



26 de fevereiro de 2014
010/2014-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 Letras de Crédito Imobiliário – LCI 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 Letra de Crédito Imobiliário - “LCI”, bem como o registro dos ativos que servem como lastro, em conformidade com a Lei 10.931/2004 e a Circular 3.621 do Banco Central do Brasil.

A LCI é um título de crédito nominativo, lastreada por créditos imobiliários garantidos por hipoteca ou por alienação fiduciária da coisa imóvel, conferindo aos seus tomadores direito de crédito pelo valor nominal, juros e, se for o caso, atualização monetária nela estipulados.

Com relação à estrutura de remuneração, poderá ser registrada LCI enquadrada nas modalidades pós ou prefixada. Na LCI pós-fixada a rentabilidade é atrelada a um percentual pré-definido de um determinado indexador.

Inicialmente, serão aceitos, na modalidade pós-fixado, somente registros de LCI indexadas à Taxa DI. Futuramente, a lista outros indexadores aceitos estará disponível no site www.bmfbovespa.com.br/balcao.

A LCI prefixada, por sua vez, é remunerada por uma taxa fixa, contratada pelo investidor no momento da aplicação, que será mantida independentemente de oscilações do mercado.



010/2014-DP

.2.

O sistema de registro informará diariamente os valores referenciais atualizados das LCI pós-fixadas nele registrados.

O registro de LCI terá tratamento diferenciado pelo sistema conforme o tipo de emissão determinado no momento do registro. Em registros de LCI de emissão própria, o participante de registro emitente fará a inserção dos dados da LCI 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 da LCI, fora dos ambientes da BM&FBOVESPA.

Por sua vez, na hipótese de registro de LCI 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 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 – LCI (Anexo I).

O participante de registro emitente deverá manter atualizadas as informações sobre a composição de ativos utilizados como lastro para uma ou mais LCI, com valor igual ou superior à(s) LCI a que estiver vinculado. Para manter a correta relação entre ativos e lastros, o participante de registro emitente poderá efetuar a substituição, inclusão ou exclusão de ativos que compõem o lote de lastros.

As especificações do produto, funcionalidades do sistema de registro e características para registro no sistema via tela ou arquivo estão descritas no Manual do Produto – LCI disponível no anexo ao presente Ofício Circular e no site www.bmfbovespa.com.br/balcao.

**Política de Tarifação do Certificado de Letra de Crédito Imobiliário (LCI).**

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 duplo (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 estabelecido na Tabela de Preços de Utilização do Sistema de Registro, constante do item 2 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. Tabela de Preços de Utilização do Sistema de Registro

Serviço	Taxa
Registro	0,006% ¹

¹ Aplicada sobre o valor-base da operação na data de registro.

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 2.

As regras operacionais fazem parte do Manual do Usuário – LCI, disponível no site www.bmfbovespa.com.br/balcao.



010/2014-DP

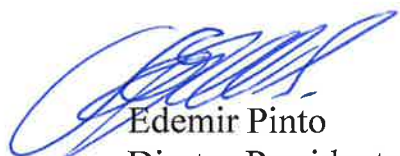
.4.

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.

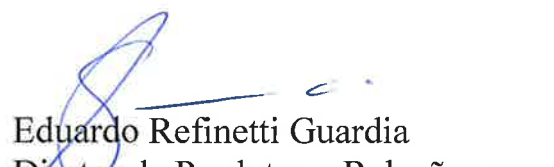
Os valores das tarifas aqui apresentados serão corrigidos anualmente pelo Índice Geral de Preço do Mercado (IGP-M) a contar da data de início de sua vigência. A BM&FBOVESPA poderá, a qualquer momento e a seu critério, alterar os valores e regras da tarifação aqui divulgadas. As informações sobre tarifação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

BM&F BOVESPA

A Nova Bolsa



010/2014-DP

.5.

**ANEXO I
MANUAL DO PRODUTO – LCI**



BM&F BOVESPA

A Nova Bolsa



LCI – Letra de Crédito Imobiliário

Versão 1.1

Fevereiro/2014



iBalcão

BM&F BOVESPA
A Nova Bolsa



**Sumário**

CAPÍTULO I	INTRODUÇÃO.....	9
CAPÍTULO II	DO OBJETO	9
CAPÍTULO III	CARACTERÍSTICAS.....	9
CAPÍTULO IV	PAPÉIS E RESPONSABILIDADES	9
CAPÍTULO V	REGISTRO DE LCI.....	10
CAPÍTULO VI	INFORMAÇÕES PARA REGISTRO.....	11
CAPÍTULO VII	FUNCIONALIDADES DO SISTEMA DE REGISTRO	15
CAPÍTULO VIII	DOS HORÁRIOS.....	26
CAPÍTULO IX	DA ESTRUTURA DE CONTAS.....	27
CAPÍTULO X	DA TRANSFERÊNCIA DE TITULARIDADE DECORRENTE DE NEGOCIAÇÃO DE LCI.....	27
CAPÍTULO XI	DA LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA.....	27
CAPÍTULO XII	MECANISMOS DE CONTROLE	29
CAPÍTULO XIII	DA VALORIZAÇÃO DA LCI	30

**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 válidos 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.

EMISSÃO DE MERCADO	Emissão de LCI efetuada pelo Participante de Registro e distribuída a clientes de outro Participante de Registro.
EMISSÃO PRÓPRIA	Emissão de LCI efetuada pelo Participante de Registro e distribuída aos seus clientes.
LASTRO	Créditos imobiliários ou outros empréstimos e financiamentos garantidos por hipoteca ou por alienação fiduciária de coisa imóvel que lastreiam a emissão de LCI.
LCI	Letra de Crédito Imobiliário.
LIQUIDANTE	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.
LOTE	Composição de ativos que servem como Lastro para uma ou mais LCI.
MANUAL DO PRODUTO	Manual para Registro de Letra de Crédito Imobiliário na BM&FBOVESPA.
REGULAMENTO	Regulamento de Registro de Ativos e Operações do Mercado de Balcão Organizado da BM&FBOVESPA.
TAXA DI	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 LCI e de seus Lastros.

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 do § 2º do artigo 12 da Lei 10.931/04.

CAPÍTULO III CARACTERÍSTICAS

- 3.1 A LCI é um título de crédito nominativo, lastreada por créditos imobiliários garantidos por hipoteca ou por alienação fiduciária da coisa imóvel, conferindo aos seus tomadores direito de crédito pelo valor nominal, juros e, se for o caso, atualização monetária nela estipulados.
- 3.2 Com relação à estrutura de remuneração, a LCI pode ser enquadrada nas modalidades pós ou prefixada. Na LCI pós-fixada, 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. A LCI prefixada, por sua vez, é remunerada 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
- 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 LCI

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

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



- 5.1.3** Em Registros de LCI 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 LCI nas modalidades pós-fixada indexada ao DI e prefixada.
- 5.4** O Sistema de Registro irá realizar o cálculo do preço unitário atualizado da LCI. O cálculo será realizado de acordo com a metodologia disposta no Capítulo XIII deste Manual de Produto.
- 5.5** A confirmação da efetivação do Registro ocorrerá pela atribuição de um código à LCI, 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 da LCI 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) **Consome Lote:** Lote em que estão registrados os Lastros da LCI.
- e) **Número Registrador:** Código de controle atribuído pelo Participante de Registro emitente.
- f) **Data Referência:** Data em que a Movimentação foi originada.



- g) **Data de Emissão:** Data da emissão da LCI, menor ou igual à data de Registro. Deve ser, necessariamente, dia útil.
- h) **Data de Vencimento:** Data do vencimento da LCI. Deve ser, necessariamente, dia útil e, no mínimo, um dia posterior à Data de Registro.
- i) **Tipo de Emissão:** Indica a relação entre o Emitente e o Titular da LCI. Deve ser preenchida com as modalidades “Própria” ou “Mercado”, conforme o caso.
- j) **Dados Emitente:** Preenchimento da razão social e do CNPJ da instituição emissora da LCI, conforme disposto na Lei 10.931/04.
- k) **Registrador Proprietário:** Indicação do Participante de Registro proprietário, quando se tratar de Emissão de Mercado.
- l) **Dados do Proprietário:** Deve ser indicado o número de inscrição do CPF/CNPJ do Titular da LCI, natureza jurídica e nome.
Nos casos de Emissão de Mercado deve-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 da LCI.
- m) **Tipo de Estrutura:** Estrutura de remuneração, conforme modalidades autorizadas pela BM&FBOVESPA.
- n) **Indexador:** Indexador da LCI.
- o) **Percentual do Indexador:** Percentual a ser aplicado sobre o indexador escolhido.
- p) **Quantidade:** Quantidade emitida de LCI.
- q) **PU:** Preço Unitário da emissão expresso em reais.
- r) **Taxa de Juros:** Taxa de juros da LCI.
- s) **Condição de Resgate:** Condição de resgate acordada entre o Emitente e o Titular da LCI. 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:** A LCI 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.
- t) **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.



- u) **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.
- v) **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.
- w) **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.
- x) **Informações Adicionais:** Informações adicionais da LCI.
- y) **Forma de Pagamento:** Forma de pagamento dos juros e do principal.
- z) **Critério de Cálculo:** Poderá ser escolhido 252 dias úteis ou 360 dias corridos, de acordo com o tipo de estrutura.
- aa) **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 da LCI proveniente de outro sistema de registro autorizado pelo BCB.
- b) **Instituição Origem:** Identificação da instituição na qual a LCI foi previamente registrada.
- 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 LCI estão descritas no Anexo I – Leiaute de Registro LCI.



6.2 Registro do Lastro de LCI

6.2.1 Para efetuar o registro do Lastro, é necessário o preenchimento dos campos listados abaixo com adição aos itens “a”, “b”, “c” e “o”, descritos no Capítulo VI, item 6.1.1 e no item 6.1.2, se aplicável.

- a) **Data da Contratação:** Data de contratação do Lastro.
- b) **Código do Contrato:** Código identificador do contrato para controle do Participante de Registro.
- c) **Compõe Lote:** Indicação do lote no qual o Lastro será utilizado.
- d) **Emissor:** Instituição originadora do crédito imobiliário.
- e) **Dados Cliente:** Deve ser indicado o número de inscrição do CPF/CNPJ do cliente do emissor a quem foi concedido o crédito imobiliário que serve de Lastro à LCI, natureza jurídica e nome.
- f) **Valor Contratado:** Valor contratado pelo tomador do crédito, ou seja, o valor total emprestado/financiado.
- g) **Valor Residual:** equivale ao somatório dos valores a vencer do contrato que representa o Lastro.
- h) **Data Base:** Refere-se à data base do valor residual.
- i) **Indexador:** Indexador do Lastro da LCI.
- j) **Percentual do Indexador:** Percentual a ser aplicado sobre o indexador escolhido.
- k) **Taxa Efetiva Anual:** Taxa efetiva equivalente aos juros pré-fixados do Lastro.
- l) **Tipo de Crédito:** Classificação do crédito que lastreia a LCI.
- m) **Modalidade da Operação:** Modalidade e Submodalidade de crédito conforme documento 3040 – Dados de Risco de Crédito (BCB).
- n) **Identificação do Crédito:** Identificação do tipo do Lastro
- o) **Código da Identificação do Crédito:** Código identificador do crédito para controle do Participante de Registro emitente.

A confirmação da efetivação do Registro ocorrerá pela atribuição de um código ao Lastro de LCI, que será determinado pela BM&FBOVESPA e informado via mensagem ou tela.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para o Registro de Lastro de LCI estão descritas no Anexo II – Leiaute de Registro Lastro LCI



6.3 Registro do Lote

- a) **Número do lote:** Número de identificação do Lote.
- b) **Registrador:** Participante de Registro emitente responsável pela criação do Lote.
- c) **CPF/CNPJ Emissor lote:** CPF/CNPJ do emissor dos Lastros que irão compor o Lote.

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

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.

7.1.1 Liquidação antecipada

Quando ocorrer a Liquidação antecipada total ou parcial da LCI, conforme condições pré-definidas no momento do Registro (item 6.1.1 subitem “s” 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 LCI 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 da LCI 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 da LCI estão descritas no Anexo IV - Leiaute de Liquidação antecipada.

7.1.2 Migração

A Migração de Registro de LCI e do Lastro, inicialmente registrada 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 LCI e de Lastro estão descritas no Anexo I – Leiaute de Registro LCI e Anexo II – Leiaute de Registro Lastro LCI.

7.1.3 Retirada

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

A Retirada do Lastro somente será possível se: (i) não afetar o valor alocado do Lote da LCI; ou (ii) O Participante de Registro emitente realizar a substituição do Lastro na hipótese de o valor alocado do lote da LCI for comprometido.

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

A Retirada será permitida somente para a LCI e/ou Lastro com status “liberado”, sendo obrigatório o preenchimento do campo “Justificativa”.

Adicionalmente, se tratando de uma LCI 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 V – 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 uma LCI e/ou de um Lastro 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 da LCI a ser bloqueada.
- f) **Justificativa:** Motivo que originou o Bloqueio.



010/2014-DP

.18.

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; e
- c) Ordens administrativas.

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

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

7.1.5 Execução

A execução de uma LCI bloqueada deverá ser realizada pelo Participante de Registro beneficiário, podendo a LCI ser executada 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 VII – Leiaute de Execução.

7.1.6 Desbloqueio

O Desbloqueio deverá ser realizado pelo Participante de Registro para liberação da quantidade total ou parcial de uma LCI e/ou de um Lastro previamente bloqueado.



010/2014-DP

.19.

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 da LCI a ser desbloqueada.
- 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 VIII – Leiute de Desbloqueio.

7.1.7 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.

7.1.8 Manutenção

É de responsabilidade do Participante de Registro efetuar a atualização das informações relativas aos Lastros de LCI, conforme estabelecido pelo BCB.

**7.1.8.1 Manutenção do Lastro:**

O Participante de Registro emitente deverá manter atualizadas as seguintes informações:

- a) Valor residual;
- b) Data base;
- c) Data de Vencimento;
- d) Percentual do Indexador;
- e) Taxa Efetiva Anual.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para a manutenção de Lastro estão descritas no Anexo IX – Leiaute de Manutenção de Lastro.

7.1.8.2 Manutenção do Lote:

O Participante de Registro emitente deverá manter Lote com valor suficiente para servir de Lastro à(s) LCI(s) a que estiver vinculado, para tanto, O Participante de Registro emitente poderá efetuar a substituição, inclusão ou exclusão de Ativos que compõem o Lote.

As especificações e validações técnicas das informações necessárias para a Manutenção de Lote estão descritas no Anexo X – Leiaute de Manutenção de Lote.

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 da LCI e/ou de um Lastro 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 decorrentes no Sistema de Liquidação.

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

7.1.10 Transferência de Titularidade

A Transferência de Titularidade de LCI e/ou do Lastro 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 decorrentes, 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.

- (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 decorrentes na BM&FBOVESPA, esta será refletida no Sistema de Registro por comando do Sistema de Liquidação.



010/2014-DP

.22.

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 Transferência de Titularidade estão descritas no Anexo XI – Leiaute de Transferência.

7.1.11 Vencimento

Na data do vencimento, o Emitente da LCI deverá honrar suas obrigações perante o Titular. Nesta data, o Sistema de Registro irá atualizar o status da LCI 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 uma LCI bloqueada, 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.

A LCI e os Lastros vencidos ficarão disponíveis 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 LCI 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 à LCI 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 LCI prefixada.
- p) **Condição de Resgate:** Condição de resgate acordada entre o Emitente e o Titular da LCI.
- q) **Quantidade Emissão:** Quantidade emitida da LCI.
- 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 da LCI.
- u) **PU Atualizado:** Preço Unitário da LCI, atualizado diariamente.
- v) **Valor Atualizado:** Valor financeiro da LCI atualizado diariamente.
- w) **Quantidade Resgatada:** Soma da(s) quantidade(s) resgatada(s) da LCI.
- x) **Quantidade Disponível:** Quantidade disponível para movimentação da LCI.
- y) **Quantidade Bloqueada:** Soma da(s) quantidade(s) que reflete(m) a(s) informação(ões) de Bloqueio da LCI.
- z) **Quantidade Atualizada:** Quantidade atualizada da LCI. É a soma da Quantidade Disponível com a Quantidade Bloqueada, se houver.
- aa) **Forma de Pagamento:** Forma de pagamento dos juros e do principal.
- bb) **Identificação do Lastro:** Número do Lote da LCI e/ou do Lastro;
- cc) **ISIN:** International Securities Identification Number, definido na norma ISO 6166, caso aplicável.
- dd) **Título Migrado:** Indicação se o Registro é proveniente de Migração.



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

7.1.13.2 Conciliação de Movimentação

O arquivo de conciliação de Movimentação demonstra os movimentos diários realizados na LCI e/ou no Lastro, 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:** LCI ou Lastro LCI.
- b) **Número BVMF:** Número de controle atribuído ao Registro pelo Sistema de Registro.
- c) **Número BVMF Origem:** Número originalmente atribuído pelo Sistema de Registro à LCI 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 à 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 O 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



010/2014-DP

.27.

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 A LCI e/ou Lastro registrado no Sistema de Registro será identificado por Titular pelo preenchimento do campo descrito na alínea "l" do item 6.1.1 e/ou alínea "e" do item 6.2.1, respectivamente, não havendo estrutura de contas individualizadas e não individualizadas por Participante de Registro.

CAPÍTULO X DA TRANSFERÊNCIA DE TITULARIDADE DECORRENTE DE NEGOCIAÇÃO DE LCI e/ou LASTRO

10.1 O Participante de Registro deverá refletir, no Sistema de Registro, a Transferência de Titularidade da LCI e/ou do Lastro 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.



010/2014-DP

.28.

- (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 LCI de Emissão de Mercado e/ou bloqueada, 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 LCI, 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 Participante de Registro efetuar o pagamento do débito;
 - c) **A partir de 12h15** – Tratamento dos pagamentos não realizados dentro da janela e Liquidação individual das transações decorrentes do vencimento da LCI na modalidade bruta;
- (iii) **17h30** – Horário limite para os pagamentos dos débitos referentes à Liquidação bilateral.





010/2014-DP

.29.

- 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 LCI 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 da LCI (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.



- 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 cabíveis.
- 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 DA LCI

13.1 LCI Pós-fixada indexada à Taxa DI

13.1.1 O valor principal da LCI 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.
- 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 LCI Pós-fixada indexada à Taxa DI

13.2.2 O Sistema de Registro informará diariamente os valores referenciais atualizados das LCI Pós-fixadas indexadas à Taxa DI nele registrados.

13.2.3 Cálculo do fator diário

$$Fator_{diário} = \left(\frac{taxa_{DI}}{100} + 1 \right)^{\frac{1}{252}} - 1$$

Precisões de cálculo

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

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

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

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

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

13.2.4 Cálculo do fator acumulado

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

$\%DI$ = 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.



13.2.5 O cálculo de atualização do PU

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

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.

13.2.6 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 LCI Prefixada

O valor principal de uma LCI prefixada 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 a LCI.
- 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 LCI prefixada:

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:**

$$V_A = (PU_{\text{Emis}} \times \text{Fator}_{\text{acumulado 252}})$$

V_A = Valor Atualizado.

PU_{Emis} : 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):

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

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

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

Precisões de cálculo:

$\text{Fator}_{\text{acumulado 360}}$: 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

$$V_A = (PU_{\text{Emis}} \times \text{Fator}_{\text{acumulado 360}})$$



010/2014-DP

.35.

V_A = Valor Atualizado.

PU_{Emiss} : PU Emissão.

Fator *acumulado 360*: 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 2^a (segunda) casa decimal.

**ANEXO I AO MANUAL DO PRODUTO LCI**

LEIAUTE DE REGISTRO LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 a LCI. 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.
Consome Lote	– Campo Numérico – Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do lote em que a LCI ficará vinculada. 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.
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 da LCI. 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 LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 da LCI 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 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.
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 da LCI, 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 da LCI, 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.



LEIAUTE DE REGISTRO LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Emitente	– Campo numérico – Tamanho: 14 caracteres	Campo Obrigatório	Neste campo, o participante deverá informar o CNPJ do Emitente da LCI. 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 da LCI. Quando o Registro for via arquivo este campo deve ser informado o CNPJ do Registrador Proprietário da LCI. Caso o CNPJ informado seja inválido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
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 da LCI. 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 da LCI. 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 a LCI. 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 LCI 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 a LCI. 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 LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 da LCI. 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.
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 da LCI. 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 da LCI. Quando o Registro for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. No Registro de uma LCI pós-fixada, a informação deste campo é opcional. No Registro de uma LCI prefixada, o participante deve informar a Taxa de Juros ou o valor de resgate para que o Sistema de Registro possa efetuar os devidos cálculos da LCI. 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 LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 da LCI, 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.
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.



LEIAUTE DE REGISTRO LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 somente se a 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.
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 da LCI (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 da LCI. 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.



LEIAUTE DE REGISTRO LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 da LCI. 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.
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 da LCI (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 da LCI. 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.



LEIAUTE DE REGISTRO LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 a LCI 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.
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 da LCI. 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 LCI**

LEIAUTE DE REGISTRO LASTRO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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.
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 Lastro da LCI. 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.
Compõe Lote	– Campo Numérico – Tamanho: até 20 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do lote em que o Lastro irá compor. 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 do Contrato	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 do contrato do Lastro da LCI. 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 LASTRO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 Lastro da LCI no ambiente do participante, quando o Registro for via arquivo este campo seguir a formatação AAAAMMDD. A Data de Referência deve ser igual ou anterior à Data de Contratação 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 da Contratação	- 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 Contratação do Lastro da LCI, quando o Registro for via arquivo este campo seguirá a formatação AAAAMMDD. A Data de Contratação 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 Lastro da LCI, 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.
Emitente	- Campo numérico - Tamanho: 14 caracteres	Campo Obrigatório	Neste campo, o participante deverá informar o CNPJ do Emitente do Lastro da LCI. 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 LASTRO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Cliente	– Campo numérico – Tamanho: 11 caracteres (CPF) ou 14 caracteres (CNPJ)	Campo Obrigatório	Neste campo, o participante deverá informar o CPF/CNPJ do cliente do Lastro da LCI. Caso o documento informado seja inválido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Valor Contratado	– Campo Numérico – Tamanho: até 17 caracteres (2 decimais)	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico, no qual o participante deverá informar o Valor Contratado pelo tomador do crédito. 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.
Valor Residual	– Campo Numérico – Tamanho: até 17 caracteres (2 decimais)	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico, no qual o participante deverá informar o Valor Residual. 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 Base	- 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 Base do Valor Residual, quando o Registro for via arquivo este campo seguirá a formatação AAAAMMDD. 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.



LEIAUTE DE REGISTRO LASTRO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 Lastro da LCI. 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 somente para LCI pós-fixada	No Registro via tela, a informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá informar o tipo de Indexador do Lastro da LCI. 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: 9 caracteres (4 decimais)	Campo Obrigatório somente para LCI pós-fixada	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar o Percentual do Indexador do Lastro da LCI. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Taxa Efetiva Anual	– Campo numérico – Tamanho: 9 caracteres (4 decimais)	Campo Opcional	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Taxa Efetiva Anual. 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.



LEIATE DE REGISTRO LASTRO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Tipo de Crédito	– Campo numérico – Tamanho: 3 caracteres		No Registro por tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá informar o tipo de crédito do Lastro da LCI. 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.
Modalidade da Operação	– 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 a modalidade do crédito do Lastro da LCI. 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.
Identificação do Crédito	– Campo numérico – Tamanho: 3 caracteres	Campo Opcional	No Registro por tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá identificar o crédito do Lastro da LCI. 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.
Código da Identificação do Crédito	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 código da identificação do crédito do Lastro da LCI. 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 LASTRO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 Lastro. 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 Lastro 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.
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 Lastro. 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 III AO MANUAL DO PRODUTO LCI**

LEIAUTE DE REGISTRO LOTE - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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.
Emitente	– Campo numérico – Tamanho: 14 caracteres	Campo Obrigatório	Neste campo, o participante deverá informar o CNPJ do Emitente do Lote. Caso o CNPJ informado seja inválido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e o Registro não será efetuado.
Número do Lote	– Campo Numérico – Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	No Registro via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do lote. 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.



I AO MANUAL DO PRODUTO LCI

LEIAUTE LIQUIDAÇÃO ANTECIPADA – LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 a LCI. 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 da LCI 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 BM&FBOVESPA. Já para registro de Emissão de Mercado a Data Referência deve ser igual à data do lançamento. Caso o participante não cumpra essa regra



LEIAUTE LIQUIDAÇÃO ANTECIPADA – LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
			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 da LCI, 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 da LCI, 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 V AO MANUAL DO PRODUTO LCI**

LEIAUTE DE RETIRADA – LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 a LCI ou o Lastro. 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 da LCI ou do Lastro 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 – LCI			
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 VI AO MANUAL DO PRODUTO LCI**

LEIAUTE DE BLOQUEIO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 a LCI ou o Lastro. 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 da LCI ou do Lastro 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 da LCI 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.



LEIAUTE DE BLOQUEIO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 da LCI ou do Lastro 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 VII AO MANUAL DO PRODUTO LCI**

LEIAUTE DE EXECUÇÃO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 a LCI. 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 da LCI. 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 - LCI			
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 da LCI 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 VIII AO MANUAL DO PRODUTO LCI**

LEIAUTE DE DESBLOQUEIO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 seguirá 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.



LEIAUTE DE DESBLOQUEIO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 IX AO MANUAL DO PRODUTO LCI**

LEIAUTE DE MANUTENÇÃO LASTRO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Registrador	– Campo alfanumérico – Tamanho: até 4 caracteres	Campo Obrigatório	Quando a manutenção 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 manutenção não será efetuada.
Tipo Lastro	– Campo Numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	Na manutenção via tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá selecionar o tipo de Lastro. Quando a manutenção for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Lastro. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a manutenção não será efetuada.
Número Título BVMF	Campo alfanumérico Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	Na manutenção via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do Lastro para vinculação com o Lote indicado. Quando a manutenção 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 manutenção não será efetuada.
Valor Residual	– Campo Numérico – Tamanho: até 17 caracteres (2 decimais)	Campo Opcional	Na manutenção via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico, no qual o participante deverá informar o Valor Residual atualizado. Quando a manutenção for via arquivo, este campo seguirá a mesma formatação. Caso o Valor Residual alterado comprometa o saldo do Lote que o Lastro esteja vinculado, a alteração não será efetivada. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a manutenção não será efetuada.



LEIAUTE DE MANUTENÇÃO LASTRO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Liquidação	– Campo Numérico – Tamanho: 1 caracter	Campo Obrigatório	Na manutenção via tela, esta informação será apresentada uma caixa de seleção, no qual o participante deverá optar por indicar se a Liquidação do Valor Residual é Total ou Parcial. Quando a manutenção for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica a opção da Liquidação. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a manutenção não será efetuada.
Data Base Valor Residual	- Campo Numérico - Tamanho: 8 caracteres	Campo Opcional *Obrigatório quando alterar o Valor Residual	Na manutenção via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Data Base do Valor Residual, quando o Registro for via arquivo este campo seguirá a formatação AAAAMMDD. A Data Base do Valor Residual deverá ser posterior à Data de Contratação. Caso o participante não cumpra essa regra ou o campo não seja preenchido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e a manutenção não será efetuada.
Data de Vencimento	- Campo Numérico - Tamanho: 8 caracteres	Campo Opcional	Na manutenção via tela esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a nova Data de Vencimento, quando a manutenção for via arquivo este campo seguirá a formatação AAAAMMDD. A Data de Vencimento deverá ser pelo menos D+1 da Data da Alteração, caso o participante não cumpra essa regra ou o campo não seja preenchido, o Sistema de Registro irá gerar uma mensagem de erro e a manutenção não será efetuada.
Percentual Indexador	– Campo numérico – Tamanho: 9 caracteres (4 decimais)	Campo Opcional	Na manutenção via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar o novo Percentual do Indexador. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a manutenção não será efetuada.



LEIAUTE DE MANUTENÇÃO LASTRO - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Taxa Efetiva Anual	- Campo numérico - Tamanho: 9 caracteres (4 decimais)	Campo Opcional	Na manutenção via tela, esta informação será apresentada por um campo numérico no qual o participante deverá informar a Taxa Efetiva Anual. Quando a manutenção 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 manutenção não será efetuada.
Justificativa	- Campo alfanumérico - Tamanho: 100 caracteres	Campo Opcional	Na manutenção via tela, esta informação será apresentada por um campo alfanumérico no qual o participante deverá informar a justificativa da Manutenção do Lastro. Quando a manutenção 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 manutenção não será efetuada.

**ANEXO X AO MANUAL DO PRODUTO LCI**

LEIAUTE DE MANUTENÇÃO LOTE - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Registrador	– Campo alfanumérico – Tamanho: até 4 caracteres	Campo Obrigatório	Quando a Manutenção 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 Manutenção não será efetuada.
Tipo Lastro	– Campo Numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	Na Manutenção via tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá selecionar o tipo do Lastro. Quando a Manutenção for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o respectivo Lastro. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Manutenção não será efetuada.
Número Título BVMF	Campo alfanumérico Tamanho: até 15 caracteres	Campo Obrigatório	Na Manutenção via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do Lastro para vinculação com o Lote indicado. Quando a Manutenção 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 Manutenção não será efetuada.
Número do Lote	– Campo Numérico – Tamanho: até 20 caracteres	Campo Obrigatório	Na Manutenção via tela, esta informação será apresentada por um campo no qual o participante deverá preencher o número do lote. Quando a Manutenção 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 Manutenção não será efetuada.



LEIAUTE DE MANUTENÇÃO LOTE - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
Tipo Manutenção: Inclusão ou Exclusão de Lastro	– Campo Numérico – Tamanho: até 3 caracteres	Campo Obrigatório	Na Manutenção via tela, esta informação será apresentada no formato <i>combobox</i> , no qual o participante deverá selecionar o tipo de função: Inclusão ou Exclusão de Lastro. Quando a Manutenção for via arquivo este campo deve ser informado através do domínio que identifica o tipo de manutenção do lote. No caso de envio de formatação diferente do padrão estabelecido, será gerada uma mensagem de erro e a Manutenção não será efetuada.

**ANEXO XI AO MANUAL DO PRODUTO LCI**

LEIAUTE DE TRANSFERÊNCIA - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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 a LCI ou o Lastro. 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 da LCI ou do Lastro 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 - LCI			
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 efetuada.
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.



LEIAUTE DE TRANSFERÊNCIA - LCI			
Informação	Formato	Obrigatoriedade	Validações – Sistema de Registro
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.