="text"/>	Não
Hor. 1ª Oper. Ação	Hor. Últ. Oper. Ação	Motivo da falha de conversão do BDR
<input type="text"/>	<input type="text"/>	Falha comunicação Custodiante ou depositário

■ CONFIRMAR ■ VOLTAR ■ IMPRIMIR

Observação: a tela acima representa a visão do agente de compensação. Para os participantes de negociação, a tela seguirá o mesmo padrão excluindo os campos de “Agente de Compensação” e “Cliente Qualificado”. Nesta tela, deverá ser escolhida a justificativa para a reconsideração da multa adicional.

Dados da operação

- Qtd. Ação: quantidade total da falha.
- Qte. Saldo Útil: quantidade já justificada.
- Período: indica se a multa é referente à falha de liquidação em D+3 ou D+4.
- **Justificativa:** deverá ser escolhida uma justificativa (todas estão descritas no Ofício Circular 012/2013-DO). Escolher o motivo na caixa “Tipos Justificativas”.
- Quantidade a justificar: preencher com a quantidade da falha que será justificada. Ao selecionar uma falha para fazer a justificativa, o usuário poderá escolher a quantidade do total da falha que será justificada. Caso faça uma justificativa parcial, o sistema irá separar na tela de consulta uma linha para a justificativa feita, que terá o Status alterado de “Não Justificado” para “Em Análise”, e outra para a quantidade que não foi justificada. O usuário poderá repetir este procedimento até que o total da quantidade justificada seja igual à quantidade da falha, caso seja necessário.



069/2013-DP

.23.

Informações adicionais (Ações)

- Data Compra ação: data da compra da ação no exterior.
- Tipo Idenf. ação: o tipo de código de identificação da ação. Ex: Ticker, CUSIP, SEDOL, ISIN.
- Cód. ação: o código da ação de acordo com o tipo de identificação preenchido no campo anterior.
- Descrição ação: a descrição/nome da ação.
- Qtde. Comprada ação: quantidade total de compra da ação para a operação de arbitragem.
- Decl. de mesma titularidade: Sim/Não.
- Hor. 1ª operação de venda: hora da primeira operação de compra da ação.
- Hor. Últ. Venda: hora da última operação de compra da ação.
- Motivo da falha de conversão do BDR: escolher uma das opções:
 1. Falha de comunicação com custodiante ou depositário do BDR.
 2. Falha de liquidação da operação de compra da ação.
 3. Suspensão do processo de conversão do BDR.

8. Falhas de entrega decorrentes de operações de market-makers de ações credenciados pela BM&FBOVESPA, exclusivamente no que diz respeito às operações alocadas para a conta destinada à atividade de market-making.

Ao selecionar uma falha com o Status “Não Justificado”, o usuário terá acesso à tela de justificativa. Para isto, deverá clicar com o mouse sobre a linha correspondente à falha que deseja justificar.

■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Consulta Justificativas do Agente de Compensação

Data Preg.:	07/02/2012
Ag. Comp.:	
Cl. Qual.:	
Part. Neg.:	
Inv. PN:	
Cód. Neg.:	

■ PESQUISAR ■ VOLTAR ■ CANCELAR ■ DOWNLOAD

Página 1 6 Registros: 1 - 6

Status	Part. Neg.	Cód. Neg.	Cód. Invs.	Cód. Cart.	Qte. Falha	Qte. a Reconsiderar	Valo
Em Análise	58	BVMF3	24719	21016	100	100	
Rejeitado	58	BVMF3	27677	21016	52	52	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	287	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40823	21016	1.861	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40777	21016	1.100	0	

Cada justificativa escolhida poderá abrir diferentes campos para preenchimento dos participantes.



■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Detalhe da Multa

Data Pregão: Status: **NÃO JUSTIFICADO**

Participante Negociação:

Part. Neg.:

Cód. Inv.: Carteira:

Agente

Compensação:

Cliente Qualificado:

Dados da Operação:

Cód. Negócio:	Investidor:	Qte. Ação:	Qte. Saldo Util.:	Período:
<input type="text" value="BVMF3"/>	<input type="text" value="40823"/>	<input type="text" value="1.861"/>	<input type="text" value="0"/>	<input type="text" value="D3"/>

Valor da Multa:

Multa (D3/D4):

Justificativa:

Tipos Justificativas: Qte. a Justificar:

Informações Adicionais:

Falha decorre de venda de bloco de ações (facilitation)?

■ CONFIRMAR ■ VOLTAR ■ IMPRIMIR

Observação: a tela acima representa a visão do agente de compensação. Para os participantes de negociação, a tela seguirá o mesmo padrão excluindo os campos de “Agente de Compensação” e “Cliente Qualificado”. Nesta tela, deverá ser escolhida a justificativa para a reconsideração da multa adicional.



Dados da operação

- Qtde. Ação: quantidade total da falha.
- Qte. Saldo Útil: quantidade já justificada.
- Período: indica se a multa é referente à falha de liquidação em D+3 ou D+4.
- **Justificativa:** deverá ser escolhida uma justificativa (todas estão descritas no Ofício Circular 012/2013-DO, de 02/08/2013). Escolher o motivo na caixa “Tipos Justificativas”.
- Quantidade a justificar: preencher com a quantidade da falha que será justificada. Ao selecionar uma falha para fazer a justificativa, o usuário poderá escolher a quantidade do total da falha que será justificada. Caso faça uma justificativa parcial, o sistema irá separar na tela de consulta uma linha para a justificativa feita, que terá o Status alterado de “Não Justificado” para “Em Análise”, e outra para a quantidade que não foi justificada. O usuário poderá repetir este procedimento até que o total da quantidade justificada seja igual à quantidade da falha, caso seja necessário.
- Falha decorre de venda de bloco de ações (facilitation)?: Sim/Não. Apenas as justificativas preenchidas como “não” serão consideradas como de natureza operacional.

9. Falhas de entrega decorrentes de operações de market-makers de opções de ações credenciados pela BM&FBOVESPA, exclusivamente no que diz respeito às operações alocadas para a conta destinada à atividade de market-making e ao delta-hedge das opções.

Ao selecionar uma falha com o Status “Não Justificado”, o usuário terá acesso à tela de justificativa. Para isto, deverá clicar com o mouse sobre a linha correspondente à falha que deseja justificar.

Negócios
 Especificação
 Liquidação
 Movto. Custódia
 Recompra
 Parâmetros

Consulta Justificativas do Agente de Compensação

Data Preg.:	<input type="text" value="07/02/2012"/>		
Ag. Comp.:	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Cl. Qual.:	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Part. Neg.:	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Inv. PN:	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Cód. Neg.:	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

PESQUISAR
 VOLTAR
 CANCELAR
 DOWNLOAD

Página 1							6 Registros: 1 - 6
Status	Part. Neg.	Cód. Neg.	Cód. Invs.	Cód. Cart.	Qte. Falha	Qte. a Reconsiderar	Val
Em Análise	58	BVMF3	24719	21016	100	100	
Rejeitado	58	BVMF3	27877	21016	52	52	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	287	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40823	21016	1.861	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40777	21016	1.100	0	



069/2013-DP

.26.

Cada justificativa escolhida poderá abrir diferentes campos para preenchimento dos participantes.

■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Detalhe da Multa				
Data Pregão:	07/02/2012	Status:	NÃO JUSTIFICADO	
Participante Negociação:				
Part. Neg.:				
Cód. Inv.:	40823	Carteira:	21016	
Agente				
Compensação:				
Cliente Qualificado:	4123			
Dados da Operação:				
Cód. Negócio:	Investidor:	Qte. Ação:	Qte. Saldo Util.:	Período:
BVMF3	40823	1.861	0	D3
Valor da Multa:				
Multa (D3/D4):	270,51			
Justificativa:				
Tipos Justificativas:				Qte. a Justificar:
Decorrentes de operações de Market Makers de opções de ações				1861
Informações Adicionais:				
Falha decorre de venda de bloco de ações (facilitation)?				
Não				
Sim				
■ CONFIRMAR ■ VOLTAR ■ IMPRIMIR				

Observação: a tela acima representa a visão do agente de compensação. Para os participantes de negociação, a tela seguirá o mesmo padrão excluindo os campos de “Agente de Compensação” e “Cliente Qualificado”. Nesta tela, deverá ser escolhida a justificativa para a reconsideração da multa adicional.

Dados da operação

- Qtd. Ação: quantidade total da falha.
- Qte. Saldo Útil: quantidade já justificada.
- Período: indica se a multa é referente à falha de liquidação em D+3 ou D+4.
- **Justificativa:** deverá ser escolhida uma justificativa (todas estão descritas no Ofício Circular 012/2013-DO). Escolher o motivo na caixa “Tipos Justificativas”.
- Quantidade a justificar: preencher com a quantidade da falha que será justificada. Ao selecionar uma falha para fazer a justificativa, o usuário poderá escolher a quantidade do total da falha que será justificada. Caso faça uma justificativa parcial, o sistema irá separar na tela de consulta uma linha para a justificativa feita, que terá o Status alterado de “Não Justificado” para “Em Análise”, e outra para a quantidade que não foi justificada. O usuário poderá repetir este procedimento até que o total da quantidade justificada seja igual à quantidade da falha, caso seja necessário.



- Falha decorre de venda de bloco de ações (facilitation)?: Sim/Não. Apenas as justificativas preenchidas como “não” serão consideradas como de natureza operacional.
- 10. Falhas de entrega decorrentes de vendas no mercado a vista em D+0 combinadas com reversão de posição doadora no BTC em D+0, ocorrendo falha de entrega em virtude de descasamento da liquidação da operação a vista e da liquidação da reversão do empréstimo.**

Ao selecionar uma falha com o Status “Não Justificado”, o usuário terá acesso à tela de justificativa. Para isto, deverá clicar com o mouse sobre a linha correspondente à falha que deseja justificar.

Negócios Especificação Liquidação Movto. Custódia Recompra Parâmetros

Consulta Justificativas do Agente de Compensação

Data Preg.: 07/02/2012

Ag. Comp.:

Cli. Qual.:

Part. Neg.:

Inv. PN:

Cód. Neg.:

PESQUISAR VOLTAR CANCELAR DOWNLOAD

Página 1 6 Registros: 1 - 6

Status	Part. Neg.	Cód. Neg.	Cód. Invs.	Cód. CarL.	Qte. Falha	Qte. a Reconsiderar	Val
Em Análise	58	BVMF3	24719	21016	100	100	
Rejeitado	58	BVMF3	27877	21016	52	52	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	287	
Em Análise	58	BVMF3	27877	21016	287	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40823	21016	1.861	0	
Não Justificado	58	BVMF3	40777	21016	1.100	0	

Cada justificativa escolhida poderá abrir diferentes campos para preenchimento dos participantes.



■ Negócios ■ Especificação ■ Liquidação ■ Movto. Custódia ■ Recompra ■ Parâmetros

Detalhe da Multa

Data Pregão: 07/02/2012 Status: NÃO JUSTIFICADO

Participante Negociação:

Part. Neg.:
Cód. Inv.: 40823 Carteira: 21016
Agente
Compensação:
Cliente Qualificado: 4123

Dados da Operação:

Cód. Negócio:	Investidor:	Qte. Ação:	Qte. Saldo Util.:	Período:
BVMF3	40823	1.861	0	D3

Valor da Multa:

Multa (D3/D4): 270,51

Justificativa:

Tipos Justificativas: Decorrentes de vendas no mercado à vista Qte. a Justificar: 1861

Informações Adicionais:

* Informe '0' para campos numéricos e 'N' para campos texto caso não possua informação correspondente.
Núm. contratos no BTC com liquidação antecipada solicitada na data venda

■ CONFIRMAR ■ VOLTAR ■ IMPRIMIR

Observação: a tela acima representa a visão do agente de compensação. Para os participantes de negociação, a tela seguirá o mesmo padrão excluindo os campos de “Agente de Compensação” e “Cliente Qualificado”. Nesta tela, deverá ser escolhida a justificativa para a reconsideração da multa adicional.

Dados da Operação

- Qtd. Ação: quantidade total da falha.
- Qte. Saldo Util: quantidade já justificada.
- Período: indica se a multa é referente à falha de liquidação em D+3 ou D+4.
- **Justificativa:** deverá ser escolhida uma justificativa (todas estão descritas no Ofício Circular 012/2013-DO, de 02/08/2013). Escolher o motivo na caixa “Tipos Justificativas”.
- Quantidade a justificar: preencher com a quantidade da falha que será justificada. Ao selecionar uma falha para fazer a justificativa, o usuário poderá escolher a quantidade do total da falha que será justificada. Caso faça uma justificativa parcial, o sistema irá separar na tela de consulta uma linha para a justificativa feita, que terá o Status alterado de “Não Justificado” para “Em Análise”, e outra para a quantidade que não foi justificada. O usuário poderá repetir este procedimento até que o total da quantidade justificada seja igual à quantidade da falha, caso seja necessário.

Informações adicionais

- Núm. Contratos no BTC com liquidação antecipada solicitada na data venda: os números dos contratos do BTC que tiveram solicitação de liquidação antecipada na data da venda da ação. Caso seja necessário preencher com mais de um número de contrato, estes devem ser separados por ponto e vírgula “;”.