



26 de fevereiro de 2014  
011/2014-DP

## OFÍCIO CIRCULAR

Revogado pelos Ofícios Circulares nº 042-2017-DP, de 26 de julho de 2017, e nº 036-2018-VOP, de 20 de julho de 2018

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

**Ref.: Disponibilização do Serviço de Registro e Política de Tarifação de Certificados de Depósito Bancário – CDB no Mercado de Balcão Organizado da BM&FBOVESPA.**

Em atendimento à demanda dos participantes e buscando ampliar e diversificar o portfólio de produtos e serviços disponíveis para o mercado, a BM&FBOVESPA informa que, a partir do dia 12/03/2014, disponibilizará o novo módulo do sistema **iBalcão** para registro, gerenciamento do ciclo de vida e liquidação de Certificados de Depósito Bancário - “CDB”, em conformidade com a Resolução CMN 3.454/2007.

O CDB é um título de renda fixa, negociável, que representa a promessa de pagamento em data futura do valor representativo do depósito a prazo, acrescido da rentabilidade convencionada. Os certificados são escriturais e nominativos aos respectivos detentores.

Com relação à estrutura de remuneração, poderão ser registrados CDB enquadrados nas modalidades pós ou prefixado.

Inicialmente, será aceito, na modalidade pós-fixado, o registro de CDB indexado à Taxa DI. Futuramente, a lista dos demais indexadores aceitos estará disponível no site [www.bmfbovespa.com.br/balcao](http://www.bmfbovespa.com.br/balcao).

O sistema de registro informará diariamente os valores referenciais atualizados dos CDB pós-fixados nele registrados.

O registro de CDB terá tratamento diferenciado pelo sistema conforme o tipo de emissão determinado no momento do registro. Em registros de CDB de emissão própria, o participante de registro emitente fará a inserção dos



011/2014-DP

.2.

dados do CDB e a identificação do titular. Neste caso, a liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros decorrentes deste registro ocorrerá diretamente entre o participante de registro e o titular do CDB, fora dos ambientes da BM&FBOVESPA.

Por sua vez, na hipótese de registros de CDB de emissão de mercado, após a inserção das informações pelo participante de registro emitente, será necessário o duplo comando pelo participante de registro proprietário. Nesse caso, a liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros decorrentes deste registro deverá, necessariamente, ser realizada no sistema de liquidação da BM&FBOVESPA, observando-se os horários estipulados no Capítulo VIII do Manual do Produto – CDB (Anexo I).

As demais especificações do produto, funcionalidades do sistema de registro e características para registro no sistema via tela ou arquivo, estão descritas no Manual do Produto – CDB (Anexo I) e no site [www.bmfbovespa.com.br/balcao](http://www.bmfbovespa.com.br/balcao).

### **Política de Tarifação de Certificado de Depósito Bancário (CDB)**

As tarifas abaixo relacionadas serão aplicadas somente ao participante de registro responsável pelo registro das operações, ainda que este seja um terceiro autorizado pelo emissor a registrar em seu nome ou que a operação envolva duplo comando (aquela em que há confirmação da contraparte).

#### **1. Taxa de Registro**

A Taxa de Registro incidirá sobre o valor de cada operação registrada, de acordo com o percentual e obedecido o valor mínimo estabelecidos na Tabela de Preços de Utilização do Sistema de Registro, constante do item 3 deste Ofício Circular. A taxa será apurada a cada operação registrada e cobrada no primeiro dia útil do mês subsequente ao do registro das operações.

#### **2. Taxa de Permanência**

A Taxa de Permanência incidirá sobre o volume financeiro atualizado das operações em estoque, de acordo com o percentual e obedecido o valor mínimos estabelecidos na Tabela de Preços de Utilização do Sistema de Registro, constante do item 3 deste Ofício Circular.



O referido percentual será aplicado sobre o volume financeiro atualizado do estoque apurado na abertura do primeiro dia útil de cada mês, de acordo com os limites de preço estabelecidos para a tarifa.

### Tabela de Preços de Utilização do Sistema de Registro

Serviço	Taxa	Mínimo (R\$)
Registro	0,00055% <sup>1</sup>	0,275
Permanência	0,00099% <sup>2</sup>	0,495 <sup>3</sup>

<sup>1</sup> Aplicada sobre o valor-base da operação na data de registro.

<sup>2</sup> Aplicada sobre o volume financeiro atualizado do estoque no primeiro dia útil de cada mês.

<sup>3</sup> O valor da permanência apurada ao mês por operação será comparado com o valor mínimo, sendo cobrado o maior entre os dois valores.

A BM&FBOVESPA poderá, a seu exclusivo critério, conforme o caso, aplicar para clientes e/ou grupos econômicos tarifas inferiores àquelas descritas no item 2, em função do volume de operações registradas e/ou negociadas na BM&FBOVESPA.

### 3. Transferência de titularidade

A transferência de titularidade será tarifada com os mesmos valores e regras aplicados a um novo registro no sistema, de acordo com os valores descritos no item 3.

As regras operacionais fazem parte do Manual do Usuário – CDB, disponível no site [www.bmfbovespa.com.br/balcao](http://www.bmfbovespa.com.br/balcao).

Vale ressaltar que não haverá cobranças por eventos como liquidação antecipada, cancelamento, retirada e correção. A correta utilização do sistema de registro evita reincidência de erros e problemas operacionais, sendo certo que tais situações serão acompanhadas pela área de monitoramento da BM&FBOVESPA. Eventuais abusos serão coibidos utilizando-se os dispositivos encontrados no regulamento de registro vigente.



011/2014-DP

.4.

Os valores das tarifas aqui apresentados serão corrigidos anualmente pelo Índice Geral de Preço do Mercado (IGP-M) a contar da data de início de sua vigência. A BM&FBOVESPA poderá, a qualquer momento e a seu critério, alterar os valores e regras da tarifação aqui divulgadas. As informações sobre tarifação podem ser encontradas no site [www.bmfbovespa.com.br](http://www.bmfbovespa.com.br), Custos e Tributos.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Registro de Operações de Mercado de Balcão, pelo telefone (11) 2565-4891 e com a Diretoria de Engenharia de Produtos e Serviços, pelos telefones (11) 2565-6132 e 2565-6514.

Atenciosamente,



Edemir Pinto  
Diretor Presidente



Eduardo Refinetti Guardia  
Diretor de Produtos e de Relações  
com Investidores



011/2014-DP

.5.

**ANEXO I  
MANUAL DO PRODUTO – CDB**

A handwritten signature in blue ink, consisting of several loops and flourishes.





## CDB - Certificado de Depósito Bancário

Versão 1.1

Fevereiro/2014



### iBalcão

BM&FBOVESPA  
A Nova Bolsa



**Sumário**

<b>CAPÍTULO I</b>	<b>INTRODUÇÃO.....</b>	<b>9</b>
<b>CAPÍTULO II</b>	<b>DO OBJETO .....</b>	<b>9</b>
<b>CAPÍTULO III</b>	<b>CARACTERÍSTICAS.....</b>	<b>9</b>
<b>CAPÍTULO IV</b>	<b>PAPÉIS E RESPONSABILIDADES .....</b>	<b>9</b>
<b>CAPÍTULO V</b>	<b>REGISTRO DE CDB .....</b>	<b>10</b>
<b>CAPÍTULO VI</b>	<b>INFORMAÇÕES PARA REGISTRO.....</b>	<b>11</b>
<b>CAPÍTULO VII</b>	<b>FUNCIONALIDADES DO SISTEMA .....</b>	<b>13</b>
<b>CAPÍTULO VIII</b>	<b>DOS HORÁRIOS.....</b>	<b>25</b>
<b>CAPÍTULO IX</b>	<b>DA ESTRUTURA DE CONTAS.....</b>	<b>25</b>
<b>CAPÍTULO X</b>	<b>DA TRANSFERÊNCIA DE TITULARIDADE DECORRENTE DE NEGOCIAÇÃO DE CDB.....</b>	<b>26</b>
<b>CAPÍTULO XI</b>	<b>DA LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA.....</b>	<b>26</b>
<b>CAPÍTULO XII</b>	<b>MECANISMOS DE CONTROLE .....</b>	<b>27</b>
<b>CAPÍTULO XIII</b>	<b>DA VALORIZAÇÃO DO CDB.....</b>	<b>28</b>





011/2014-DP

.8.

**DAS SIGLAS E DEFINIÇÕES**

As siglas e os termos a seguir listados, quando utilizados neste Manual de Produto, no singular ou no plural terão os significados abaixo e são válidas especificamente para este Manual.

Os demais termos e siglas que não possuem seus termos definidos abaixo se valem das definições constantes do Regulamento de Registro de Ativos e Operações do Mercado de Balcão Organizado da BM&FBOVESPA.

<b>CDB</b>	Certificado de Depósito Bancário.
<b>EMISSÃO DE MERCADO</b>	Emissão de CDB efetuada pelo Participante de Registro e distribuída a clientes de outro Participante de Registro.
<b>EMISSÃO PRÓPRIA</b>	Emissão de CDB efetuada pelo Participante de Registro e distribuída aos seus clientes.
<b>LIQUIDANTE</b>	Instituições cadastradas na câmara que utilizam suas Contas Reservas Bancárias ou Contas de Liquidação, mantidas junto ao Banco Central do Brasil, para efetuar ou receber os pagamentos referentes à Liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros decorrentes do Registro dos Ativos e das Operações no Sistema de Registro.
<b>MANUAL DO PRODUTO</b>	Manual para Registro de Certificado de Depósito Bancário na BM&FBOVESPA.
<b>REGULAMENTO</b>	Regulamento de Registro de Ativos e Operações do Mercado de Balcão Organizado da BM&FBOVESPA.
<b>TAXA DI</b>	Taxa média de depósitos interfinanceiros de um dia, expressa em taxa efetiva anual, base 252 (duzentos e cinquenta e dois) dias úteis.



## CAPÍTULO I INTRODUÇÃO

- 1.1 Este Manual do Produto é complemento do Regulamento, contendo as características, as funcionalidades e os procedimentos pertinentes ao Registro de CDB.
- 1.2 As comunicações de eventuais alterações a este Manual do Produto serão divulgadas ao mercado por meio de Ofício Circular, que conterá a versão atualizada deste documento. A versão atualizada estará disponível na página da BM&FBOVESPA na rede mundial de computadores.

## CAPÍTULO II DO OBJETO

- 2.1 O presente Manual do Produto tem por objeto disciplinar as atividades do Participante de Registro e da BM&FBOVESPA, exclusivamente no que diz respeito ao Registro, na forma da Resolução do Conselho Monetário Nacional (CMN) 3.454 do BCB.

## CAPÍTULO III CARACTERÍSTICAS

- 3.1 O CDB é um título de renda fixa, negociável que representa a promessa de pagamento em data futura do valor representativo do depósito a prazo, acrescido da rentabilidade convencionada. Os certificados são escriturais e nominativos aos respectivos detentores.
- 3.2 Com relação à estrutura de remuneração, o CDB pode ser enquadrado nas modalidades pós ou prefixado. No CDB pós-fixado, a rentabilidade é atrelada a um percentual pré-definido de um determinado indexador, que será um índice de preços ou uma taxa de juros flutuante. O CDB prefixado, por sua vez, é remunerado por uma taxa fixa, contratada pelo investidor no momento da aplicação, que será mantida independentemente de oscilações do mercado.

## CAPÍTULO IV PAPÉIS E RESPONSABILIDADES

- 4.1 O Participante de Registro pode assumir responsabilidades diferentes de acordo com o (s) papel (is) que exerça no Sistema de Registro.

**4.1.1. Participante de Registro emitente** - é o Participante de Registro que representa o emissor, sendo responsável por:

- a) Inserir informações dos Ativos no Sistema de Registro e pela veracidade de tais informações;



- b) Verificar a conformidade dos Ativos com a regulamentação e a legislação aplicáveis;
- c) Manter sob sua guarda e conservação os documentos representativos dos Ativos, legal e regularmente formalizados, devendo manter em sua posse a documentação comprobatória original pertinente;
- d) Verificar e responder pela autenticidade, existência, validade, legalidade e conformidade (i) dos Ativos e dos direitos creditórios e garantias a eles vinculados e (ii) das informações prestadas à BM&FBOVESPA acerca de tais Ativos.
- e) Verificar a autenticidade, legitimidade e poderes de representação dos signatários dos Ativos.

**4.1.2. Participante de Registro proprietário** - é o Participante de Registro que representa o Titular do Ativo, exercendo as seguintes funções:

- a) Validar o Registro efetuado pelo Participante de Registro emitente, identificando o Titular;
- b) Inserir as Movimentações, o Bloqueio e o Desbloqueio dos Ativos no Sistema de Registro;
- c) Verificar a autenticidade e legitimidade da cadeia de endossos dos Ativos;
- d) Verificar a autenticidade, legitimidade e poderes de representação dos signatários dos Ativos.

**4.1.3. Participante de Registro beneficiário** - é o Participante de Registro que representa o beneficiário em caso de bloqueio, sendo responsável por:

- a) Verificar a autenticidade, legitimidade e poderes de representação dos signatários dos Ativos.

## CAPÍTULO V REGISTRO DE CDB

**5.1** O Registro de CDB terá tratamento diferenciado pelo sistema conforme o tipo de emissão determinado no momento do Registro.

**5.1.1.** Em Registros de CDB de Emissão Própria, o Participante de Registro emitente fará a inserção dos dados do CDB e a identificação do Titular. Neste caso, a Liquidação financeira ocorrerá fora dos ambientes da BM&FBOVESPA.

**5.1.2.** Em Registros de CDB de Emissão de Mercado, após a inserção das informações pelo Participante de Registro emitente, será necessário o Duplo Comando pelo Participante de Registro proprietário e, necessariamente, a liquidação dos direitos e das obrigações em recursos



financeiros decorrentes deste Registro deverá ser realizada no Sistema de Liquidação, observando-se os horários estipulados no Capítulo VIII.

- 5.2** A aprovação do Registro que envolva Duplo Comando está condicionada à confirmação, pelo Participante de Registro proprietário, dos dados informados pelo Participante de Registro emitente e a identificação do Titular, sendo necessária a aprovação no mesmo dia de seu lançamento, observando-se os horários estipulados no Capítulo VIII.
- 5.3** O Sistema de Registro está apto a aceitar Registros de CDB nas modalidades pós-fixada indexado ao DI e prefixada.
- 5.4** O Sistema de Registro irá realizar o cálculo do preço unitário atualizado do CDB. O cálculo será realizado de acordo com a metodologia disposta no Capítulo XIII deste Manual do Produto.
- 5.5** A confirmação da efetivação do Registro ocorrerá pela atribuição de um código ao CDB, que será determinado pela BM&FBOVESPA e informado via mensagem ou tela.

## CAPÍTULO VI INFORMAÇÕES PARA REGISTRO

### 6.1 Registro do Título

**6.1.1.** O Registro do CDB no Sistema de Registro será efetuado mediante a inserção das informações abaixo pelo Participante de Registro emitente e pela validação do Participante de Registro proprietário, quando aplicável.

- a) **Registrador:** Participante de Registro emitente, conforme definido no Regulamento.
- b) **Título:** Participante de Registro emitente deve identificar o ativo objeto do registro.
- c) **Data de Registro:** É preenchida pelo Sistema de Registro com a data do dia que o Participante de Registro emitente efetuar o Registro.
- d) **Número Registrador:** Código de controle atribuído pelo Participante de Registro emitente.
- e) **Data Referência:** Data em que a Movimentação foi originada.
- f) **Data de Emissão:** Data da emissão do CDB, menor ou igual à data de Registro. Deve ser necessariamente dia útil.
- g) **Data de Vencimento:** Data do vencimento do CDB. Deve ser necessariamente dia útil e, no mínimo, um dia posterior à Data de Registro.





011/2014-DP

.12.

- h) **Tipo de Emissão:** Indica a relação entre o Emitente e o Titular do CDB. Deve ser preenchida com as modalidades “Própria” ou “Mercado”, conforme o caso.
- i) **Dados Emitentes:** Preenchimento da razão social e do CNPJ da instituição emissora do CDB, conforme disposto na Resolução CMN 3.454.
- j) **Registrador Proprietário:** Indicação do Participante de Registro proprietário, quando se tratar de Emissão de Mercado.
- k) **Dados do Proprietário:** Deve ser indicado o número de inscrição do CPF/CNPJ do Titular do CDB, natureza jurídica e nome.
- Nos casos de Emissão de Mercado devem-se seguir os procedimentos mencionados abaixo:
- (i) O Participante de Registro emitente deve indicar o Participante de Registro proprietário;
- (ii) O Participante de Registro proprietário deve indicar o Titular do CDB.
- l) **Tipo de Estrutura:** Estrutura de remuneração, conforme modalidades autorizadas pela BM&FBOVESPA.
- m) **Indexador:** Indexador do CDB.
- n) **Percentual do Indexador:** Percentual a ser aplicado sobre o indexador escolhido.
- o) **Quantidade:** Quantidade emitida de CDB.
- p) **PU:** Preço Unitário da emissão expresso em reais.
- q) **Taxa de Juros:** Taxa de juros do CDB.
- r) **Condição de Resgate:** Condição de resgate acordada entre o Emitente e o Titular do CDB. Este campo deve ser preenchido conforme especificações abaixo:
- (i) **Mercado:** Condições de mercado apuradas na data da Liquidação antecipada. É necessária a informação de uma data a partir da qual a antecipação é permitida.
- (ii) **Não há condição de resgate:** Indica que não foi pactuada, na emissão, condição para Liquidação antecipada.
- (iii) **Com condição de resgate específica:** O CDB possui condição específica previamente pactuada na emissão para o caso de ocorrência de Liquidação antecipada. É necessária a informação de uma data a partir da qual cada condição específica passa a ser permitida.
- s) **Data Início (Condição Resgate):** Data inicial considerada para remuneração da Condição de Resgate estipulada no ato do Registro. Este campo poderá ser replicado caso exista mais de um intervalo de Condição de Resgate.
- t) **Data Término (Condição Resgate):** Data de término considerada para remuneração da Condição de Resgate, estipulada no ato do Registro. Este campo poderá ser replicado caso exista mais de um intervalo de Condição de Resgate.





- u) **Percentual Condição de Resgate:** Percentual a ser aplicado com base na condição de resgate determinada. Este campo deve ser replicado caso exista mais de um intervalo de Condição de Resgate.
- v) **Juros Condição de Resgate:** Juros a serem aplicados com base na condição de resgate determinada. Este campo deve ser replicado caso exista mais de um intervalo de Condição de Resgate.
- w) **Informações Adicionais:** Informações adicionais do CDB.
- x) **Forma de Pagamento:** Forma de pagamento dos juros e do principal.
- y) **Critério de Cálculo:** Poderão ser escolhidos 252 dias úteis ou 360 dias corridos, de acordo com o tipo de estrutura.
- z) **Código ISIN:** International Securities Identification Number, definido na norma ISO 6166, caso aplicável.

6.1.2. Em caso de Migração, as informações abaixo serão necessárias:

- a) **Código Origem Título:** Número de identificação do CDB proveniente de outro sistema de registro autorizado pelo BCB.
- b) **Instituição Origem:** Identificação da instituição na qual o CDB foi previamente registrado.
- c) **Motivo:** Motivo da Migração.

Os campos abaixo serão calculados pelo Sistema de Registro com base nas informações inseridas pelo Participante de Registro no Sistema de Registro:

- a) **Valor de Emissão:** Valor financeiro da emissão calculado automaticamente pelo sistema com base na fórmula: PU (Preço Unitário) x Quantidade de Emissão.
- b) **Valor Atualizado:** Valor financeiro da emissão calculado e atualizado diariamente.
- c) **Valor Disponível:** Valor disponível para movimentações e resgates.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para o registro de CDB estão descritas no Anexo I – Leiaute de Registro CDB.

## CAPÍTULO VII FUNCIONALIDADES DO SISTEMA DE REGISTRO

- 7.1 As Movimentações, os Bloqueios e os Desbloqueios deverão ser refletidos no Sistema de Registro pelo Participante de Registro proprietário com a finalidade de cumprir o disposto no Regulamento. Para tanto, o ambiente permitirá a inserção das informações por meio das funcionalidades elencadas neste capítulo.





Quando um Registro, Movimentação, Bloqueio e Desbloqueio envolver Duplo Comando, este deverá ser realizado no mesmo dia de seu Registro, observando-se os horários estipulados no Capítulo VIII.

### **Liquidação antecipada**

Quando ocorrer a Liquidação antecipada total ou parcial do CDB, conforme condições pré-definidas no momento do Registro (item 6.1.1 subitem “r” Condição de Resgate), essa Liquidação deverá ser refletida no Sistema de Registro por meio da presente funcionalidade.

O valor financeiro da Liquidação antecipada é obtido pela multiplicação da quantidade liquidada pelo preço unitário, ambos informados pelo Participante de Registro.

Quando o registro de CDB for de Emissão de Mercado, o Participante de Registro proprietário será o responsável pelo comando da Liquidação antecipada e será necessário o Duplo Comando do Participante de Registro emitente. A Liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros decorrentes deste Registro será realizada no Sistema de Liquidação.

### *Informações para a Liquidação Antecipada*

A Liquidação antecipada do CDB no Sistema de Registro será efetuada mediante a inserção das seguintes informações pelo Participante de Registro proprietário:

- a) **Data Referência:** Data em que a Liquidação antecipada foi originada.
- b) **PU Liquidação:** PU da Liquidação antecipada.
- c) **Quantidade:** Quantidade liquidada antecipadamente.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para a Liquidação Antecipada do CDB estão descritas no Anexo II – Leiaute de Liquidação Antecipada.

### **7.1.2. Migração**

A Migração de Registro de CDB inicialmente registrado em outro sistema de registro autorizado pelo BCB, é caracterizada pelo preenchimento dos campos mencionados no item 6.1.2 deste Manual.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para a Migração de CDB estão descritas no Anexo I – Leiaute de Registro CDB.



### 7.1.3. Retirada

A Retirada deverá ser utilizada pelo Participante de Registro quando for necessária a Retirada total do CDB registrado no Sistema de Registro, por motivo de cancelamento ou transferência do CDB para outro sistema de registro autorizado pelo BCB.

Essa funcionalidade estará disponível a partir de D+0 do Registro do Ativo até D-1 do vencimento.

A Retirada será permitida somente para o CDB com status “liberado”, sendo obrigatório o preenchimento do campo “Justificativa”.

Adicionalmente, se tratando de um CDB de Emissão de Mercado, o Participante de Registro proprietário será o responsável pelo comando da Retirada e será necessário o Duplo Comando do Participante de Registro emitente.

#### *Informações para a Retirada*

A Retirada no Sistema de Registro será efetuada mediante a inserção das seguintes informações pelo Participante de Registro:

- a) **Data Referência:** Data em que a Retirada foi originada.
- b) **Justificativa:** Motivo que originou a Retirada.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para a Retirada estão descritas no Anexo III – Leiaute de Retirada.

### 7.1.4. Bloqueio

O Bloqueio deverá ser comandado pelo Participante de Registro proprietário para bloquear as quantidades totais ou parciais de um CDB no Sistema de Registro, desde que haja quantidade disponível e o status esteja como “liberado”.

No caso de Bloqueio que envolva Participante de Registro proprietário diferente do Participante de Registro beneficiário, será necessário o Duplo Comando. A aprovação está condicionada à confirmação, pelo Participante de Registro beneficiário, dos dados informados pelo Participante de Registro proprietário, sendo necessária a aprovação no mesmo dia do lançamento, observando-se os horários estipulados no Capítulo VIII.

O Sistema de Registro atribuirá um código de identificação para cada Bloqueio efetuado.

*Informações para o Bloqueio*

O Bloqueio no Sistema de Registro será efetuado mediante o registro das seguintes informações pelo Participante de Registro proprietário:

- a) **Data Referência:** Data em que o Bloqueio foi originado.
- b) **Número BVMF:** Número de controle atribuído ao Registro pelo Sistema de Registro.
- c) **Instituição Representante do beneficiário do Bloqueio:** Identificação do Participante de Registro que representará o Beneficiário do Bloqueio.
- d) **Identificação do beneficiário do Bloqueio:** Nome/Razão social e CPF/CNPJ do Beneficiário do Bloqueio.
- e) **Quantidade:** Quantidade parcial ou total do CDB a ser bloqueado.
- f) **Justificativa:** Motivo que originou o Bloqueio.

Para refletir o Bloqueio no Sistema de Registro, será obrigatório o preenchimento do campo “Justificativa” com uma das seguintes opções:

- a) Garantia perante terceiros;
- b) Ordens judiciais;
- c) Ordens administrativas; ou
- d) Margem de garantia BM&FBOVESPA.

As hipóteses relacionadas acima não são exaustivas e não limitam as possibilidades que podem resultar no Bloqueio do CDB. Outras formas de Bloqueio serão analisadas pela BM&FBOVESPA.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para o Bloqueio estão descritas no Anexo IV – Leiaute de Bloqueio.

### 7.1.5 Margem de Garantia

O proprietário do CDB será responsável por solicitar o gravame junto ao Emitente e requerer ao Participante de Registro seu Bloqueio no Sistema de Registro. Além disso, deverá solicitar sua utilização em garantia de acordo com os procedimentos estabelecidos pela área responsável na respectiva câmara de compensação e liquidação que confirmará o Bloqueio do CDB no Sistema de Registro.



### 7.1.6 Execução

A execução de um CDB bloqueado deverá ser realizada pelo Participante de Registro beneficiário, podendo o CDB ser executado total ou parcialmente, de acordo com o valor da execução.

*Informações para a execução:*

- a) **Data Referência:** Data da execução.
- b) **PU Operação:** Preço Unitário da execução.
- c) **Quantidade Executada:** Quantidade a ser executada.

Caso os Participantes de Registro envolvidos sejam diferentes, a liquidação dos direitos e obrigações em recursos financeiros decorrentes desta execução será realizada na BM&FBOVESPA e o crédito será direcionado para o Participante de Registro beneficiário.

Na hipótese de o Participante de Registro beneficiário ser, também, o Participante de Registro emitente, a Liquidação não ocorrerá no Sistema de Liquidação.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para a execução estão descritas no Anexo V– Leiaute de Execução.

### 7.1.7 Desbloqueio

O Desbloqueio deverá ser realizado pelo Participante de Registro para liberação da quantidade total ou parcial de um CDB previamente bloqueado.

O Desbloqueio será permitido somente para os títulos com status “bloqueado” ou “bloqueado parcialmente”.

No caso de Desbloqueio que envolva Participante de Registro beneficiário diferente do Participante de Registro proprietário, será necessário o Duplo Comando. A aprovação está condicionada à confirmação, pelo Participante de Registro beneficiário, dos dados informados pelo Participante de Registro proprietário, sendo necessária a aprovação no mesmo dia, observando-se os horários estipulados no Capítulo VIII.

*Informações para o Desbloqueio*

O Desbloqueio será efetuado mediante a inserção das seguintes informações pelo Participante de Registro proprietário:

- a) **Data Referência:** Data em que o Desbloqueio foi realizado.
- b) **Quantidade:** Quantidade parcial ou total do CDB a ser desbloqueado.
- c) **Código do Bloqueio:** Código de identificação atribuído pelo Sistema de Registro ao Bloqueio original a que esse Desbloqueio se refere (este código pode ser obtido por meio das funcionalidades de consulta do Sistema de Registro).

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para o Desbloqueio estão descritas no Anexo VI – Leiaute de Desbloqueio.

**7.1.8 Correção**

Mediante constatação de erro operacional no Registro, correções nas informações poderão ser realizadas por meio de pedido justificado à BM&FBOVESPA.

O Participante de Registro deverá encaminhar à BM&FBOVESPA, no prazo de 3 (três) dias úteis após a realização do Registro, o pedido de correção por escrito, assinado por seu(s) Representante(s) indicado(s) no ato de habilitação de acesso ao Sistema de Registro, identificando o número BVMF e a justificativa.

Todos os pedidos de correção estarão sujeitos à avaliação e aprovação pela diretoria da BM&FBOVESPA.



### 7.1.9 Transferência de Posição

A Transferência de Posição entre Participantes de Registro deverá ser refletida no Sistema de Registro e efetuada pelo Participante de Registro proprietário.

A Transferência de Posição do CDB no Sistema de Registro será efetuada mediante a inserção das seguintes informações pelo Participante de Registro:

- a) **Justificativa:** Motivo que originou a Transferência de Posição.
- b) **PU Operação:** Preço Unitário do Ativo a ser transferido.
- c) **Quantidade de Transferência:** Quantidade a ser transferida.
- d) **Participante de Registro proprietário Destino:** Participante de Registro que representa o cessionário da Transferência de Posição.
- e) **Valor da Operação:** Resultado da multiplicação da quantidade e do preço unitário, calculados pelo Sistema de Registro.

A transferência de posição refere-se à substituição de Participantes de Registro, sendo sempre necessário o Duplo Comando.

Para a Transferência de Posição não há liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros desta decorrente no Sistema de Liquidação.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para a Transferência de Posição estão descritas no Anexo VII – Leiaute Transferência.

### 7.1.10 Transferência de Titularidade

A Transferência de Titularidade de CDB registrado no Sistema de Registro deverá ser refletida pelo Participante de Registro proprietário.

A Transferência de Titularidade pode acarretar na Liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros desta decorrente, que será processada pelo Sistema de Liquidação, de acordo com as regras abaixo:

- (i) **Liquidações que deverão ser processadas pela BM&FBOVESPA:**
  - a) Negociação entre as partes (Mercado).
- (ii) **Liquidações não processadas pela BM&FBOVESPA:**
  - a) Negociação entre as partes (Própria);
  - b) Doação; e
  - c) Caso envolvam o mesmo Participante de Registro



011/2014-DP

.20.

- (iii) **Liquidações com opção de serem processadas pela BM&FBOVESPA:**
- a) Cessão;
  - b) Sucessão;
  - c) Operação de fusão, incorporação, cisão, ou, ainda, de alienação de controle do Titular dos Ativos.

A Transferência de Titularidade que envolver Participantes de Registros diferentes necessitará de Duplo Comando do novo Participante de Registro proprietário, que será o responsável por indicar os dados do novo Titular.

Caso a Transferência de Titularidade envolva a Liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros desta decorrente na BM&FBOVESPA esta será refletida no Sistema de Registro por comando do Sistema de Liquidação.

A Transferência de Titularidade será efetuada mediante a inserção das seguintes informações pelo(s) Participante(s) de Registro Proprietário:

- a) **Justificativa:** Motivo que originou a Transferência de Titularidade.
- b) **Identificação do Novo Titular:** Nome/razão social e CPF/CNPJ do novo Titular.
- c) **PU Operação:** Preço unitário referente ao Ativo a ser transferido.
- d) **Quantidade Transferência:** Quantidade a ser transferida.
- e) **Liquidação Financeira:** Conforme item 7.1.10, subitens i, ii e iii.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para a Troca de Titularidade estão descritas no Anexo VII – Leiaute de Transferência.

### 7.1.11 Vencimento

Na data do vencimento, o Emitente do CDB deverá honrar suas obrigações perante o Titular. Nesta data, o Sistema de Registro irá atualizar o status do CDB e, quando o Participante de Registro emitente for diferente do Participante de Registro proprietário, a Liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros decorrentes deste vencimento ocorrerá no Sistema de Liquidação.

Quando do vencimento de um CDB bloqueado, a Liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros decorrentes deste vencimento será realizada pelo Sistema de Liquidação e o crédito será direcionado para o Participante de Registro do beneficiário somente nos casos em que este for diferente do Participante de Registro emitente.

O CDB vencido ficará disponível para consulta no Sistema de Registro por um prazo de 30 (trinta) dias corridos, com a indicação de sua condição de vencido.



Findo referido prazo, as informações estarão disponíveis para consulta mediante solicitação do Participante de Registro à BM&FBOVESPA.

### 7.1.12 Tratamento por Arquivo

Os Registros e Movimentações podem ser realizados (i) diretamente nas telas do sistema ou (ii) por arquivos, que deverão ser enviados pelo Participante de Registro, observadas suas atribuições, e processados pelo Sistema de Registro.

Para cada arquivo enviado pelo Participante de Registro e recebido pela BM&FBOVESPA será gerado o arquivo de retorno informando a confirmação do recebimento ou o código de erro.

O formato dos arquivos segue o padrão XML e a forma de transmissão será via Sistema de Monitoração de Transferência de Arquivos (MTA), que utiliza a tecnologia XFB (software de troca de arquivos) e tem como finalidade o envio e a recepção de arquivos de forma ágil, interativa e monitorada.

Para que o Participante de Registro possa efetuar a troca de arquivos nos formatos pré-definidos, a BM&FBOVESPA disponibiliza os Leiautes através da rede mundial de computadores.

### 7.1.13 Conciliação

A BM&FBOVESPA fornecerá arquivos diários, que permitam aos Participantes de Registro conciliar as posições registradas no Sistema de Registro e suas movimentações.

Nos casos de CDB com Emissão de Mercado, os Participantes de Registro envolvidos receberão arquivos com campos de informação de acordo com seu papel e responsabilidade.

#### 7.1.13.1 Conciliação de Posição

O arquivo de conciliação de posição contém as informações descritas abaixo:

- a) **Número Título do Registrador:** Número de controle atribuído pelo Participante de Registro.



- b) **Número BVMF:** Número de controle atribuído ao Registro pelo Sistema de Registro.
- c) **Número BVMF Origem:** Número originalmente atribuído pelo Sistema de Registro ao CDB que tenha sofrido troca de Titularidade parcial.
- d) **Data Referência:** Data em que a Movimentação foi originada.
- e) **Data de Registro:** Data da inserção do Registro no Sistema de Registro.
- f) **Data de Emissão:** Data da emissão do Ativo.
- g) **Data de Vencimento:** Data do vencimento do Ativo.
- h) **Situação do Título:** Situação do Ativo (liberado, bloqueado, etc.).
- i) **Documento Emitente:** CNPJ do Emitente do Ativo.
- j) **Documento Proprietário:** CPF/CNPJ do Titular do Ativo.
- k) **Tipo Estrutura:** Estrutura de remuneração, conforme modalidades autorizadas pela BM&FBOVESPA.
- l) **Indexador:** Indexador do Ativo.
- m) **Percentual do Indexador:** Percentual a ser aplicado sobre o indexador escolhido.
- n) **Taxa de Juros:** Taxa de juros do Ativo.
- o) **Valor de Resgate:** Soma do valor da emissão com a remuneração da taxa de juros pré-determinada. Aplica-se somente para CDB prefixado.
- p) **Condição de Resgate:** Condição de resgate acordada entre o Emitente e o Titular do CDB.
- q) **Quantidade Emissão:** Quantidade emitida do CDB.
- r) **Critério de Cálculo:** 252 dias úteis ou 360 dias corridos, de acordo com o tipo de estrutura.
- s) **PU Emissão:** Preço Unitário da emissão expresso em reais.
- t) **Valor de Emissão:** Valor financeiro da emissão do CDB.
- u) **Quantidade Atualizada:** Quantidade atualizada do CDB. É a soma da Quantidade Disponível com a Quantidade Bloqueada, se houver.
- v) **PU Atualizado:** Preço Unitário do CDB, atualizado diariamente.
- w) **Valor Atualizado:** Valor financeiro do CDB atualizado diariamente.
- x) **Quantidade Resgatada:** Soma da(s) quantidade(s) resgatada(s) do CDB.
- y) **Quantidade Disponível:** Quantidade disponível para movimentação do CDB.
- z) **Quantidade Bloqueada:** Soma da(s) quantidade(s) que reflete(m) a(s) informação(ões) de Bloqueio do CDB.
- aa) **Forma de Pagamento:** Forma de pagamento dos juros e do principal.
- bb) **ISIN:** International Securities Identification Number, definido na norma ISO 6166, caso aplicável.



- cc) **Título Migrado:** Indicação se o Registro é proveniente de Migração.
- dd) **Instituição Origem:** Identificação da instituição na qual o Ativo foi previamente registrado (quando se tratar de Migração).
- ee) **Código Origem Título:** Número de identificação do Ativo proveniente de outro sistema de registro autorizado pelo BCB (quando se tratar de Migração).
- ff) **Informações Adicionais:** Informações adicionais do Registro.

### 7.1.13.2 Conciliação de Movimentação

O arquivo de conciliação de Movimentação demonstra os movimentos diários realizados no CDB, conforme abaixo:

- a) Registro;
- b) Migração;
- c) Liquidação antecipada;
- d) Bloqueio;
- e) Desbloqueio;
- f) Retirada;
- g) Execução;
- h) Vencimento;
- i) Troca de Titularidade.

O arquivo contempla as seguintes informações:

- a) **Tipo de Título:** CDB
- b) **Número BVMF:** Número de controle atribuído ao Registro pelo Sistema de Registro.
- c) **Número BVMF Origem:** Número originalmente atribuído pelo Sistema de Registro ao CDB que tenha sofrido troca de Titularidade parcial.
- d) **Número Título do Registrador:** Número de controle atribuído pelo Participante de Registro.
- e) **Situação:** Status do Ativo.
- f) **Data de Registro:** Data da inserção da Movimentação no Sistema de Registro.
- g) **Data Referência:** Data em que a Movimentação foi originada.
- h) **Data de Vencimento:** Data do vencimento do Ativo.
- i) **Código Origem Título:** Número de identificação proveniente de outro sistema de registro autorizado pelo BCB (quando se tratar de Migração).
- j) **Instituição Origem:** Identificação da instituição na qual o Ativo foi previamente registrado (quando se tratar de Migração).
- k) **Cedente:** CPF/CNPJ do Cedente da Movimentação.



- l) **Participante Cedente:** CNPJ do Participante de Registro que representa o Cedente.
- m) **Cessionário:** CPF/CNPJ do Cessionário da Movimentação
- n) **Participante Cessionário:** CNPJ do Participante de Registro que representa o Cessionário.
- o) **PU Operação:** Preço Unitário referente à Movimentação realizada.
- p) **Quantidade:** Quantidade referente à Movimentação realizada.
- q) **Valor Financeiro:** Valor financeiro da Movimentação realizada.
- r) **Código do Bloqueio:** Número de identificação do Bloqueio. Aplica-se somente às Movimentações referentes a Bloqueio ou Desbloqueio.
- s) **Data Operação Original:** Data do Bloqueio original a que se refere a Movimentação de Desbloqueio.
- t) **Justificativa:** Justificativa da Movimentação realizada. Aplica-se somente aos movimentos de Bloqueio, Retirada, Execução e Troca de Titularidade.

**CAPÍTULO VIII DOS HORÁRIOS**

**8.1.** Para Registros e Movimentações que impliquem ou não na Liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros decorrentes destes Registros e Movimentações consideram-se os seguintes horários:

**8.1.1.** Sistema de Registro estará disponível nos dias úteis, das 8h às 20h, de acordo com o calendário nacional.

**8.1.2.** O Sistema de Registro estará disponível das 8h às 16h30 para o lançamento de Registros e Movimentações que impliquem em Liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros decorrentes destes Registros e Movimentações, quais sejam:

- a) Registro de Emissões de Mercado;
- b) Liquidação antecipada de Registros de Emissão de Mercado;
- c) Execução de Títulos bloqueados que envolva Participantes de Registro diferentes;
- d) Transferência de Titularidade entre Participantes de Registro diferentes, conforme definido no item 7.1.10.

**8.1.3.** O Sistema de Registro estará disponível das 8h às 16h45 para realização do Duplo Comando de Registros e Movimentações que impliquem em Liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros decorrentes destes Registros e Movimentações, conforme abaixo:

- a) Registro de Emissões de Mercado;
- b) Liquidação antecipada de Registros de Emissão de Mercado;
- c) Execução de Títulos bloqueados que envolva Participantes de Registro diferentes;
- d) Transferência de Titularidade entre Participantes de Registro diferentes, conforme definido no item 7.1.10.

**8.1.4.** Nos casos de Registros e Movimentações mencionados no item 8.1.3 no qual o Participante de Registro não realize o Duplo Comando até o horário limite estipulado, os Registros e/ou Movimentações serão desconsiderados pelo Sistema de Registro.

**CAPÍTULO IX DA ESTRUTURA DE CONTAS**

**9.1** O CDB registrado no Sistema de Registro será identificado por Titular pelo preenchimento do campo descrito na alínea "k" do item 6.1.1, não havendo estrutura de contas individualizadas e não individualizadas por Participante de Registro





## **CAPÍTULO X DA TRANSFERÊNCIA DE TITULARIDADE DECORRENTE DE NEGOCIAÇÃO DE CDB.**

**10.1** O Participante de Registro deverá refletir, no Sistema de Registro, a Transferência de Titularidade do CDB decorrente de negociação, conforme comunicação do Titular sobre negociação por ele realizada. .

## **CAPÍTULO XI DA LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA**

**11.1.** A liquidação dos direitos e das obrigações em recursos financeiros podem decorrer das seguintes hipóteses relacionadas aos Ativos e às Operações registrados no Sistema de Registro:

### **11.1.1** No caso de Liquidação Bruta em Tempo Real

- (i) A liquidação financeira representa a liquidação em tempo real de transação por transação;
- (ii) Enquadram-se nesta modalidade de liquidação financeira no Sistema de Liquidação da BM&FBOVESPA as transações envolvendo:
  - a) Registro de Emissão de Mercado;
  - b) Transferência de Titularidade (conforme item 7.1.10);
  - c) Liquidação antecipada de Emissão de Mercado;
  - d) Execução de títulos bloqueados que envolva Participantes de Registro diferentes;
  - e) Vencimento de CDB de Emissão de Mercado e/ou bloqueado, em caso de Participante de Registro que não tenha cumprido com o pagamento dentro do horário estabelecido para Liquidação por compensação pelo saldo líquido bilateral.
- (iii) A Liquidação financeira dessas transações ocorrerá até as 17h30 no Sistema de Liquidação;
- (iv) Caso os Participantes de Registro envolvidos não efetuem os devidos pagamentos nas janelas de Liquidação divulgadas pela BM&FBOVESPA, as transações não serão efetivadas.

### **11.1.2** No caso de Liquidação por compensação pelo saldo líquido bilateral

- (i) No período determinado, o processo de compensação bilateral agrupa e soma todas as instruções de pagamento envolvendo as mesmas contrapartes, resultando, para cada participante, uma posição líquida devedora ou credora;
- (ii) Serão liquidadas no Sistema de Liquidação as transações de vencimento de CDB, conforme item 7.1.11. A grade horária para esta Liquidação será:





- a) **11h15** – Sistema de Liquidação informa o resultado do saldo líquido da compensação bilateral;
  - b) **12h15** – Horário limite para o Liquidante do Participante de Registro efetuar o pagamento do débito;
  - c) **A partir das 12h45** – Tratamento dos pagamentos não realizados dentro da janela e Liquidação individual das transações decorrentes do vencimento do CDB na modalidade bruta; e
  - d) **17h30** – Horário limite para os pagamentos dos débitos referentes à Liquidação bilateral.
- 11.2.** O pagamento dos recursos financeiros decorrentes do resultado do(s) saldo(s) líquido(s) da compensação bilateral será refletido no Sistema de Registro em tempo real.
- 11.3.** O Participante de Registro que não efetuar o pagamento dentro da grade horária estabelecida para Liquidação, poderá ser considerado Devedor Operacional.
- 11.4.** O não cumprimento das obrigações relativas à Liquidação de CDB poderá ensejar as consequências previstas no Capítulo VIII do Regulamento
- 11.5.** A BM&FBOVESPA não é contraparte central garantidora para as os casos de liquidação apresentados neste Manual.

## CAPÍTULO XII MECANISMOS DE CONTROLE

- 12.1.** A BM&FBOVESPA realizará o acompanhamento das informações inseridas no Sistema de Registro, a fim de identificar eventuais discrepâncias e indícios de fraude.
- 12.2.** Sem prejuízo de outros dados que a BM&FBOVESPA entender relevante monitorar, os principais parâmetros a serem considerados pelos mecanismos de controle são:
- a) Remuneração do CDB (evolução PU x Quantidade);
  - b) Indexador e percentual aplicado;
  - c) Volume financeiro (ticket médio);
  - d) Prazo;
  - e) Concentração de Registros em Titular específico;
  - f) Média de operações diárias;
  - g) Aditamento;
  - h) Liquidação antecipada;
  - i) Cessão de direito;
  - j) Migração.

MISTO  
Instrumentos de Arrendar com Anuidades  
por Pequenos Produtores ou Comunidades  
FSC® C 108556



011/2014-DP

.28.

- 12.3.** Sempre que forem identificadas inconsistências nas informações inseridas no Sistema de Registro, quando comparadas aos movimentos de mercado, ao cenário macroeconômico ou ao histórico de atipicidades, a BM&FBOVESPA comunicará o Participante de Registro responsável, conforme o caso, que deverá realizar os ajustes cabíveis e/ou apresentar as justificativas aplicáveis.
- 12.4.** Na hipótese de reincidência ou de as providências adotadas pelo Participante de Registro não serem suficientes para sanar ou justificar a inconsistência identificada, a BM&FBOVESPA notificará o administrador tecnicamente responsável pela atividade de Registro, para reiterar a necessidade de apresentação de justificativas ou de serem realizados ajustes nas informações inseridas no Sistema de Registro.
- 12.5.** A BM&FBOVESPA, sempre que entender necessário, submeterá o caso para apreciação do Comitê do Mercado de Balcão, que analisará a atipicidade identificada e deliberará sobre a conduta a ser adotada pela BM&FBOVESPA no caso concreto.
- 12.6.** Sem prejuízo de adoção das medidas acima previstas, a BM&FBOVESPA poderá comunicar o fato ao BCB, à CVM e/ou à BSM, de acordo com as respectivas esferas de supervisão, podendo a BM&FBOVESPA requerer à BSM a realização de auditoria, para que esta verifique a robustez dos processos internos do Participante de Registro.
- 12.7.** Todos os relatórios periódicos contendo as atipicidades identificadas serão direcionados ao BCB.
- 12.8.** Em caso de Retirada, serão adotados procedimentos para acompanhamento da justificativa apresentada.

## CAPÍTULO XIII DA VALORIZAÇÃO DO CDB

### 13.1. CDB Pós-fixado indexado à Taxa DI

**13.1.1.** O valor principal do CDB será atualizado diariamente entre a data de emissão e a data de avaliação, conforme os parâmetros definidos abaixo:

- a) Indexador:** Taxa DI, calculada e divulgada diariamente pela CETIP, em percentual ao ano, base 252 dias úteis.
- b) Periodicidade:** A periodicidade de apropriação de juros será por dias úteis, a partir da data de emissão até a data da apuração.



011/2014-DP

.29.

- c) **Critério de cálculo para o pagamento de taxa de juros ou spread:** anual, 252 dias úteis.
- d) **Forma de Pagamento:** Pagamento de juros e principal no vencimento ou no resgate antecipado.

### 13.2. Metodologia de cálculo para atualização de CDB Pós-fixado indexado à Taxa DI

13.2.1. O Sistema de Registro informará diariamente os valores referenciais atualizados dos CDB Pós-fixados indexados à Taxa DI nele registrados.

#### 13.2.2 Cálculo do fator diário

$$\text{Fator}_{\text{diário}} = \left( \frac{\text{taxa}_{DI}}{100} + 1 \right)^{\frac{1}{252}} - 1$$

#### Precisões de cálculo

$\text{Taxa}_{DI}$  = Taxa do dia informada com 2 (duas) casas decimais.

$\frac{1}{252}$ : Termo a ser considerado com 9 (nove) casas decimais sem arredondamento.

$1 + \frac{\text{Taxa}_{DI}}{100}$ : Termo a ser considerado com 6 (seis) casas decimais sem arredondamento.

$\left( 1 + \frac{\text{Taxa}_{DI}}{100} \right)^{\frac{1}{252}} - 1$ : Termo a ser considerado com 9 (nove) casas decimais com arredondamento.

O resultado deste cálculo será truncado na 8ª (oitava) casa decimal.

#### 13.2.3 Cálculo do fator acumulado

$$\text{Fator}_{\text{acumulado}} = \left( \frac{1 + \text{Fator}_{\text{diário } 1 \%DI}}{100} \right) \times \left( \frac{1 + \text{Fator}_{\text{diário } 2 \%DI}}{100} \right) \dots \times \left( \frac{1 + \text{Fator}_{\text{diário } n \%DI}}{100} \right)$$

$\%DI$  = percentual da taxa do dia informada com 2 (duas) casas decimais.

Ao aplicar o fator diário o resultado será truncado na 16ª (décima sexta) casa decimal e será aplicado o próximo fator diário, até o último fator diário considerado.

O resultado do fator acumulado será arredondado na 8ª (oitava) casa decimal.



011/2014-DP

.30.

### 13.2.4 O cálculo de atualização do PU

$$PU\ 252 = \left( \text{fator acumulado} \times PU\ Emissão \times \left( 1 + \frac{tx\text{juros}}{100} \right)^{\frac{du}{252}} \right)$$

**du** = Dias úteis entre a data de referência e a data da emissão.

**txjuros** = Taxa de juros informada no Registro.

#### Precisões de cálculo

**fator acumulado** : Termo a ser considerado com 8 (oito) casas decimais com arredondamento.

$\frac{du}{252}$  : Termo a ser considerado com 9 (nove) casas decimais sem arredondamento.

$1 + \frac{tx\text{juros}}{100}$  : Termo a ser considerado com 6 (seis) casas decimais sem arredondamento.

$\left( 1 + \frac{tx\text{juros}}{100} \right)^{\frac{du}{252}}$  : Termo a ser considerado com 9 (nove) casas decimais com arredondamento.

$\text{fator acumulado} \times \left( 1 + \frac{tx\text{juros}}{100} \right)^{\frac{du}{252}}$  : Termo a ser considerado com 9 (nove) casas decimais com arredondamento.

O resultado do cálculo do PU 252 (Atualizado) será arredondado na 8ª (oitava) casa decimal.

### 13.2.5 Cálculo do Valor Atualizado

$$\text{Valor Atualizado} = (PU\ 252 \times \text{Quantidade Atualizada})$$

O resultado do cálculo acima será truncado na 2ª (segunda) casa decimal.

### 13.3 CDB Prefixado

O valor principal de um CDB prefixado será atualizado diariamente entre a data de emissão e a data de avaliação, conforme os parâmetros definidos abaixo:

a) **Taxa de Juros:** Taxa de juros que remunera o CDB.



**b) Periodicidade:** A periodicidade de apropriação de juros será por dias úteis ou corridos, conforme critério estabelecido, a partir da data de emissão até a data da apuração.

**c) Critério de cálculo para o pagamento de taxa de juros ou spread:** anual, 252 dias úteis ou 360 dias corridos.

### 13.3.1 Metodologia de cálculo para atualização de CDB prefixado:

#### **Cálculo do fator Acumulado (critério 252):**

$$Fator_{acumulado\ 252} = \left(1 + \frac{i_{252}}{100}\right)^{\frac{du}{252}}$$

**du** = Dias úteis entre a data de referência e a data da emissão.

$\frac{i_{252}}{100}$  = Taxa de juros informada no Registro.

#### **Precisões de cálculo:**

$Fator_{acumulado\ 252}$ : Termo a ser considerado com 8 (oito) casas decimais com arredondamento.

$\frac{du}{252}$ : Termo a ser considerado com 9 (nove) casas decimais sem arredondamento.

$1 + \frac{i_{252}}{100}$ : Termo a ser considerado com 6 (seis) casas decimais sem arredondamento.

$\left(1 + \frac{i_{252}}{100}\right)^{\frac{du}{252}}$  Termo considerado com 9 (nove) casas decimais com arredondamento.

#### **Cálculo do Valor Atualizado:**

$$V_A = (PU_{Emiss} \times Fator_{acumulado\ 252})$$

$V_A$  = Valor Atualizado.

$PU_{Emiss}$ : PU Emissão.

**Fator acumulado 252:** Fator acumulado considerando o número de dias úteis entre a data de referência e a data da emissão



O resultado do cálculo acima será truncado na 2ª (segunda) casa decimal.

### **13.3.2 Cálculo do fator Acumulado (critério 360):**

$$Fator_{acumulado\ 360} = \left(1 + \frac{i_{360}}{100}\right)^{\frac{dc}{360}}$$

**dc** = Dias corridos entre a data de referência e a data da emissão.

$\frac{i_{360}}{100}$  = Taxa de juros informada no Registro.

#### **Precisões de cálculo:**

**Fator<sub>acumulado 360</sub>**: Termo a ser considerado com 8 (oito) casas decimais com arredondamento.

$\frac{dc}{360}$ : Termo a ser considerado com 9 (nove) casas decimais sem arredondamento.

$1 + \frac{i_{360}}{100}$ : Termo a ser considerado com 6 (seis) casas decimais sem arredondamento.

$\left(1 + \frac{i_{360}}{100}\right)^{\frac{dc}{360}}$  Termo considerado com 9 (nove) casas decimais com arredondamento.

#### **Cálculo do Valor Atualizado**

$$V_A = (PU_{Emiss} \times Fator_{acumulado\ 360})$$

**V<sub>A</sub>** = Valor Atualizado.

**PU<sub>Emiss</sub>**: PU Emissão.

**Fator<sub>acumulado 360</sub>**: Fator acumulado considerando o número de dias corridos entre a data de referência e a data da emissão

O resultado do cálculo acima será truncado na 2ª (segunda) casa decimal.

**ANEXO I AO MANUAL DO PRODUTO CDB**

<b>LEIATE DE REGISTRO CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
Registrador	– Campo alfanumérico – Tamanho: até 4 caracteres	Campo Obrigatório	Quando o Registro for via arquivo, o Sistema de Registro efetuará a validação se o código informado está de acordo com o cadastro do participante. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Tipo título	– Campo Numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá selecionar o CDB. Quando o Registro for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Tipo de Título. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Número Título Registrador	Campo alfanumérico Tamanho: até 15 caracteres	Campo Opcional	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo de livre descrição no qual o participante deverá preencher o número de controle interno do CDB. Quando o Registro for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Data Referência	- Campo Numérico - Tamanho: 8 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data Referência do registro do CDB no ambiente do participante, quando o Registro for via arquivo este campo seguirá a formatação AAAAMMDD. A Data de Referência só pode ser igual ou anterior à data de Emissão, caso o participante não cumpra essa regra ou não a preencha, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.



LEIAUTE DE REGISTRO CDB			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Data Emissão	- Campo Numérico - Tamanho: 8 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data da Emissão do CDB, quando o Registro for via arquivo este campo seguir a formatação AAAAMMDD. A Data de Emissão só pode ser igual ou anterior à data do Registro, caso o participante não cumpra essa regra ou não a preencha, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Data de Vencimento	- Campo Numérico - Tamanho: 8 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data de Vencimento do CDB, quando o Registro for via arquivo este campo seguir a formatação AAAAMMDD. A Data de Vencimento deverá ser pelo menos D+1 da Data de Registro, caso o participante não cumpra essa regra ou o campo não seja preenchido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Tipo Emissão	- Campo Numérico - Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação estará separada em 2 telas: uma para emissão própria e outra para mercado. Quando o Registro for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Tipo de Emissão. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Emitente	- Campo numérico - Tamanho: 14 caracteres	Campo Obrigatório	Neste campo, o participante deverá informar o CNPJ do Emitente do CDB. Caso o CNPJ informado seja inválido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Registrador Proprietário	- Campo numérico - Tamanho: 14 caracteres	Campo Obrigatório para Emissão de Mercado	No Registro via tela, esta informação será apresentada no formato de <i>combobox</i> , no qual o Participante de Registro deverá informar o Registrador Proprietário do CDB. Quando o Registro for via arquivo este campo deve ser informado o CNPJ do Registrador Proprietário do CDB. Caso o CNPJ informado seja inválido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.





LEIAUTE DE REGISTRO CDB			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Proprietário	– Campo numérico – Tamanho: 11 ou 14 caracteres (depende do tipo de natureza do Proprietário)	Campo Obrigatório	Neste campo, o participante deverá informar o CPF/CNPJ do Proprietário do CDB. Caso o documento informado seja inválido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Tipo de Estrutura	– Campo numérico – Tamanho: 3 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro por tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá informar o tipo da estrutura do CDB. No Registro por arquivo, este campo deve ser informado no formato numérico (até 3 caracteres). No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Indexador	– Campo numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, a informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá informar o tipo de Indexador que remunera o CDB. No Registro via arquivo, este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Indexador. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Percentual Indexador	– Campo numérico – Tamanho: 5,4 caracteres	Campo Obrigatório somente para CDB pós-fixada	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar o Percentual do Indexador que remunera o CDB. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Quantidade	– Campo numérico – Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico de até 15 caracteres, no qual o participante deverá informar a quantidade emitida do CDB. Quando o Registro for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.



LEIAUTE DE REGISTRO CDB			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
PU	– Campo numérico – Tamanho: até 15,8 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico no formato 15,8, no qual o participante deverá informar o PU da emissão do CDB. Quando o Registro for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Taxa de Juros	– Campo numérico – Tamanho: até 5,4 caracteres	Campo Opcional	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a taxa do CDB. Quando o Registro for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No Registro de um CDB pós-fixado, a informação deste campo é opcional. No Registro de um CDB prefixado, o participante deve informar a Taxa de Juros ou o valor de resgate para que o Sistema de Registro possa efetuar os devidos cálculos do CDB. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Condição de Resgate	- Campo numérico - Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> no qual o participante deverá selecionar a Condição de Resgate do pagamento do CDB, quando o Registro for via arquivo este campo deve ser informado por meio do domínio que identifica a respectiva Condição de Resgate. Quando selecionado as opções de Condição Mercado (I) ou Condição Específica (III) o participante deverá informar a(s) respectiva(s) data(s) a serem consideradas para resgate e o(s) respectivo(s) percentual(is) da Condição de Resgate e/ou os Juros da Condição de Resgate (se houver). Em casos de informação incorreta ou não preenchida o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.



LEIAUTE DE REGISTRO CDB			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Data Início (Condição de resgate)	- Campo numérico - Tamanho:8 caracteres	Campo Obrigatório *Somente quando a Condição de Resgate selecionada for I e III.	No Registro via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data de Início da Condição de Resgate, quando o Registro for via arquivo este campo deve seguir a formatação AAAAMMDD. A Data de Início da Condição de resgate deverá ser informada quando selecionado as opções de Condição de Resgate I e III. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Data Término (Condição de resgate)	- Campo numérico - Tamanho:8 caracteres	Campo Obrigatório *Somente quando a Condição de Resgate selecionada for I e III.	No Registro via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data de Término da Condição de Resgate, quando o Registro for via arquivo este campo deve seguir a formatação AAAAMMDD. A Data de Término da Condição de resgate deverá ser informada quando selecionado as opções de Condição de Resgate I e III. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Percentual Condição de Resgate	- Campo Numérico - Tamanho: até 5,4 caracteres	Campo Obrigatório *Somente quando a Condição de Resgate selecionada for I e III.	No Registro via tela essa informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar o Percentual da Condição de Resgate selecionada tenha sido I ou III. Quando o Registro for via arquivo este campo seguirá a mesma formatação. Caso o participante tenha mencionado as Condições de Resgate I ou III e não informe o campo Percentual Condição Resgate ou preencha o campo no formato incorreto o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.



LEIAUTE DE REGISTRO CDB			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Juros Condição de Resgate	- Campo Numérico - Tamanho: até 5,4 caracteres	Campo Opcional	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico, no qual o participante deverá informar a Taxa de Juros da Condição de Resgate (se houver). Quando o Registro for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. A informação deste campo é opcional. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Informações Adicionais	- Campo alfanumérico - Tamanho: até 100 caracteres	Campo Opcional	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo de livre descrição no qual o participante deverá preencher as Informações Adicionais do CDB (se houver). Quando o Registro for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Forma de Pagamento	- Campo Numérico - Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá selecionar a Forma de Pagamento do CDB. Quando o Registro for via arquivo, este campo deve ser informado através do domínio que identifica a respectiva Forma de Pagamento. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Critério de Cálculo	- Campo Numérico - Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá selecionar o Critério a ser adotado no cálculo do CDB. Quando o Registro for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Critério de Cálculo. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.



LEIAUTE DE REGISTRO CDB			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Código ISIN	– Campo alfanumérico – Tamanho: 12 caracteres	Campo Opcional	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo alfanumérico, no qual o participante deverá informar o ISIN do CDB (se houver). Quando o Registro for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Código Origem Título	– Campo alfanumérico – Tamanho: até 20 caracteres	Campo Obrigatório *somente em Registros migrados	Esta informação só deverá ser preenchida se o participante indicar que o Registro está vindo de outro Sistema de Registro (Migração). No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo de livre descrição no qual o participante deverá informar o Código de origem do CDB. Quando o Registro for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. Caso o Registro não tenha sido indicado como Migrado ou o participante preencha o campo de maneira incorreta, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Instituição Origem	– Campo numérico – Tamanho: 2 caracteres	Campo Obrigatório *somente em Registros migrados	Esta informação só deverá ser preenchida se o participante indicar que o Registro está vindo de outro Sistema de Registro (Migração). No Registro via tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá selecionar a Instituição origem na qual o CDB estava registrada previamente. Quando o Registro for via arquivo, este campo deve ser informado através do domínio que identifica a respectiva Instituição origem. Caso o Registro não tenha sido indicado como Migrado ou o participante preencha o campo de maneira incorreta, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.



LEIAUTE DE REGISTRO CDB			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Motivo	- Campo alfanumérico - Tamanho: 50 caracteres	Campo Obrigatório *somente em Registros migrados	Esta informação só deverá ser preenchida se o participante indicar que o Registro está vindo de outro Sistema de Registro (Migração). No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo alfanumérico no qual o participante deverá informar o motivo da migração do CDB. Quando o Registro for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.

**ANEXO II AO MANUAL DO PRODUTO CDB**

<b>LEIAUTE DE LIQUIDAÇÃO ANTECIPADA – CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
Registrador	– Campo alfanumérico – Tamanho: até 4 caracteres	Campo Obrigatório	Quando a Liquidação Antecipada for via arquivo, o Sistema de Registro efetuará a validação se o código informado está de acordo com o cadastro do participante. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Liquidação Antecipada não será efetuada.
Tipo título	– Campo Numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	Na Liquidação Antecipada via tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá selecionar o CDB. Quando a Liquidação Antecipada for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Tipo de Título. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Liquidação Antecipada não será efetuada.
Número Título BVMF	Campo alfanumérico Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	Na Liquidação Antecipada via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do CDB que será feito a troca. Quando a Liquidação Antecipada for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Liquidação Antecipada não será efetuada.
Data Referência	- Campo Numérico - Tamanho: 8 caracteres	Campo Obrigatório	Na Liquidação Antecipada via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data Referência em que a Liquidação Antecipada foi realizada no ambiente do Participante de Registro, quando a Liquidação Antecipada for via arquivo este campo seguirá a formatação AAAAMMDD. Para registro de Emissão Própria, a Data Referência da Liquidação Antecipada só pode ser igual ou anterior à data atual, respeitando o prazo limite a ser estipulado pela <b>BM&amp;FBOVESPA</b> . Já para registro de Emissão de Mercado a Data Referência deve ser igual à data do lançamento. Caso o participante não cumpra essa regra



<b>LEIAUTE DE LIQUIDAÇÃO ANTECIPADA – CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
			ou não a preencha, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e a Liquidação Antecipada não será efetuada.
PU Liquidação	- Campo numérico - Tamanho: até 15,8 caracteres	Campo Obrigatório	Na Liquidação Antecipada via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no formato 15,8 no qual o participante deverá informar o PU da Liquidação Antecipada do CDB, quando a Liquidação Antecipada for via arquivo este campo seguirá a mesma formatação. Em casos de informação incorreta ou não preenchida o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e a Liquidação Antecipada não será efetuada.
Quantidade	- Campo numérico - Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	Na Liquidação Antecipada via tela esta informação será apresentada por um campo numérico de até 15 caracteres no qual o participante deverá informar a quantidade a ser liquidada do CDB, quando o Registro for via arquivo este campo seguirá a mesma formatação. Em casos de informação incorreta ou não preenchida o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e a Liquidação não será efetuada.

**ANEXO III AO MANUAL DO PRODUTO CDB**

<b>LEIAUTE DE RETIRADA – CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
Registrador	– Campo alfanumérico – Tamanho: até 4 caracteres	Campo Obrigatório	Quando a Retirada for via arquivo, o Sistema de Registro efetuará a validação se o código informado está de acordo com o cadastro do participante. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Retirada não será efetuada.
Tipo Título	– Campo Numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	Na Retirada via tela, esta informação será apresentada no formato combobox, no qual o participante deverá selecionar o CDB. Quando a Retirada for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Tipo de Título. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Retirada não será efetuada.
Número Título BVMF	Campo alfanumérico Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	Na Retirada via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do CDB que será feito a troca. Quando a Retirada for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Retirada não será efetuada.
Data Referência	- Campo Numérico - Tamanho: 8 caracteres	Campo Obrigatório	Na Retirada via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data Referência em que a Retirada foi realizada no ambiente do Participante de Registro, quando a Retirada for efetuada via arquivo este campo seguirá a formatação AAAAMMDD. A Data Referência da Retirada só pode ser igual ou anterior à data atual, respeitando o prazo limite a ser estipulado pela BM&FBOVESPA. Caso o participante não cumpra essa regra ou não a preencha, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e a Retirada não será efetuada.



LEIAUTE DE RETIRADA – CDB			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Justificativa	- Campo alfanumérico - Tamanho: 100 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo alfanumérico no qual o participante deverá informar a justificativa da Retirada. Quando a Retirada for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Retirada não será efetuada.

**ANEXO IV AO MANUAL DO PRODUTO CDB**

<b>LEIAUTE DE BLOQUEIO - CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
Registrador	– Campo alfanumérico – Tamanho: até 4 caracteres	Campo Obrigatório	Quando o Bloqueio for via arquivo, o Sistema de Registro efetuará a validação se o código informado está de acordo com o cadastro do participante. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Bloqueio não será efetuado.
Tipo Título	– Campo Numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	No Bloqueio via tela, esta informação será apresentada no formato combobox, no qual o participante deverá selecionar o CDB. Quando o Bloqueio for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Tipo de Título. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Bloqueio não será efetuado.
Número Título BVMF	Campo alfanumérico Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	No Bloqueio via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do CDB a ser bloqueado. Quando o Bloqueio for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Bloqueio não será efetuado.
Data Referência	- Campo Numérico - Tamanho: 8 caracteres	Campo Obrigatório	No Bloqueio via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data Referência do bloqueio do CDB no ambiente do participante, quando o Registro for via arquivo este campo seguir a formatação AAAAMMDD. A Data de Referência só pode ser igual ou anterior à data do Bloqueio, caso o participante não cumpra essa regra ou não a preencha, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Bloqueio não será efetuado.



<b>LEIAUTE DE BLOQUEIO - CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
Código Justificativa	- Campo numérico - Tamanho: 3 caracteres	Campo Obrigatório	No Bloqueio via tela, esta informação será apresentada no formato combobox, no qual o participante deverá informar a justificativa do bloqueio. No Registro por arquivo, este campo deve ser informado no formato numérico (até 3 caracteres). No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Bloqueio não será efetuado.
Quantidade	- Campo numérico - Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	No Bloqueio via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico de até 15 caracteres, no qual o participante deverá informar a quantidade do CDBA que estará sendo Bloqueado. Quando o Bloqueio for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Bloqueio não será efetuado.
Registrador Beneficiário	- Campo numérico - Tamanho: 14 caracteres	Campo Obrigatório	No Bloqueio via tela, esta informação será apresentada no formato de combobox, no qual o Participante de Bloqueio deverá informar o Registrador que representa o Beneficiário do bloqueio. Quando o Bloqueio for via arquivo neste campo deve ser informado o CNPJ do Registrador Beneficiário do ativo. Caso o CNPJ informado seja inválido, o Sistema de Bloqueio irá gerar uma mensagem de erro e o Bloqueio não será efetuado.
Beneficiário do Bloqueio	- Campo numérico - Tamanho: 11 caracteres (CPF) ou 14 caracteres (CNPJ)	Campo Obrigatório	Neste campo, o participante deverá informar o CPF/CNPJ do Beneficiário do Bloqueio. Caso o documento informado seja inválido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Bloqueio não será efetuado.

**ANEXO V AO MANUAL DO PRODUTO CDB**

<b>LEIAUTE DE EXECUÇÃO - CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
Registrador	– Campo alfanumérico – Tamanho: até 4 caracteres	Campo Obrigatório	Quando a Execução for via arquivo, o Sistema de Registro efetuará a validação se o código informado está de acordo com o cadastro do participante. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Execução não será efetuada.
Tipo Título	– Campo Numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	Na Execução via tela, esta informação será apresentada no formato combobox, no qual o participante deverá selecionar o CDB. Quando a Execução for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Tipo de Título. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Execução não será efetuada.
Número Título BVMF	Campo alfanumérico Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	Na Execução via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do CDB. Quando a Execução for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Execução não será efetuada.
Código de Bloqueio	Campo alfanumérico Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	Na Execução via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do bloqueio do ativo que deseja executar. Quando a Execução for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Execução não será efetuada.



LEIAUTE DE EXECUÇÃO - CDB			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Data Referência	- Campo Numérico - Tamanho: 8 caracteres	Campo Obrigatório	Na Execução via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data Referência da Execução do CDB no ambiente do participante, quando a Execução for via arquivo este campo seguir a formatação AAAAMMDD. A Data de Referência deve ser igual à data da execução, caso o participante não cumpra essa regra ou não a preencha, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e a Execução não será efetuada.
Quantidade	- Campo numérico - Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	Na Execução via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico de até 15 caracteres, no qual o participante deverá informar a quantidade de ativo que será executada. Quando a Execução for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Execução não será efetuada.
PU Operação	- Campo numérico - Tamanho: até 15,8 caracteres	Campo Obrigatório	Na Execução via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico no formato 15,8, no qual o participante deverá informar o PU do ativo. Quando a Execução for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Execução não será efetuada.

**ANEXO VI AO MANUAL DO PRODUTO CDB**

<b>LEIAUTE DE DESBLOQUEIO - CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
Registrador	– Campo alfanumérico – Tamanho: até 4 caracteres	Campo Obrigatório	Quando o Desbloqueio for via arquivo, o Sistema de Registro efetuará a validação se o código informado está de acordo com o cadastro do participante. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Desbloqueio não será efetuado.
Tipo Título	– Campo Numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	No Desbloqueio via tela, esta informação será apresentada no formato combobox, no qual o participante deverá selecionar o ativo. Quando o Desbloqueio for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Tipo de Título. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Desbloqueio não será efetuado.
Código de Bloqueio	Campo alfanumérico Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	No Desbloqueio via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do bloqueio do ativo que deseja desbloquear. Quando o Desbloqueio for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Desbloqueio não será efetuado.
Data Referência	- Campo Numérico - Tamanho: 8 caracteres	Campo Obrigatório	No Desbloqueio via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data Referência do desbloqueio do ativo no ambiente do participante, quando o desbloqueio for via arquivo este campo seguir a formatação AAAAMMDD. A Data de Referência deve ser igual ou anterior à data do Desbloqueio, caso o participante não cumpra essa regra ou não a preencha, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Desbloqueio não será efetuado.



<b>LEIAUTE DE DESBLOQUEIO - CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
Quantidade	– Campo numérico – Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	No Desbloqueio via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico de até 15 caracteres, no qual o participante deverá informar a quantidade de ativo que estará sendo desbloqueada. Quando o Desbloqueio for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Desbloqueio não será efetuado.

**ANEXO VII AO MANUAL DO PRODUTO CDB**

<b>LEIAUTE DE TRANSFERÊNCIA - CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
Registrador	– Campo alfanumérico – Tamanho: até 4 caracteres	Campo Obrigatório	Quando a Transferência for via arquivo, o Sistema de Registro efetuará a validação se o código informado está de acordo com o cadastro do participante. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Transferência não será efetuada.
Tipo Título	– Campo Numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	Na Transferência via tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá selecionar o CDB. Quando a Transferência for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Tipo de Título. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Transferência não será efetuada.
Número Título BVMF	Campo alfanumérico Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	Na Transferência via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do CDB que será feito a troca. Quando a Transferência for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Transferência não será efetuada.



LEIAUTE DE TRANSFERÊNCIA - CDB			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Registrador Proprietário Destino	– Campo numérico – Tamanho: 14 caracteres	Campo Obrigatório para Emissão de Mercado	Na Transferência via tela, esta informação será apresentada no formato de <i>combobox</i> , no qual o Participante de Registro deverá informar o Registrador Proprietário Destino do ativo. Quando a Transferência for via arquivo este campo deve ser informado o CNPJ do Registrador Proprietário Destino do ativo. Caso o CNPJ informado seja inválido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e a Transferência não será efetuada.
Código Justificativa	- Campo numérico - Tamanho: 3 caracteres	Campo Obrigatório	Na Transferência via tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá informar a justificativa. No Registro por arquivo, este campo deve ser informado no formato numérico (até 3 caracteres) conforme tabela de domínios da BM&FBOVESPA. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Transferência não será efetuado.
PU Operação	– Campo numérico – Tamanho: até 23 caracteres (8 decimais)	Campo Obrigatório	Na Transferência via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico no formato 15,8, no qual o participante deverá informar o PU do ativo. Quando a Transferência for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Transferência não será efetuada.



<b>LEIAUTE DE TRANSFERÊNCIA - CDB</b>			
<b>Informação</b>	<b>Formato</b>	<b>Obrigatoriedade</b>	<b>Validações – Sistema de Registro</b>
Liquidação BVMF	– Campo Numérico – Tamanho: 1 caracter	Campo Obrigatório	Na Transferência via tela, esta informação será apresentada uma caixa de seleção, no qual o participante deverá optar, quando possível, por efetuar a Liquidação na BVMF ou não. Quando a Transferência for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio referente à opção da liquidação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Transferência não será efetuada.
Quantidade	– Campo numérico – Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	Na Transferência via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico de até 15 caracteres, no qual o participante deverá informar a quantidade de ativo que estará sendo trocada. Quando a Transferência for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Transferência não será efetuada.
Documento Proprietário	– Campo numérico – Tamanho: 11 caracteres (CPF) ou 14 caracteres (CNPJ)	Campo Obrigatório	Neste campo, o participante deverá informar o CPF/CNPJ do Proprietário destino do ativo, somente quando se tratar de Transferência no mesmo Participante de Registro. Caso o documento informado seja inválido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e a Transferência não será efetuada.