

MANUAL DE OPERAÇÕES

POSIÇÃO FINANCEIRA

SUMÁRIO

1 ATUALIZAÇÃO DA VERSÃO	3
2 INTRODUÇÃO A POSIÇÃO FINANCEIRA	4
2.1 Conhecendo o Produto	4
2.2 Ações dos botões das telas	6
3 CETIP > CONSULTAS	7
3.1 Banco Liquidante	7
3.2 Participante	8
3.3 Banco Liquidante e Participante	9
3.4 Banco Liquidante e Sistema	10
3.5 Banco Liquidante, Participante e Sistema	11
3.6 Analítica de Saldo Financeiro	13
3.7 Consulta aos Créditos e Débitos.....	15
4 CETIP > FERRAMENTAS	16
4.1 Confirmação de Financeiro	16
4.2 Transferência modalidade Cetip para Bruta	17
5 BRUTA > CONSULTAS	20
5.1 Posição Financeira Analítica Bruta	20
5.2 Posição Financeira Sintética Bruta	22
5.3 Confirmação de Financeiro	23
6 BILATERAL > CONSULTAS	26
6.1 Posição Financeira Analítica Bilateral.....	26
6.2 Posição Financeira Sintética Bilateral.....	27
6.3 Consulta aos Créditos e Débitos – Modalidade Bilateral	29
6.4 Confirmação de Financeiro	30
7 GRADE HORÁRIO	31
7.1 Horários da Janela de Liquidação.....	31
8 INFORMAÇÕES ADICIONAIS	33
8.1 Banco Liquidante	33
8.2 Códigos de Grade.....	33
8.3 Tipos de Operação por Modalidade.....	35
8.4 Status da Liquidação	36
9 FLUXO E DETALHAMENTO DAS MENSAGENS PARA LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA	37
9.1 Fluxo de Mensagens - Janela Multilateral Cetip	37
9.2 Fluxo de Mensagens - Modalidade Bruta ou Bilateral no STR.....	41
9.3 Fluxo de Mensagens - Modalidade Bruta ou Bilateral no STR (uso da LTR0003).....	43
9.4 Fluxo de Mensagens - Bruta no Banco Liquidante (<i>Book-Transfer</i>)	44
9.5 Estruturação das Tags “Histórico” e “Número Operação LTR”	45
9.6 Liquidação Bilateral para Swap ou Termo de Moeda	46
10 GLOSSÁRIO	48

1 ATUALIZAÇÃO DA VERSÃO

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
29/01/2018	29/01/2018	Posição Financeira Analítica Bilateral	Atualização da tela de relação, conforme o comunicado 008/2017 – DN.
29/05/2017	15/08/2017	Cetip > Ferramentas Confirmação de Financeiro Bruta > Consultas Confirmação de Financeiro Bilateral > Consultas Confirmação de Financeiro	Inclusão de informação na visão geral.
29/05/2017	29/05/2017	Transferência modalidade Cetip para Bruta	Disponibilização da nova ação “Trocar e rejeitar pagamento automaticamente”, conforme comunicado 024/17.
27/07/2015	27/07/2015	Transferência modalidade Cetip para Bruta	Disponibilização da nova função.
19/09/2011	26/11/2014	Diversas funções	Atualização de telas devido a layout (cores e formatos).
19/09/2011	31/10/2014	Atualizações da Versão	Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais nova para a mais antiga.
19/09/2011	19/09/2014	Em todo o manual	<ul style="list-style-type: none"> • Arrumação das funções conforme estão no NoMe e o caminho completo; e • Nas descrições dos campos, inclusão da informação se o preenchimento é obrigatório ou não. • E atualização de algumas telas conforme estão no NoMe.
19/09/2011	26/04/2012	Fluxo e Detalhamento das Mensagens para Liquidação Financeira	Inclusão dos fluxos e detalhamento das mensagens para liquidação financeira.
19/09/2011	26/04/2012	Códigos de Grade	Inclusão de informações da CTP31

2 INTRODUÇÃO A POSIÇÃO FINANCEIRA

2.1 Conhecendo o Produto

Este serviço tem como objetivo possibilitar ao Banco Liquidante e aos Participantes a consulta da posição financeira das operações realizadas no âmbito da Cetip e também viabilizar, como contingenciamento a mensageria, as confirmações financeiras.

Neste módulo são disponibilizadas telas com consultas sintéticas e analíticas que fornecem aos Bancos Liquidantes informações necessárias para conferência e respectiva confirmação financeira. Da mesma forma, o Participante tem acesso aos seus dados para simples conferência. Estas consultas mostram a posição financeira de D0 e em datas anteriores.

São segregadas as consultas pertinentes às modalidades de liquidação disponibilizadas pela Cetip para liquidar financeiramente as operações por ela cursadas, dependendo do seu tipo, do ativo objeto negociado e do horário do seu lançamento.

Diversas navegações são permitidas possibilitando migrar de consultas sintéticas para as consultas mais analíticas, detalhando assim as informações consultadas, tudo através de um simples clique.

A confirmação financeira para a Janela Multilateral (Cetip) é efetuada pelo Banco Liquidante na totalidade dos valores a débito ou a crédito das suas operações e dos outros Participantes para os quais liquida.

Quando da confirmação de financeiro pela Modalidade Bruta, operação por operação, informações complementares são disponibilizadas para nortear o Banco Liquidante no correto procedimento.

Observação: Para maiores informações sobre como acessar o módulo, consulte o manual do NoMe.

Operações cursadas no âmbito da Cetip

Operações de risco de emissor

- Emissões e resgates (no vencimento) de títulos e valores mobiliários;
- Aplicações e resgates de cotas de fundos;
- Recompra pelo emissor com baixa automática de títulos e valores mobiliários;
- Recompra pelo emissor ou por empresas de seu conglomerado financeiro (conforme definido pelo CMN;
- Conselho Monetário Nacional), com a manutenção dos títulos e valores mobiliários nos sistemas;
- Revenda de títulos e valores mobiliários de emissão própria ou de empresas de um mesmo conglomerado financeiro;
- Pagamento de eventos previstos;
- Operações de intermediação (brokeragem) na colocação primária de títulos e valores mobiliários;
- Vencimento de CPR Financeira (Cédula de Produto Rural);
- Cessão, aquisição e retrocessão de crédito;
- Emissão de contratos da CONAB.

Derivativos

- Swap (prêmios, antecipações, intermediações, rebates e resgates);
- Termo de Moeda (antecipações, intermediações e resgates).

Operações de mercado secundário

- Compra e venda final;
- Compra e venda compromissada;
- Retorno do compromisso, obrigatoriamente comandado pelas partes;
- Recompra efetuada através de sistema eletrônico de negociação – tela cega, pelo emissor ou por empresas de seu conglomerado financeiro, com a manutenção dos títulos e valores mobiliários nos sistemas;
- Revenda de títulos e valores mobiliários efetuada através de sistema eletrônico de negociação – tela cega, pelo emissor ou por empresas de seu conglomerado financeiro.

Operações de simples registro

- Vencimento de CPR Física (Cédula de Produto Rural);
- Emissão/depósito de Títulos e Valores Mobiliários e de Cotas de Fundos, sem liquidação financeira no âmbito da Cetip;
- Transferência de títulos dados em garantia de operações em outros mercados;
- Operações com Conta de Cliente 1 ou Cliente 2 da própria Instituição;
- Vinculações e Desvinculações para/da conta de Reserva Técnica (SUSEP e ANS);
- Caução de ativos.

Outras

- Retenção de Imposto de Renda;
- Custo Cetip.

Modalidades de liquidação financeira

Cetip (Multilateral)

Modalidade em que o financeiro das operações é compensado multilateralmente por Participante.

Bruta Bt Aut (Bruta Book Transfer confirmação automática)

Modalidade em que o Banco Liquidante indicado seja o mesmo tanto para o vendedor quanto para o comprador e a liquidação é automaticamente confirmada pelo sistema.

Bruta Bt (Bruta Book Transfer)

Modalidade em que o Banco Liquidante indicado seja o mesmo tanto para o vendedor quanto para o comprador e necessita de confirmação por este Banco Liquidante.

Bruta STR

Modalidade em que os Bancos Liquidantes do vendedor e do comprador são diferentes, necessitando da transferência financeira via STR. A Sensibilização das reservas bancárias dos envolvidos é imediata.

Bilateral

Modalidade que permite a compensação dos valores financeiros do conjunto das operações realizadas entre dois Participantes.

2.2 Ações dos botões das telas

Os botões das telas exibidas ao longo do manual estão relacionados às seguintes ações:

Botão	Funcionalidade
Atualizar	Re-executa a consulta a partir dos filtros informados na tela de filtro.
Confirmar	Confirma os dados apresentados em tela.
Confirmar todos	Marca todos os botões de confirmação.
Corrigir	Retorna a tela anterior com os dados editados para possível correção.
Desistir	Não processa as informações, saindo da tela e voltando à página do NoMe.
Enviar	Processa as informações, levando para a tela de confirmação.
Limpar Campos	Limpa os campos já preenchidos.
Obter no Formato	Botão que permite gravar a consulta exibida na tela em formato texto (.txt) e em planilha Excel (.xls). Com o arquivo exibido no formato desejado, o usuário pode salvá-los em seu diretório. Basta clicar na opção: Arquivo/Salvar Como.
Pesquisar	Realiza pesquisa de acordo com dados inseridos na tela filtro.
Prosseguir	Prossegue com a ação indicada na tela.
Rejeitar todos	Marca todos os botões de rejeição.
Voltar	Volta à tela anterior com os últimos dados digitados.

3 CETIP > CONSULTAS

3.1 Banco Liquidante

Menu Posição Financeira > Cetip > Consultas > Banco Liquidante

Visão Geral

Consulta exclusiva para modalidade de liquidação Cetip, que exibe a posição financeira concisa do Banco Liquidante por data de liquidação e a situação de cada liquidação.

Tela de Filtro - Banco Liquidante

Banco Liquidante	
Bco.Liquid. (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Banco Liquidante (Razão Social):	<input type="text"/>
Data de Liquidação:	<input type="text" value="26"/> / <input type="text" value="11"/> / <input type="text" value="2014"/>
Status de Liquidação Crédito	<input type="text" value="v"/>
Status de Liquidação Débito	<input type="text" value="v"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/>	

Para que a consulta seja realizada o usuário deve preencher algum campo e clicar no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema exibe tela de relação com as informações financeiras relativas a busca.

Descrição dos campos da Tela Filtro - Banco Liquidante

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.
Data de Liquidação	Data em que a liquidação foi realizada.
Status de Liquidação Crédito	Estado em que se encontra a liquidação do crédito. Consulte os Tipos de Status de Liquidação.
Status de Liquidação Débito	Estado em que se encontra a liquidação do débito. Consulte os Tipos de Status de Liquidação.

Tela de Relação - Banco Liquidante


Banco Liquidante							
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 12 de 12)							
Data e Hora da Consulta: 26/11/2014 - 16:59:13							
	Liquidante	STRWeb	ISPBI	Valor de Débito	Situação Liquidação Débito	Valor de Crédito	Situação Liquidação Crédito
	TESTE	N	60746948	0,00	LIQUIDADA	60,02	LIQUIDADA
<< < 1 <input type="text"/> Exibir página > >>							
Obter no formato: <input type="text"/> Excel <input type="text"/>							

(continua)

Valor em R\$	Data de Liquidação	Nome Simplificado	CNPJ	Número Controle Camara
171,50	21/11/2014	COSIP	83.107.704/0001-95	20141121115425000035

(fim)

O resultado da busca mostra a posição financeira do Banco Liquidante em uma determinada data.

Ao clicar no ícone , é exibida a consulta **Bco Liquidante e Participante**, referente ao grupo de operações especificado na linha selecionada.

Observação: Os números exibidos no campo ISPBIF representam o código identificador nas operações de débito.

3.2 Participante

Menu Posição Financeira > Cetip > Consultas > Participante

Visão Geral

Consulta exclusiva para modalidade de liquidação Cetip, que exibe a posição financeira concisa do Participante por modalidade e data de liquidação.

Tela de Filtro - Participante

Participante			
Participante (Nome Simplificado):	<input type="text"/>		
Participante (Razão Social):	<input type="text"/>		
Data de Liquidação:	<input type="text" value="19"/>	<input type="text" value="9"/>	<input type="text" value="2014"/>
	<input type="button" value="Pesquisar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/>	

Para que a consulta seja realizada o usuário deve preencher algum campo e clicar no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema exibe tela de relação com as informações financeiras relativas a busca.

Descrição dos campos da Tela Filtro de Filtro - Participante

Campo	Descrição
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Data de Liquidação	Data em que a liquidação foi realizada.

Tela de Relação - Participante

Participante

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 3 de 3)

Data e Hora da Consulta: 19/09/2014 - 11:43:16

Modalidade de Liquidação	Participante	Data de Liquidação	CNPJ	Valor em R\$	Número da Conta
Cetip	TESTE - BCO RIO S/A	19/09/2014	05.000.005/0001-38	0,15	05000.00-5
"	TESTE - RIO LEASING S/A ARREND. MERCANTIL	19/09/2014	33.287.947/0001-84	-161.683,39	88896.40-1
"	TESTE - SEGURADORA BRANCO S/A	19/09/2014	50.564.053/0001-03	3.459.268.535,45	54545.70-0

« « 1 Exibir página » »

Obter no formato: Excel ▾

Na tela de relação é mostrado o resultado da busca com as informações financeiras concisas do Participante solicitado.

3.3 Banco Liquidante e Participante

Menu Posição Financeira > Cetip > Consultas > Banco Liquidante e Participante

Visão Geral

Consulta exclusiva para modalidade de liquidação Cetip, que exibe a posição financeira dos Participantes.

Quando a consulta for realizada por um Banco Liquidante a função exibe seu saldo financeiro e dos Participantes para os quais presta serviço de liquidação. Quando efetuada por um Participante (não liquidante) exibe o seu saldo financeiro por Banco Liquidante.

Tela de Filtro - Banco Liquidante e Participante

Banco Liquidante e Participante

Bco.Liquid. (Nome Simplificado):

Banco Liquidante (Razão Social):

Participante (Nome Simplificado):

Participante (Razão Social):

Data de Liquidação: / /

Status de Liquidação:

Para que a consulta seja realizada o usuário deve preencher algum campo e clicar no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema exibe tela de relação com as informações financeiras relativas a busca.

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Banco Liquidante e Participante

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.

Campo	Descrição
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Data de Liquidação	Data em que a liquidação foi realizada.
Status de Liquidação Crédito	Estado em que se encontra a liquidação do crédito. Consulte os Tipos de Status de Liquidação.

Tela de Relação - Banco Liquidante e Participante

Banco Liquidante e Participante

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 3 de 3)

Data e Hora da Consulta: 19/09/2014 - 15:39:32

Modalidade de Liquidação	Liquidante	STRWeb	Participante	Data de Liquidação	Valor em R\$	Status da Liquidação	CNPJ	Número da Conta
 Cetip	TESTE - BANCO BRACCE S/A	N	TESTE - BCO RIO S/A	19/09/2014	0,15	ATIVA	05.000.005/0001-38	05000.00-5
 *	TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A	N	TESTE - RIO LEASING S/A ARREND. MERCANTIL	19/09/2014	-161.683,39	ATIVA	33.287.947/0001-84	88896.40-1
 *	TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A	N	TESTE - SEGURADORA BRANCO S/A	19/09/2014	3.459.268.535,45	ATIVA	50.564.053/0001-03	54545.70-0

« 1 Exibir página »

Obter no formato: Excel

Nesta tela é exibida a posição financeira do Banco Liquidante e dos Participantes, para os quais liquida.

Ao clicar o ícone , é exibida a consulta **Bco Liquidante, Participante e Sistema**, referente ao grupo de operações da linha selecionada.

3.4 Banco Liquidante e Sistema

Menu Posição Financeira > Cetip > Consultas > Banco Liquidante e Sistema

Visão Geral

Consulta exclusiva para modalidade de liquidação Cetip, que exibe a posição financeira do Banco Liquidante por sistema.

Tela de Filtro - Banco Liquidante e Sistema

Banco Liquidante e Sistema

Bco.Liquid. (Nome Simplificado):

Banco Liquidante (Razão Social):

Sistema:

Data de Liquidação: / /

Status de Liquidação Crédito

Status de Liquidação Débito

Para que a consulta seja realizada o usuário deve preencher algum campo e clicar no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema exibe tela de relação com as informações financeiras relativas a busca.

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Banco Liquidante e Sistema

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.
Sistemas	O Participante pode especificar o sistema onde relacionado a liquidação financeira para facilitar a busca.
Data de Liquidação	Data em que a liquidação foi realizada.
Status de Liquidação Crédito	Estado em que se encontra a liquidação do crédito. Consulte os Tipos de Status de Liquidação.
Status de Liquidação Débito	Estado em que se encontra a liquidação do débito. Consulte os Tipos de Status de Liquidação.

Tela de Relação - Banco Liquidante e Sistema

Banco Liquidante e Sistema									
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 3 de 3)									
Data e Hora da Consulta: 19/09/2014 - 15:51:07									
Modalidade de Liquidação	Liquidante	STRWeb	Data de Liquidação	Sistema	Valor em R\$	Situação Liquidação Crédito	Situação Liquidação Débito	CNPJ	Número da Conta
Cetip	TESTE - BANCO BRACCE S/A	N	19/09/2014	CETIP21	0,15	ATIVA	ATIVA	05.000.005/0001-38	05000.00-5
-	TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A	N	19/09/2014	CETIP21	-161.683,39	ATIVA	ATIVA	33.287.947/0001-84	88896.40-1
-	TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A	N	19/09/2014	CETIP21	3.459.268.535,45	ATIVA	ATIVA	50.564.053/0001-03	54545.70-0

> >>

Na tela de relação é mostrado o resultado da busca com as informações financeiras de um determinado Banco Liquidante por sistema, no caso o sistema CETIP21.

3.5 Banco Liquidante, Participante e Sistema

Menu Posição Financeira > Cetip > Consultas > Banco Liquidante, Participante e Sistema

Visão Geral

Consulta exclusiva para modalidade de liquidação Cetip, que exibe a posição financeira do Banco Liquidante por Participante e sistema.

Tela de Filtro - Banco Liquidante, Participante e Sistema

Banco Liquidante, Participante e Sistema

Bco.Liquid. (Nome Simplificado):

Banco Liquidante (Razão Social):

Participante (Nome Simplificado):

Participante (Razão Social):

Sistema:

Data de Liquidação: / /

Status de Liquidação

Para que a consulta seja realizada o usuário deve preencher algum campo e clicar no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema exibe tela de relação com as informações financeiras relativas a busca.

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Banco Liquidante, Participante e Sistema.

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Sistema	O Participante pode especificar o sistema onde relacionado a liquidação financeira para facilitar a busca.
Data de Liquidação	Data em que a liquidação foi realizada.
Status de Liquidação	Estado em que se encontra a liquidação do crédito.

Consulte os Tipos de *Status* de Liquidação.

Tela de Relação - Banco Liquidante, Participante e Sistema

Banco Liquidante, Participante e Sistema

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)
Data e Hora da Consulta: 19/09/2014 - 15:55:13


 Critério de pesquisa

Modalidade de Liquidação	Liquidante	STRWeb	Participante	Data de Liquidação	Sistema	Valor em R\$	Status da Liquidação	CNPJ	Número da Conta
 Cetip	 TESTE - BANCO BRACCE S/A N		TESTE - BCO RIO S/A	19/09/2014	CETIP21	0,15	ATIVA	05.000.005/0001-38	05000-00-5

« < 1 > » Exibir página

Obter no formato: v

O resultado desta pesquisa apresenta a posição financeira de um Banco Liquidante por Participantes e sistemas.

Ao clicar o botão  é exibida a consulta "Análítica de Saldo Financeiro" referente ao grupo de operações especificado na linha selecionada.

Observação: Ao sobrepor o mouse na figura  é exibido o somatório total do liquidante correspondente ao grupo de operações.

Ex.:

3.6 Análítica de Saldo Financeiro

Menu Posição Financeira > Cetip > Consultas > Análítica de Saldo Financeiro

Visão Geral

Consulta exclusiva para modalidade de liquidação Cetip, que permite ao Participante a visualização detalhada do seu saldo financeiro. Estes saldos são a consolidação de um grupo de operações por alguns critérios, como: de Participante, Banco Liquidante, sistema, entre outros.

Tela de Filtro - Análítica de Saldo Financeiro

Análítica de Saldo Financeiro	
Bco.Liquid. (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Banco Liquidante (Razão Social):	<input type="text" value="TESTE - BANCO BRACCE"/>
Participante (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Participante (Razão Social):	<input type="text" value="TESTE - BCO RIO S/A"/>
Conta do Participante:	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>
Sistema:	<input type="text" value="v"/>
Data de Liquidação:	<input type="text" value="19"/> / <input type="text" value="9"/> / <input type="text" value="2014"/>
Data de Origem:	<input type="text"/> / <input type="text"/> / <input type="text"/>
Tipo Débito Crédito	<input type="text" value="v"/>
Status de Liquidação	<input type="text" value="v"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/>	




Para que a consulta seja realizada o usuário deve preencher algum campo e clicar no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema exibe tela de relação com as informações financeiras relativas à busca.

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Análítica de Saldo Financeiro

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.

Campo	Descrição
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Conta do Participante	Código Cetip do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Sistema	O Participante pode especificar o sistema onde está relacionado a liquidação financeira para facilitar a busca.
Data de Liquidação	Data em que a liquidação foi realizada.
Data de Origem	Data em que foi originado o resultado financeiro.
Tipo Débito Crédito	Indica se o Valor é para ser debitado ou creditado na posição financeira do Participante.
Status de Liquidação	Estado em que se encontra a liquidação do crédito. Consulte os Tipos de Status de Liquidação.

Tela de Relação - Análítica de Saldo Financeiro

Análítica de Saldo Financeiro										
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)										
Data e Hora da Consulta: 19/09/2014 - 16:02:23										
 Critério de pesquisa										
Liquidante	STRWeb	Participante	CNPJ	Data de Liquidação	Data de Origem	Conta	Sistema	Valor em R\$	Status da Liquidação	Deb/Cred
 TESTE - BANCO BRACCE S/A	N	TESTE - BCO RIO S/A	05.000.005/0001-38	19/09/2014	19/09/2014	05000.10-8	CETIP21	0.12	ATIVA	C
 *	N	"	05.000.005/0001-38	19/09/2014	19/09/2014	05000.20-1	CETIP21	0.03	ATIVA	C

<< 1 Exibir página >>
 Obter no formato: Excel

Na tela de relação é mostrado o resultado da busca com o saldo financeiro, datas de liquidação e origem de resultado financeiro, entre outras as informações financeiras referentes a determinado Participante.

Observação: Ao sobrepor o mouse na figura  é exibido o somatório total do liquidante correspondente ao grupo de operações.

Ex.: Total do Participante: : 740.034,17

3.7 Consulta aos Créditos e Débitos

Menu Posição Financeira > Cetip > Consultas > Consulta aos Créditos e Débitos

Visão Geral

Permite ao Banco Liquidante a consulta analítica dos valores de crédito e de débito das operações dos Participantes para os quais presta serviço de liquidação, na modalidade de liquidação Cetip.

Tela de Filtro - Consulta aos Créditos e Débitos

Consulta aos Créditos e Débitos	
Banco Liquidante (Razão Social):	<input type="text"/>
Bco.Liquid. (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Conta (Banco Liquidante):	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>
Participante (Razão Social):	<input type="text"/>
Participante (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Conta do Participante:	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>
Data de Liquidação:	<input type="text"/> / <input type="text"/> / 2014
	<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/>

Para que a consulta seja realizada o usuário deve preencher algum campo e clicar no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema exibe tela de relação com as informações financeiras relativas à busca.

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Consulta aos Créditos e Débitos

Campo	Descrição
Conta (Banco Liquidante)	Código Cetip do Banco Liquidante.
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Conta do Participante	Código Cetip do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Data de Liquidação	Preenchimento obrigatório. Data em que a liquidação foi realizada.

Tela de Relação - Consulta de Créditos e Débitos

Consulta aos Créditos e Débitos

Página 1 de 2 (Linhas 1 a 25 de 42)

Data e Hora da Consulta: 26/11/2014 - 17:36:42

Nome Simplificado	STRWeb	Participante	CNPJ	Conta	Valor	Valor Crédito	Valor Débito	Data de Liquidação
BRACI	N	ALBERTOFDO	00.060.006/6000-03	01702.00-8	6.010,99	6.010,99	0,00	26/11/2014
BRACI	N	RIOBM	05.000.005/0001-38	05000.00-5	1.113.487.729,93	9.527,76	0,00	26/11/2014

« « 1 Exibir página » »

Obter no formato: Excel ▾

Na tela de relação é mostrado o resultado da busca com saldos, valores de crédito e débito, entre outras informações financeiras referentes a Participantes de um Banco Liquidante.

4 CETIP > FERRAMENTAS

4.1 Confirmação de Financeiro

Posição Financeira > Cetip > Ferramentas > Confirmação de Financeiro

Visão Geral

Esta função disponibiliza, aos Bancos Liquidantes, consulta dos valores financeiros relativos às suas operações e de outros Participantes para os quais liquida no âmbito da Cetip, bem como, a confirmação do valor a débito ou a crédito, a serem liquidados em conta de reserva bancária ou no próprio ambiente do Banco (book-transfer). Esta confirmação também é disponibilizada via mensagem.

Após a confirmação, caso as transferências de fundos necessitem de movimentação no STR (nas contas de reserva bancárias), os Bancos Liquidantes Devedores devem encaminhar as respectivas ordens de transferência para àquele ambiente a favor da Cetip, que por sua vez, após o recebimento, transfere para as contas de reservas bancárias dos Bancos Liquidantes Credores, procedimentos estes executados exclusivamente através de mensagens.

A não observância dos horários estabelecidos, tanto para confirmação dos resultados apurados como para transferência efetiva do montante via STR, implica no cancelamento das operações registradas.

Alertamos que é importante se atentar aos comunicados da B3 referentes as datas e horários de funcionamento, inclusive em feriados, onde deverão manter em seus locais de trabalho pessoal qualificado para atender a quaisquer necessidades relacionadas às contas sob sua responsabilidade, inclusive com habilitação para efetuar confirmações financeiras, nos termos das regras do Sistema de Pagamentos Brasileiro (SPB).

Observação: Tem acesso a essa função, somente usuários habilitados os seguintes perfis: - Liquidante_Supervisor; ou - Liquidante_Digitador_Confirmador.

Tela de Filtro - Confirmação de Financeiro

Confirmação de Financeiro

Bco.Liquid. (Nome Simplificado): Banco Liquidante (Razão Social):

Pesquisar

Limpar Campos

Na Tela de filtro, o usuário deve informar, no mínimo, um dos campos e clicar no botão **Pesquisar**.

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Confirmação de Financeiro

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Campo de preenchimento obrigatório. Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.

Através da tela o Banco Liquidante pode confirmar ou rejeitar o financeiro de operações sob seu comando. Para isso deve selecionar o círculo referente a operação e clicar no botão **Processar**.

Caso o Participante desejar confirmar ou rejeitar todos os financeiros de uma só vez, basta clicar ou no botão Confirmar Todos, ou no botão Rejeitar Todos e clicar no botão Processar. Após clicar no botão **Processar** é apresentada tela para confirmação da opção anterior.

4.2 Transferência modalidade Cetip para Bruta

Posição Financeira > Cetip > Ferramentas > Transferência modalidade Cetip para Bruta

Visão Geral

Função disponível para os seguintes instrumentos financeiros: DEB, NC e CFF.

Esta função está disponível para Participantes Liquidantes.

Por meio dessa função o Banco Liquidante ou o Agente de Liquidação, podem solicitar a troca de modalidade dos eventos da data, dos tipos de ativos DEB, NC e CFF, da modalidade Cetip para a modalidade Bruta. Os lançamentos nessa função podem ocorrer dentro da modalidade CTP24.

Não é permitido o cancelamento da troca de modalidade de liquidação de Cetip para Bruta.

Não é admitida a troca de modalidade de liquidação de Cetip para Bruta de evento de CFF que tenha sofrido retenção de IR. Para eventos de DEB e NC, a retenção de IR, quando houver, deverá ser comandada após a troca de modalidade de Cetip para Bruta.

Tela de Transferência modalidade Cetip para Bruta

Transferência modalidade Cetip para Bruta

Liquidante (Nome Simplificado)

Liquidante (Razão Social)

Emissor (Nome Simplificado)

Emissor (Conta)

Emissor (CNPJ)

Tipo IF

Código IF

Pesquisar

Limpar Campos

Desistir

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Transferência modalidade Cetip para Bruta

Campo	Descrição
Liquidante (Nome Simplificado)	Campo de preenchimento obrigatório caso o campo “Liquidante (Razão Social)” não seja preenchido.
Liquidante (Razão Social)	Campo de preenchimento obrigatório caso o campo “Liquidante (Nome Simplificado)” não seja preenchido.
Emissor (Nome Simplificado)	Campo de preenchimento não obrigatório, para o nome simplificado do emissor do ativo que terá a modalidade de liquidação de evento(s) alterada.
Emissor (Conta)	Campo de preenchimento não obrigatório, para a conta do emissor do ativo que terá a modalidade de liquidação de evento(s) alterada.
Emissor (CNPJ)	Campo de preenchimento não obrigatório, para o CNPJ do emissor do ativo que terá a modalidade de liquidação de evento(s) alterada.
Tipo IF	Campo de preenchimento não obrigatório. Caixa com as opções DEB, NC e CFF.
Código IF	Campo de preenchimento opcional.

Obs: A coluna Valor em R\$ - apresenta o valor em Reais devido pelo Emissor para o código IF, somando o(s) eventos existentes na data. Por exemplo, se o Emissor tiver evento de Amortização e de Juros, deve ser apresentado o valor somado devido pelos dois eventos.

Exemplo Ação TROCAR: Tela Relação

Transferência modalidade Cetip para Bruta

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 3 de 3)
Data e Hora da Consulta: 13/07/2015 - 10:31:50

Critério de pesquisa

Ação	Liquidante (Nome Simplificado)	Liquidante (Razão Social)	Emissor (Nome Simplificado)	Emissor (Conta)	Emissor (CNPJ)	Tipo IF	Código IF	Valor em R\$
TROCAR	KEBBC	TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A	CRVGAM	02479.40-2	08.249.021/0001-57	DEB	CRVGDEP1	-24,64
	KEBBC	TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A	CRVGAM	02479.40-2	08.249.021/0001-57	DEB	CRVGMIGRA	-697,21
	KEBBC	TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A	CRVGAM	02479.40-2	08.249.021/0001-57	DEB	CRVGTKOUT	-33.671,25

Atualizar Voltar

<< 1 Exibir página >>

Obter no formato: Excel

Ao selecionar a ação TROCAR, o sistema apresenta tela abaixo:

Transferência modalidade Cetip para Bruta				
Dados da Transferência modalidade Cetip para Bruta				
Liquidante (Nome Simplificado) KEBBC				
Liquidante (Razão Social) TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A				
Emissor (Nome Simplificado) CRVGAM				
Emissor (Conta) 02479.40-2				
Emissor (CNPJ) 08.249.021/0001-57				
Tipo IF DEB				
Código IF CRVGDEP1				
Valor em R\$ -24,64				
Detalhe das Operações para Transferência Modalidade Cetip para Bruta				
Tipo IF	Código IF	CódigoOperacao	Tipo Operação	Valor em R\$
DEB	CRVGDEP1	60	PAGAMENTO DE JUROS	0,00
DEB	CRVGDEP1	69	PAGAMENTO DE PREMIO	-24,64
DEB	CRVGDEP1	73	PAGAMENTO PARTICIPACAO LUCROS	0,00
DEB	CRVGDEP1	74	PAGAMENTO DE AMORTIZACAO PERIODICA	0,00
<input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Sair"/>				

Exemplo Ação TROCAR E REJEITAR PAGAMENTO AUTOMATICAMENTE: Tela Relação

Transferência modalidade Cetip para Bruta									
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)									
Data e Hora da Consulta: 12/04/2017 - 09:55:26									
<input type="button" value="Critério de pesquisa"/>									
Ação	Liquidante (Nome Simplificado)	Liquidante (Razão Social)	Emissor (Nome Simplificado)	Emissor (Conta)	Emissor (CNPJ)	Tipo IF	Código IF	Valor em R\$	
TROCAR E REJEITAR PAGTO AUTOMATICAMENTE	KEBBC	TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A	RIOAM	88896.40-1	33.287.947/0001-84	DEB	SECUR950	-33.400,28	
<input type="button" value="Exibir página"/>									
<input type="button" value="Obter no formato: Excel"/>									

Ao selecionar a ação TROCAR E REJEITAR PAGAMENTO AUTOMATICAMENTE, o sistema apresenta tela abaixo:

Transferência modalidade Cetip para Bruta				
Dados da Transferência modalidade Cetip para Bruta com rejeição automática				
Liquidante (Nome Simplificado) KEBBC				
Liquidante (Razão Social) TESTE - BANCO KEB DO BRASIL S/A				
Emissor (Nome Simplificado) RIOAM				
Emissor (Conta) 88896.40-1				
Emissor (CNPJ) 33.287.947/0001-84				
Tipo IF DEB				
Código IF SECUR950				
Valor em R\$ -33.400,28				
Meu Número 161587				
Detalhe das Operações para Transferência Modalidade Cetip para Bruta com rejeição automática				
Tipo IF	Código IF	CódigoOperacao	Tipo Operação	Valor em R\$
DEB	SECUR950	60	PAGAMENTO DE JUROS	-3.282,98
DEB	SECUR950	69	PAGAMENTO DE PREMIO	-117,30
DEB	SECUR950	74	PAGAMENTO DE AMORTIZACAO PERIODICA	-30.000,00
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>				

Após confirmar a operação, o sistema apresenta a mensagem abaixo:

Operação 2017041219646128 Registrada com Sucesso.

5 BRUTA > CONSULTAS

5.1 Posição Financeira Analítica Bruta

Menu Posição Financeira > Bruta > Consulta > Posição Financeira Analítica Bruta

Visão Geral

Permite ao Banco Liquidante a identificação das operações encaminhadas para a modalidade de liquidação financeira Bruta (STR, BT ou BT AUT) no âmbito da Cetip. Nesta consulta, são disponibilizados os números de comando utilizado na digitação da operação, bem como o sistema que acatou o registro, que permite ao Banco Liquidante ou Participante uma melhor conciliação da posição.

Tela de Filtro - Posição Financeira Analítica Bruta

Posição Financeira Analítica Bruta	
Bco.Liquid. (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Banco Liquidante (Razão Social):	<input type="text"/>
Participante (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Participante (Razão Social):	<input type="text"/>
Conta do Participante:	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>
Número Operação:	<input type="text"/>
Sistema:	<input type="text" value="v"/>
Tipo de Instr. Financeiro:	<input type="text" value="v"/>
Data de Liquidação:	19 <input type="text"/> / 9 <input type="text"/> / 2014
Modalidade de Liquidação	<input type="text" value="v"/>
Tipo Débito Crédito	<input type="text" value="v"/>
Status de Liquidação	<input type="text" value="v"/>
Número de Associação:	<input type="text"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/>	

Para que a consulta seja realizada o usuário deve preencher algum campo e clicar no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema exibe tela de relação com as informações financeiras baseadas na busca.

Descrição dos campos da Tela Filtro de Filtro - Posição Financeira Analítica Bruta

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.

Campo	Descrição
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Conta do Participante	Código Cetip do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Número Operação	Número do Participante na operação.
Sistema	O Participante pode especificar o sistema onde relacionado a liquidação financeira para facilitar a busca.
Tipo de Instr. Financeiro	Caixa de seleção com lista pré definida de instrumentos financeiros. Informar o ativo objeto de pesquisa.
Data de Liquidação	Data em que a liquidação foi realizada.
Modalidade de Liquidação	Modalidade de liquidação financeira, aceita pela Cetip, no qual a operação financeira será liquidada: Bruta STR, Bruta BT ou Bruta Aut. Tipos de operações para modalidades.
Tipo Débito Crédito	Indica se o valor é para ser debitado ou creditado na posição financeira do Participante.
Status de Liquidação	Estado em que se encontra a liquidação do crédito. Consulte os Tipos de Status de Liquidação.
Número de Associação	Número da operação associada.

Tela de Relação - Posição Financeira Analítica Bruta

Posição Financeira Analítica Bruta

Página 1 de 4 (Linhas 1 a 25 de 89)

Data e Hora da Consulta: 19/09/2014 - 17:05:50

Liquidante	STRWeb	Participante	Valor em R\$	Status da Liquidação	Conta	CNPJ	Número da Operação
Σ TESTE - BANCO BRACCE S/A	N	Σ TESTE - BCO RIO S/A	300,00	LIQUIDADA	05000.00-5	05.000.005/0001-38	120
Σ "	N	Σ "	5.964,00	PENDENTE CONFIRMACAO	05000.00-5	05.000.005/0001-38	20714691

« « 1 Exibir página » »

Obter no formato: Excel ▾

(continua)

Sistema	Tipo IF	Código IF	Data de Liquidação	Modalidade de Liquidação	Número Controle Camara	Histórico	Num. Associação	Num. Controle LTR
CETIP21	CRI	17E0000215	24/01/2018	Bruta STR	#2018012313315708	CETIP21#2018012313315708	55116814	2018012313315708
CETIP21	SWAP	----	24/01/2018	"	#2018012413317292	CETIP21#2018012413317292	----	2018012413317292
CETIP21	CRA	CRA017001PD	24/01/2018	"	#2018012313313777	CETIP21#2018012313313777	55116810	2018012313313777

(fim)

Na tela de relação é mostrado o resultado da busca com as informações financeiras referentes a determinado Participante.

Observação: Ao sobrepor o mouse na figura  é exibido o somatório total do liquidante correspondente ao grupo de operações.

Ex.:

5.2 Posição Financeira Sintética Bruta

Menu Posição Financeira > Bruta > Consulta > Posição Financeira Sintética Bruta

Visão Geral

Permite ao Banco Liquidante a identificação da quantidade de operações encaminhadas para a modalidade de liquidação financeira Bruta (STR, BT ou BT AUT) no âmbito da Cetip, com o seu devido saldo total apurado.

Tela de Filtro - Posição Financeira Sintética Bruta

Posição Financeira Sintética Bruta

Bco.Liquid. (Nome Simplificado):

Banco Liquidante (Razão Social):

Data de Liquidação: / /

Modalidade de Liquidação

Status de Liquidação

Tipo Débito Crédito

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Posição Financeira Sintética Bruta

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.
Data de Liquidação	Data em que a liquidação foi realizada.
Modalidade de Liquidação	Modalidade de liquidação financeira, aceita pela Cetip, no qual a operação financeira será liquidada: Bruta STR, Bruta BT ou Bruta Aut. Tipos de operações para modalidades.
Status de Liquidação	Indica em que situação de liquidação a posição financeira se encontra no momento em que a consulta é realizada. Consulte os Tipos de Status de Liquidação.
Tipo Débito Crédito	Indica se o Valor é para ser debitado ou creditado na posição financeira do Participante.

Tela de Relação - Posição Financeira Sintética Bruta**Posição Financeira Sintética Bruta**

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 6 de 6)

Data e Hora da Consulta: 19/09/2014 - 17:18:33

Liquidante	STRWeb	Modalidade de Liquidação	Status da Liquidação	Deb/Cred	Valor em R\$	Qtd. Operações	Data de Liquidação
BRACCEBC	N	Bruta STR	PENDENTE CONFIRMACAO	C	7.965,08	5	19/09/2014
BRACCEBC	N	Bruta BT	PENDENTE CONFIRMACAO	D	-7.949,89	2	19/09/2014
"	N	"	PENDENTE CONFIRMACAO	C	7.949,89	2	19/09/2014
BRACCEBC	N	Bruta STR	LIQUIDADA	C	540,00	3	19/09/2014
KEBBC	N	"	PENDENTE CONFIRMACAO	C	12.419.754,32	40	19/09/2014
BRACCEBC	N	"	PENDENTE CONFIRMACAO	D	-3.299,19	37	19/09/2014

 Exibir página

Obter no formato: Excel

Na tela de relação é mostrado o resultado da busca com as informações financeiras referentes a determinado Participante.

5.3 Confirmação de Financeiro

Menu Posição Financeira > Bruta > Ferramentas > Confirmação de Financeiro

Visão Geral

Permite realizar a liquidação financeira de operação por operação.

Esta função disponibiliza aos Bancos Liquidantes consulta de todas as suas operações e de outros Participantes para os quais liquida no âmbito da Cetip, com seus respectivos valores financeiros, bem como, a confirmação do valor a débito ou a crédito, a serem liquidados em conta de reserva bancária.

A não observância dos horários estabelecidos, tanto para confirmação dos resultados apurados como para transferência efetiva do montante via STR, implica no cancelamento das operações registradas.

Alertamos que é importante se atentar aos comunicados da B3 referentes as datas e horários de funcionamento, inclusive em feriados, onde deverão manter em seus locais de trabalho pessoal qualificado para atender a quaisquer necessidades relacionadas às contas sob sua responsabilidade, inclusive com habilitação para efetuar confirmações financeiras, nos termos das regras do Sistema de Pagamentos Brasileiro (SPB).”

Observação: Tem acesso a essa função, somente usuários habilitados os seguintes perfis:
- **Liquidante_Supervisor**; ou - **Liquidante_Digitador_Confirmador**.

Tela de Filtro - Confirmação de Financeiro

Confirmação de Financeiro

Num Ctrl Operação:	<input type="text"/>
Valor :	<input type="text"/>
Bco.Liquid. (Nome Simplificado):	<input type="text" value="KEBBC"/>
Banco Liquidante (Razão Social):	<input type="text"/>
Participante (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Participante (Razão Social):	<input type="text"/>
Conta Principal:	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>
Participante Contraparte (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Participante Contraparte (Razão Social):	<input type="text"/>
Sistema:	<input type="text" value="v"/>
Modalidade de Liquidação	<input type="text" value="v"/>
	<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/>

Ao preencher algum campo da Tela Filtro e clicar no botão **Pesquisar** é apresentada tela com a relação das operações com opção de confirmação.

Descrição dos campos da Tela Filtro de Filtro - Confirmação de Financeiro

Campo	Descrição
Num Ctrl Operação	Número para controle de operação
Valor	Valor total a ser liquidado.
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Conta Principal	Código Cetip do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante Contraparte (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante Contraparte (Razão Social)	Razão Social da Contraparte detentora de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Sistema	O Participante pode especificar o sistema onde relacionado a liquidação financeira para facilitar a busca.
Modalidade de Liquidação	Modalidade de liquidação financeira, aceita pela Cetip, no qual a operação financeira será liquidada: Bruta STR, Bruta BT ou Bruta Aut. Tipos de operações para modalidades.

Tela de Confirmação / Rejeição de Posições Brutas

Confirmação / Rejeição de posições Brutas

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 6 de 6)

Ação	Num Ctrl Operação	Valor	Liquidante	STRWeb	Cnpj Participante	Conta Participante	Participante	Contraparte	STRWeb Contraparte	Cod. Sistema	Modalidade
	2014112517230705	39,84	KEBBC	N	14.110.136/0136-51	01891.40-7	TESTE - BCO IMPERATOR S/A	LUSOBRASILEIROBM	N	CETP21	Bruta STR

A Caixa de Seleção oferece ao Participante duas opções: **Confirmar** e **Divergir**. Após selecionar as operações a serem confirmadas e clicar no botão **Enviar**, é exibida Tela de Relação com as operações selecionadas para confirmação.

Tela de Confirmação da Escolhas

Confirmação das escolhas

Ação	Num Ctrl Operação	Valor	Liquidante	STRWeb	Cnpj Participante	Conta Participante	Participante	Contraparte	STRWeb Contraparte	Cod. Sistema	Modalidade
Confirmar	2014112517230705	39,84	KEBBC	N	14.110.136/0136-51	01891.40-7	TESTE - BCO IMPERATOR S/A	LUSOBRASILEIROBM	N	CETP21	Bruta STR

Nesta tela, ao clicar no botão **Finalizar**, o Participante aceita o financeiro das operações selecionadas.

6 BILATERAL > CONSULTAS

6.1 Posição Financeira Analítica Bilateral

Menu Posição Financeira > Bilateral > Consulta > Posição Financeira Analítica Bilateral

Visão Geral

Permite ao Banco Liquidante visualizar o saldo apurado pela soma algébrica das compensações bilaterais, agrupadas por conta dos seus Participantes com todos os outros Participantes contrapartes na operação.

Tela de Filtro - Posição Financeira Analítica Bilateral

Posição Financeira Analítica Bilateral

Bco.Liquid. (Nome Simplificado):

Banco Liquidante (Razão Social):

Participante (Nome Simplificado):

Participante (Razão Social):

Conta do Participante: . -

Data de Liquidação: / / 2014

Modalidade de Liquidação

Status de Liquidação

Tipo Débito Crédito

Para que a consulta seja realizada o usuário deve preencher algum campo e clicar no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema exibe tela de relação com as informações financeiras relativas a busca.

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Posição Financeira Analítica Bilateral

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Conta do Participante	Código Cetip do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Data de Liquidação	Data em que a liquidação foi realizada.

Campo	Descrição
Modalidade de Liquidação	Modalidade de liquidação financeira, aceita pela Cetip, no qual a operação financeira será liquidada: STR, Bruta BT ou Bruta Aut. Tipos de operações para modalidades.
Status de Liquidação	Estado em que se encontra a liquidação do crédito. Consulte os Tipos de Status de Liquidação.
Tipo Débito Crédito	Indica se o Valor é para ser debitado ou creditado na posição financeira do Participante.

Tela de Relação - Posição Financeira Analítica Bilateral

Posição Financeira Analítica Bilateral

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)

Data e Hora da Consulta: 19/09/2014 - 17:26:17

Liquidante	STRWeb	Participante	Conta Participante	Situação Liquidação	Valor em R\$	Modalidade de Liquidação	Data de Liquidação	Participante Contraparte	Conta Contraparte
TESTE - BANCO BRACCE S/A	N	TESTE - BCO RIO S/A	05000.00-5	Estornada	150,25	Bilateral STR	19/09/2014	BANCO LEME S/A	10020.00-1
TESTE -	N	TESTE -	05000.00-5	Estornada	-40.494,75	"	19/09/2014	TESTE - BCO GABRIELA S/A	66661.00-5

« < 1 > » Exibir página

Obter no formato: Excel

Observação: Ao sobrepor o mouse na figura  é exibido o somatório total do liquidante correspondente ao grupo de operações.

Ex.: Total do Participante: : 740.034,17

6.2 Posição Financeira Sintética Bilateral

Menu Posição Financeira > Bilateral > Consulta > Posição Financeira Sintética Bilateral

Visão Geral

Permite ao Banco Liquidante visualizar o saldo total apurado pela soma algébrica das compensações bilaterais dos seus Participantes.

Tela de Filtro - Posição Financeira Sintética Bilateral

Posição Financeira Sintética Bilateral

Bco.Liquid. (Nome Simplificado):

Banco Liquidante (Razão Social):

Participante (Nome Simplificado):

Participante (Razão Social):

Data de Liquidação: 19 / 9 / 2014

Modalidade de Liquidação:

Status de Liquidação:

Tipo Débito Crédito:

Para que a consulta seja realizada o usuário deve preencher algum campo e clicar no botão **Pesquisar**. Em seguida o sistema exibe tela de relação com as informações financeiras relativas a busca.

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Posição Financeira Sintética Bilateral

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Data de Liquidação	Data em que a liquidação foi realizada.
Modalidade de Liquidação	Modalidade de liquidação financeira, aceita pela Cetip, no qual a operação financeira será liquidada: STR, Bruta BT ou Bruta Aut. Tipos de operações para modalidades.
Status de Liquidação	Estado em que se encontra a liquidação do crédito. Consulte os Tipos de Status de Liquidação.
Tipo Débito Crédito	Indica se o Valor é para ser debitado ou creditado na posição financeira do Participante.

Tela de Relação - Posição Financeira Sintética Bilateral

Posição Financeira Sintética Bilateral								
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)								
Data e Hora da Consulta: 19/09/2014 - 17:29:01								
Liquidante	STRWeb	Participante	Situação Liquidação	Valor em R\$	Modalidade de Liquidação	Data de Liquidação	Participante Contraparte	Histórico
 TESTE - BANCO BRACCE S/A	N	 TESTE - BCO RIO S/A	Estornada	150,25	BILATERAL	19/09/2014	BANCO LEME S/A	BILAT#20140919114105000014
 "	N	 "	Estornada	-40.494,75	"	19/09/2014	TESTE - BCO GABRIELA S/A	BILAT#20140919119605000015

Observação: Ao sobrepor o mouse na figura  é exibido o somatório total do liquidante correspondente ao grupo de operações.

Ex.:

6.3 Consulta aos Créditos e Débitos – Modalidade Bilateral

Menu Posição Financeira > Bilateral > Consulta > Consulta aos Créditos e Débitos

Visão Geral

Permite ao Banco Liquidante a consulta analítica dos valores de crédito e de débito das operações dos Participantes para os quais presta serviço de liquidação, na modalidade de liquidação Bilateral.

Tela de Filtro - Consulta de Créditos e Débitos

Consulta aos Créditos e Débitos	
Banco Liquidante (Razão Social):	<input type="text"/>
Bco.Liquid. (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Conta (Banco Liquidante):	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>
Participante (Razão Social):	<input type="text"/>
Participante (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Conta do Participante:	<input type="text"/> . <input type="text"/> - <input type="text"/>
Número Controle LTR:	<input type="text"/>
Data de Liquidação:	<input type="text"/> / <input type="text"/> / 2014
	<input type="button" value="Pesquisar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/>

Ao preencher algum campo da Tela Filtro e clicar no botão **Pesquisar** é apresentada tela com a relação das operações com opção de confirmação.

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Consulta de Créditos e Débitos

Campo	Descrição
Conta (Banco Liquidante)	Código Cetip do Banco Liquidante.
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Conta do Participante	Código Cetip do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Número Controle LTR	Número do controle da mensagem enviada pela Cetip informando o resultado bilateral de negociação.
Data de Liquidação	Efetiva data de movimentação financeira.

Tela de Relação - Consulta de Créditos e Débitos

Consulta aos Créditos e Débitos										
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 4 de 4)										
Data e Hora da Consulta: 26/11/2014 - 17:56:55										
Nome Simplificado	STRWeb	Participante	CNPJ	Modalidade de Liquidação	Conta	Valor	Valor Crédito	Valor Débito	Num. Controle LTR	Data de Liquidação
LUSOBRASILEIROBM	N	LEMEBM	10.020.001/0001-51	*	10020.00-1	700,00	700,00	0,00	20141126117905000028	26/11/2014

Na tela de relação é mostrado o saldo, valores de crédito e débito, entre outras informações financeiras referentes ao Participantes.

6.4 Confirmação de Financeiro

Menu Posição Financeira > Bilateral > Ferramentas > Confirmação de Financeiro

Visão Geral

Esta função disponibiliza aos Bancos Liquidantes consulta dos valores financeiros relativos às suas operações e de outros Participantes para os quais liquida no âmbito da Cetip, realizadas no âmbito da Cetip. Esta confirmação também é disponibilizada via mensagem.

Após a confirmação, caso as transferências de fundos necessitem de movimentação no STR (nas contas de reserva bancárias), os Bancos Liquidantes Devedores devem encaminhar as respectivas ordens de transferência para àquele ambiente a favor da Cetip, que por sua vez, após o recebimento, transfere para as contas de reservas bancárias dos Bancos Liquidantes Credores, procedimentos estes executados exclusivamente através de mensagens.

A não observância dos horários, estabelecidos, tanto para confirmação dos resultados apurados como para transferência efetiva do montante via STR, implica no cancelamento das operações registradas.

Alertamos que é importante se atentar aos comunicados da B3 referentes as datas e horários de funcionamento, inclusive em feriados, onde deverão manter em seus locais de trabalho pessoal qualificado para atender a quaisquer necessidades relacionadas às contas sob sua responsabilidade, inclusive com habilitação para efetuar confirmações financeiras, nos termos das regras do Sistema de Pagamentos Brasileiro (SPB).”

Observação: Tem acesso a essa função, somente usuários habilitados os seguintes perfis: - **Liquidante_Supervisor**; ou - **Liquidante_Digitador_Confirmador**.

Tela de Filtro - Confirmação de Financeiro

Confirmação de Financeiro	
Bco.Liquid. (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Banco Liquidante (Razão Social):	<input type="text"/>
Participante (Nome Simplificado):	<input type="text"/>
Participante (Razão Social):	<input type="text"/>
Modalidade de Liquidação	<input type="text" value="v"/>
<input type="button" value="Pesquisar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/>

Para personalizar a consulta, o aplicativo exibe Tela de Filtro, onde o usuário deve informar os valores dos campos desejados e clicar no botão **Pesquisar**, em seguida, o sistema apresenta tela para Confirmação ou Rejeição de financeiros.

Descrição dos campos da Tela de Filtro - Confirmação de Financeiro

Campo	Descrição
Bco.Liquid. (Nome Simplificado)	Nome Simplificado do banco responsável pela liquidação financeira.
Banco Liquidante (Razão Social)	Razão Social do banco responsável pela liquidação financeira.
Participante (Nome Simplificado)	Nome simplificado do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Participante (Razão Social)	Razão Social do Participante detentor de conta individualizada na Cetip, ao qual a posição financeira está relacionada.
Modalidade de Liquidação	Modalidade de liquidação financeira, aceita pela Cetip, no qual a operação financeira será liquidada: STR, Bruta BT ou Bruta Aut. Tipos de operações para modalidades.

7 GRADE HORÁRIO

7.1 Horários da Janela de Liquidação

Menu Posição Financeira > Grade de Horário > Horários da Janela de Liquidação

Visão Geral

Período de tempo compreendido entre o horário fixado para o início das operações até a finalização no STR.

Observação: Os horários vigentes para grades de registro de operações e sua respectiva liquidação financeira, em cada modalidade podem ser consultadas na página principal do site da Cetip (www.cetip.com.br).

Tela de Consulta de Grade de Horários

Consulta de Grade de Horários

Código da Grade:

Câmara (Nome Simplificado):

Modalidade de Liquidação

Tipo da Grade

Data Referência: / /

Nesta tela filtro o Participante deve preencher pelo menos um campo e clicar no botão **Pesquisar**, em seguida o sistema exibe tela de relação com dados relativos a Grade de Horários.

Caso somente os filtros de Câmara e data estejam preenchidos, com **Cetip** e data atual, respectivamente, são apresentadas todas as grades CTP, permanentes ou eventuais.

Descrição dos campos da Tela de Consulta de Grade de Horários

Campo	Descrição
Código da Grade	Caixa de seleção contendo as grades exclusivas da Cetip, bem como aquelas divulgadas pelo BACEN. Código que indica a grade e a câmara a qual se refere: CTP, Câmara Cetip, SEL, Câmara SELIC, STN, Secretaria do Tesouro Nacional, etc.
Câmara (Nome Simplificado)	Cetip ou BACEN - Nome Simplificado da Câmara. Estará preenchido com Cetip, passível de edição.
Modalidade de Liquidação	Bilateral STR, Bruta STR, Cetip e SEM modalidade de Liquidação. Modalidade de Liquidação financeira das operações nos sistemas de registro da Cetip.
Tipo de Grade	Eventual ou Permanente. A grade eventual apresenta os horários válidos apenas para o dia atual. A grade permanente, os válidos diariamente, até que sofram alguma alteração.
Data Referência	Campo de preenchimento obrigatório. Preenchido com a data atual. É possível a consulta a datas anteriores e posteriores a data atual. A consulta disponibiliza dados a partir de 21/4/2002, inclusive, véspera da implantação do SPB.

Tela de Relação

Consulta de Grade de Horários

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 39 de 39)

Data e Hora da Consulta: 19/09/2014 - 17:40:27

Descrição da Grade	Hora de Início	Hora de Término	Código da Grade	Tipo Grade	Modalidade de Liquidação
Grade de Funcionamento Alocação	08:00	18:00	ALOC01	Permanente	---
Funcionamento Geral CCP	07:45	18:30	CCP08	Permanente	"
Horário para Transf Arquivos (manhã)	08:00	10:35	CCP17	Permanente	"
Horário para Transf Arquivos (tarde)	13:00	16:45	CCP18	Permanente	"

Obter no formato: ▼

(continua)

Nome Simpl.Câmara	CNPJ da Câmara	Data de Início	Data de Término	Término D+1
CETIP	---	27/12/2013		---
"	"	07/06/2014		---
"	"	19/03/2014		---
"	"	08/07/2014	02/10/2014	---

(fim)

Observação: Os **Códigos da Grade** podem ser visualizados em Descrição de Códigos.

8 INFORMAÇÕES ADICIONAIS

8.1 Banco Liquidante

Os Participantes podem indicar mais de um Banco Liquidante para efetuar a sua liquidação financeira, através da Ficha de Cadastro, devendo ser previamente indicado qual vai atuar como seu Banco Liquidante principal, para o qual são automaticamente direcionadas as liquidações financeiras dos resgates e eventos dos ativos em posição do Participante.

A inclusão de um novo Banco Liquidante se dá através de prévia aceitação das partes. A renúncia pode ser unilateral, sendo a outra parte comunicada do fato pela Cetip. Novas inclusões podem ocorrer a qualquer momento do dia, porém a substituição ou retirada apenas pode ser comandada após o fechamento do sistema. As inclusões e retiradas devem ser solicitadas através de carta.

8.2 Códigos de Grade

Código	Descrição	Função
CTP01	Funcionamento Geral	Essa grade indica o horário de funcionamento geral da Cetip.
CTP02	Registro de Operações – Bruta STR	Esta grade define os horários de início e fim de registro de operações da modalidade Bruta.
CTP03	Registro de Operações – Cetip	Esta grade define os horários de início e fim de registro de operações da modalidade Cetip.
CTP04	Confirmação Financ. pelo Bco Liquidante – Janela Cetip	Essa grade define os horários de início (com o envio pela Cetip da LDL0001) e término do ciclo de confirmação do financeiro, pelos Bancos Liquidantes devedores, na janela de liquidação multilateral Cetip.
CTP07	Transf. saldo devedor p/ Cetip – Janela Cetip	Essa grade define os horários de início e término do ciclo de pagamento, por parte dos Bancos Liquidantes devedores, na janela de liquidação multilateral Cetip.
CTP08	Transf. saldo credor p/ Banco Liquidante – Janela Cetip	Essa grade define os horários de início e término do ciclo de crédito por parte da Cetip em favor dos Bancos Liquidantes credores na janela de liquidação multilateral Cetip.
CTP10	Transf. saldo devedor p/ Cetip – BRUTA STR	Essa grade define os horários de início e término para liquidação financeira das operações da modalidade bruta STR.
CTP11	Registro de Operações - Sem liquidação no STR	Esta grade define os horários de início e fim de registro de operações sem liquidação financeira no STR.

Código	Descrição	Função
CTP12	Registro de Operações – Bilateral	Essa grade define o período em que deve ocorrer o registro de Preço Unitário de contratos de Swap ou Termo de Moedas que utilizam o índice VCP – Valor Calculado entre as Partes , bem como a informação do exercício da opção de arrependimento, para que os resgates ocorram na modalidade de liquidação financeira Bilateral.
CTP13	Transf. saldo devedor p/Cetip - BILATERAL	Essa grade define os horários de início e término para liquidação financeira das operações da modalidade BILATERAL.
CTP17	Horário p/ transf. arquivos (manhã)	Esta grade define os horários de início e fim de registro de operações via transferência de arquivos, na parte da manhã, pelo Participante.
CTP18	Horário p/ transf. arquivos (tarde)	Esta grade define os horários de início e fim de registro de operações via transferência de arquivos, na parte da tarde, pelo Participante.
CTP19	Envio mensagem abertura/financeiro prévio e mensagem de fechamento	Esta grade define o horário de abertura e fechamento de registro de operações na Cetip (envio das mensagens LDL0028 e LDL0029 respectivamente), e o horário de geração da mensagem LDL0001, informando aos Bancos Liquidantes devedores os financeiros prévios para a Janela de Liquidação Multilateral da Cetip.
CTP20	Relatório financeiro prévio/definitivo	Esta grade define o horário de início da geração do relatório de financeiro prévio e o horário final da geração do relatório de financeiro definitivo.
CPT22	Horário para transferência de arquivos (noite)	Esta grade define os horários de início e fim de transferência de arquivos noturna (sem liquidação no STR) pelo Participante.
CPT23	Confirmação do financeiro sem liquidação no STR	Esta grade define os horários de início e término do ciclo de pagamento, por parte dos Bancos Liquidantes devedores, na janela de liquidação sem liquidação no STR (Sem modalidade e bruta book transfer).
CPT24	Liberção eventos liquidados em D0 Flut. em SELIC/DI	Esta grade define os horários de início e término para o lançamento do Preço Unitário (PU) de eventos para debêntures flutuantes em DI ou em SELIC com liquidação em D0.
CPT25	Horário p/ registro p/ mensagem (manhã)	Esta grade define os horários de início e fim de registro, de operações e consultas por mensagens na parte da manhã, pelo Participante.
CPT26	Horário p/ registro p/ mensagem (tarde)	Esta grade define os horários de início e fim de registro, de operações e consultas por mensagens na parte da tarde, pelo Participante.

Código	Descrição	Função
CPT27	Horário p/ registro p/ mensagem (noite)	Esta grade define os horários de início e fim de registro, de operações e consultas por mensagens na parte da noite, pelo Participante.
CTP28	Manut. Controle Acesso/Adm.Partic	Define o período em que podem ser efetuados lançamentos de serviços disponíveis nos produtos Controle de Acesso e Administração de Participantes.
CTP29	Horário para Registro por mensagem (Madrugada)	Informa o horário em que a Cetip acata o recebimento de arquivos enviados através da GEN0015.
CTP31	Inclusão e Manutenção do Cadastro de Comitentes (Arquivo SIC00) e Identificação de Operações ou Ajuste de Posição de Custódia (Arquivo SIC01)	Define o período em que podem ser efetuados lançamentos de no SIC - Módulo de Identificação de Comitentes de Inclusão e Manutenção do Cadastro de Comitentes e Identificação de Operações ou Ajuste de Posição de Custódia.
CTP34	Registro de Operações - Bruta STR	Grade exclusiva para liquidação automática de gravames. A liquidação tem o mesmo horário da grade "CTP02", com o término uma hora antes desta mesma grade (16h45min).
CTP35	Transf. saldo devedor p/ Cetip - BRUTA STR	Grade exclusiva para liquidação automática de gravames. A liquidação tem o mesmo horário da grade "CTP02", com término uma hora antes desta mesma grade (16h45min).

8.3 Tipos de Operação por Modalidade

▪ Tipos de Operação para a Modalidade Bilateral

Modalidade desenvolvida par a liquidação financeira dos Rebates de Prêmios Pagos e de Resgates dos Contratos de Swap e de Termo de Moedas, permitindo a Compensação Bilateral dos valores financeiros das operações nas quais estejam envolvidos dois Participantes.

▪ Tipos de Operação - Modalidade Bruta

Nesta modalidade de liquidação podem ser cursadas todas as operações passíveis de registro na Cetip. Incluem-se nesta modalidade a liquidação dos prêmios, das antecipações, das intermediações dos contratos de Swap e de Termo de Moeda.

Também são liquidadas por essa modalidade as operações de baixa de gravame sinistro e baixa de gravame carta de crédito.

Os custos Cetip são liquidados através desta modalidade.

Exceção: As operações de Risco de Emissor com retorno automático (os resgates de títulos e valores mobiliários, os pagamentos de eventos previstos na emissão do ativo e as retrocessões de crédito) que são liquidadas pela Modalidade Cetip.

▪ Tipos de Operação - Modalidade Cetip

Nesta modalidade de liquidação podem ser cursadas as operações de Risco de Emissor e também a Retenção de Imposto de Renda.

8.4 Status da Liquidação

Descrição do status da Liquidação

Ativa - A ser utilizada apenas na Multilateral. Status a ser assumido em todas as posições financeiras no período entre 9h00 e 12h00, significando que a Janela encontra-se com valores prévios e que podem ser alterados.

Estornada - A ser utilizada apenas na BRUTA. Status a ser assumido quando, antes da liquidação financeira pelo Banco Liquidante, ocorrer o estorno da operação pelas partes ou unilateral pelo prejudicado.

Fechada - A ser utilizada na BRUTA ou na MULTILATERAL. Status a ser assumido quando, a posição financeira é criada (bruta) ou considerada definitiva (multilateral), porém ainda não foi gerada a mensagem de liquidação (LDL ou LTR).

Inadimplente - A ser utilizada apenas na Multilateral. Status intermediário a ser assumido na posição financeira do Banco Liquidante considerado inadimplente quando do início da rotina de REPROCESSAMENTO da Janela. Assim que gerado os novos valores, tal posição é excluída. Está em fase de desenvolvimento e pode sofrer mudanças.

Liquidada - Na BRUTA, este status é assumido para cada posição financeira dos Bancos (tanto para o devedor como para o credor), quando, após o repasse pela Cetip ao Banco Liquidante Credor através da LTR0005 via STR, a Cetip receber do STR a mensagem LTR0005R1, confirmando a transferência do recurso.

Na MULTILATERAL, este é assumido para todas as posições financeiras dos Bancos em único momento, quando a Cetip recebe do STR a última mensagem LDL0005R1 confirmando as transferências dos recursos. Neste status está considerada encerrada a Janela Cetip.

Não confirmada - A ser utilizada apenas na BRUTA. Status a ser assumido quando, no final do dia, o Banco Liquidante se omitiu na confirmação de uma determinada posição financeira e não efetuou a transferência financeira no STR.

Não Liquidada - A ser utilizada apenas na BRUTA. Status a ser assumido quando, no final do dia, o Banco Liquidante confirmou o financeiro, porém não efetuou a transferência financeira no STR.

Pendente de Confirmação - A ser utilizada na BRUTA ou na MULTILATERAL. Status a ser assumido após o envio das Mensagens LTR0001 e LDL001 definitiva, e enquanto não confirmada ou rejeitada pelo Banco ou não efetuada a transferência financeira no STR.

Pendente de Liquidação - A ser utilizada na BRUTA ou na MULTILATERAL. Status a ser assumido após a confirmação pelo Banco e enquanto ainda não efetuada a transferência financeira no STR.

Descrição do status da Liquidação

Rejeitada - A ser utilizada na BRUTA ou na MULTILATERAL. Status a ser assumido após Banco Liquidante rejeitar determinado valor a ser liquidado.

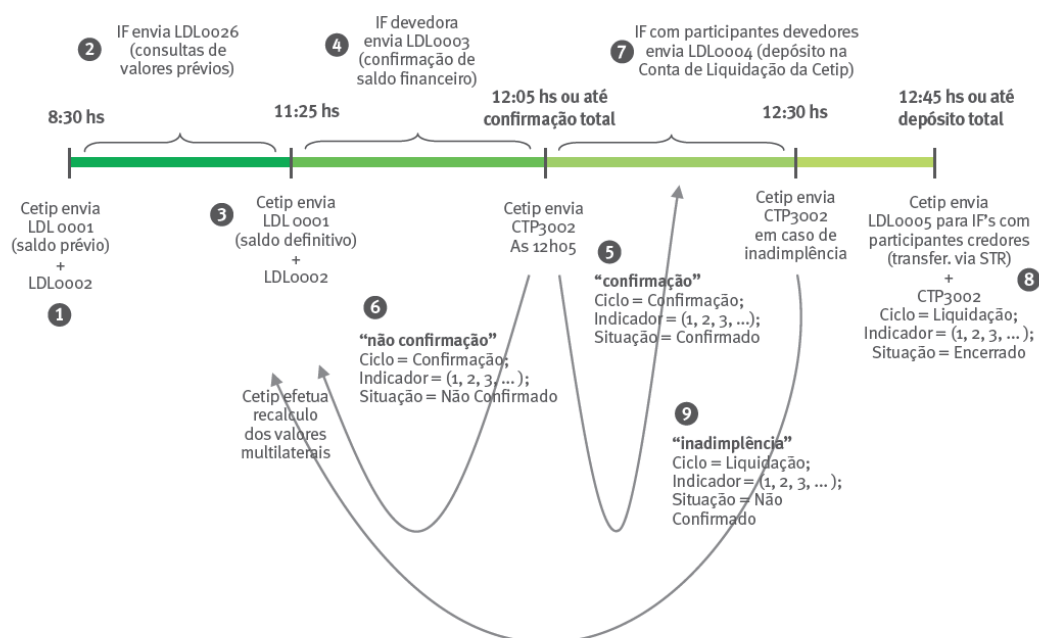
Transferência efetuada – Na BRUTA, este status é assumido para cada posição financeira dos Bancos (tanto para o devedor como para o credor) após a Cetip receber a LTR0004R2 (via STR) que o devedor efetuou a transferência para a conta de liquidação da Cetip. Neste momento, a Cetip inicia a transferência financeira para o BL credor através da LTR0005.

Na MULTILATERAL, este status é utilizado na posição financeira da instituição devedora assim que a Cetip receber a mensagem LDL0004R2 (via STR) de depósito na conta de liquidação da Cetip e na posição financeira da instituição credora assim que a Cetip receber a mensagem LDL0004R1 (via STR) de confirmação do Banco Central que o depósito solicitado pela Cetip já foi feito.

Transferência efetuada a menor – De uso exclusivo da CENTRAL, porém, conforme solicitado pelo BACEN, provavelmente passaremos a utilizar, pois devermos receber valores parciais até o final da liquidação (Desativado).

9 FLUXO E DETALHAMENTO DAS MENSAGENS PARA LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA

9.1 Fluxo de Mensagens - Janela Multilateral Cetip



Processo 1

Na abertura dos sistemas (8h30), a Cetip enviará aos Bancos liquidantes devedores as mensagens LDL0001 contendo a lista dos participantes não liquidantes devedores, seus respectivos valores individuais e o valor total a débito. Estas mensagens contêm as informações 'Prévias' de Liquidação para a Janela Multilateral CETIP. Será também enviada ao Banco Central a mensagem LDL0002.

Não serão enviadas as mensagens LDL0001 aos Bancos liquidantes credores. Apenas serão disponibilizados em tela no sistema da Cetip.

É importante esclarecer que os valores referentes às contas de cliente 1 ou 2 serão consolidados no CNPJ da instituição financeira detentora destas contas.

A partir deste horário a Cetip estará aceitando depósitos, pelos Bancos liquidantes através da LDL0004. Estas mensagens apenas serão tratadas no início do ciclo de confirmação (11h25).

Processo 2

Até o horário limite (11h20) para o registro de operações para esta Janela Multilateral Cetip, as instituições financeiras poderão consultar a evolução de seus valores financeiros através da mensagem LDL0026.

Processo 3

Ao iniciar a janela de liquidação (11h25), a Cetip enviará aos Bancos liquidantes devedores a lista dos participantes não liquidantes devedores, seus respectivos valores individuais e o valor total a débito. Esta mensagem contém informações 'Definitivas' de Liquidação da Janela Multilateral Cetip. Além destas, a Cetip enviará nova mensagem LDL0002 ao Banco Central.

Neste momento serão tratados os depósitos efetuados antecipadamente pelos Bancos liquidantes na conta de liquidação da Cetip: (i) se o valor depositado for menor que o devido, será imediatamente devolvido através da LDL0006; (ii) se o valor depositado for maior que o devido, a diferença será devolvida no início do ciclo de pagamento (12h05).

Processo 4

A partir do recebimento das mensagens LDL0001 'definitivas' e até as 12h05, os Bancos liquidantes deverão confirmar ou rejeitar os saldos financeiros dos seus não liquidantes devedores através da mensagem LDL0003. Esta função também está disponível em tela específica no Sistema NoMe da Cetip. A Cetip devolverá com erro mensagens de confirmação fora do período acima estipulado.

Valem as seguintes regras para o processo de confirmação:

- a) Será considerada válida a mensagem LDL0003 quando as informações enviadas pelo Banco liquidante por não liquidante apresentarem:
 - (i) na confirmação, valor igual ao enviado originalmente pela Cetip e 'TpConf_Divg' = 'C'; e
 - (ii) na rejeição, valor igual a Zero e 'TpConf_Divg' = 'D'.
- b) Dentro do horário estipulado para confirmação, o Banco liquidante poderá efetuar correções, reenviando a LDL0003, valendo para todos os efeitos a última mensagem válida recebida pela Cetip.
- c) Durante o período de confirmação, a Cetip acatará depósitos na sua conta de liquidação: (i) se o valor depositado for menor que o devido, será imediatamente devolvido através da LDL0006; (ii) se o valor depositado for maior que o devido, a diferença será devolvida no início do ciclo de pagamento (12h06).

Processo 5

No caso da confirmação plena dos saldos financeiros dos não liquidantes devedores por parte de todos os Bancos liquidantes, às 12h05, a Cetip enviará a mensagem CTP3002 avisando às instituições do término da confirmação. Esta mensagem conterá as seguintes informações: tipo de ciclo 'Confirmação', indicador de ciclo e Situação 'Confirmado'.

Processo 6

A rejeição de posição financeira devedora por parte de algum Banco liquidante caracteriza a inadimplência regulamentar do não liquidante, sendo as suas operações suspensas e redirecionadas para a modalidade LBTR.

Após o qual será enviada a mensagem CTP3002 ao mercado alertando esta ocorrência, contendo as seguintes informações: tipo de ciclo 'Confirmação', indicador de ciclo e Situação 'Não Confirmado'.

Na hipótese de omissão por parte do Banco liquidante, da confirmação ou rejeição das posições financeiras devedoras, este será considerado inadimplente regulamentar, bem como os participantes para os quais ele liquide. As operações do próprio Banco, bem como dos seus não liquidantes serão suspensas e redirecionadas para a modalidade LBTR.

Após o qual a Cetip enviará a mensagem CTP3002, contendo as seguintes informações: tipo de ciclo 'Confirmação', indicador de ciclo e Situação 'Não Confirmado'

A Cetip, após a suspensão das operações dos participantes inadimplentes regulamentares, comandará o recálculo dos valores da Janela Multilateral, após o qual, os Bancos liquidantes afetados receberão novas mensagens conforme descrito no **Processo 3**.

A mensagem LDL0002 será reenviada ao Banco Central com a nova posição financeira. Na seqüência, somente os Bancos liquidantes devedores afetados devem proceder com as confirmações definidas no Processo 4.

Até que a Cetip obtenha a confirmação por parte de todos os Bancos liquidantes afetados, o Processo 6 se repetirá quantas vezes forem necessárias, sendo os novos horários comunicados ao mercado através da mensagem LDL0024.

Processo 7

Após o envio pela Cetip da mensagem CTP3002 informando que o ciclo de confirmação está OK (após a confirmação por parte de todos os Bancos liquidantes devedores) e até 12h30, estes deverão obrigatoriamente efetuar a transferência, via STR, do montante devido para a conta de liquidação da Cetip, utilizando-se da mensagem LDL0004.

Valem as seguintes regras para o processo de liquidação:

- a) A Cetip não aceitará valores inferiores ao montante devido, sendo este imediatamente devolvido à instituição depositária através da mensagem LDL0006;
- b) Se o valor for enviado a maior do que o devido, a Cetip acatará a transferência e devolverá imediatamente a diferença através da mensagem LDL0006;
- c) Para os pagamentos acatados, a Cetip não leva em consideração as informações analíticas enviadas pelo Banco liquidante nas tags contidas na repetição da mensagem LDL0004.

Processo 8

Às 12h45, a Cetip iniciará o processo de transferência, via STR, dos valores financeiros devidos aos Bancos liquidantes credores, através da mensagem LDL0005.

No recebimento de todas as mensagens LDL0005R1 do STR, confirmando a efetivação da transferência, a Cetip efetuará a transferência dos ativos para os participantes compradores e enviará a mensagem CTP3002, avisando aos Bancos do término da janela de liquidação da Cetip na data. Esta mensagem conterá as seguintes informações: tipo de ciclo 'Liquidação', indicador de ciclo e Situação 'Encerrado'.

Processo 9

Na hipótese de algum Banco liquidante devedor não efetuar o depósito na conta de liquidação da Cetip até 12h30, este será considerado inadimplente regulamentar, bem como os participantes para os quais ele liquide. As operações do próprio Banco, bem como dos seus não liquidantes serão suspensas devendo ser redirecionadas para a modalidade LBTR.. Após o qual a Cetip enviará a mensagem CTP3002, contendo as seguintes informações: tipo de ciclo 'Confirmação', indicador de ciclo e Situação 'Não Confirmado'

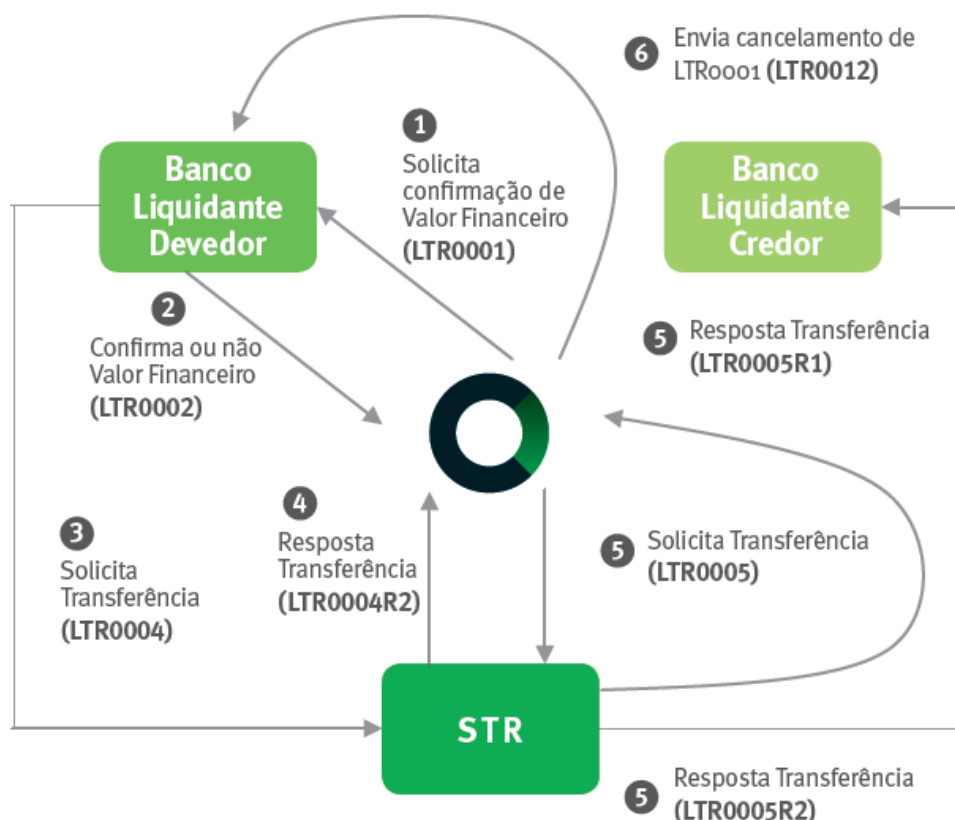
A Cetip, após a suspensão das operações, comandará o recálculo dos valores da Janela Multilateral, e enviará novas mensagens conforme descrito no **Processo 3**. A mensagem LDL0002 será reenviada ao Banco Central com a nova posição financeira. Na seqüência, os Bancos liquidantes devedores afetados devem proceder as confirmações definidas no **Processo 4**, e os depósitos devidos descritos no **Processo 7**.

Os Bancos liquidantes devedores que sofrerem alterações nos resultados financeiros de seus não liquidantes por conta deste reprocessamento, receberão, através da mensagem LDL0006, a devolução do valor anteriormente depositado na Cetip, concomitantemente ao recebimento das novas mensagens LDL0001.

Até que a Cetip obtenha o depósito por parte de todos os Bancos liquidantes devedores, o Processo 9 se repetirá tantas vezes quantas forem necessárias, sendo os novos horários comunicados ao mercado através de mensagem LDL0024.

9.2 Fluxo de Mensagens - Modalidade Bruta ou Bilateral no STR

(através da Conta de Liquidação da Cetip)



Processo 1

Para a modalidade BRUTA: A Cetip, imediatamente após a aprovação dos lançamentos das partes e respectivo bloqueio do ativo, quando aplicável, na posição do vendedor, enviará a mensagem LTR0001 ao Banco liquidante do participante devedor.

Para a modalidade Bilateral: Às 11h05, após o encerramento do horário para as partes atualizarem os contratos pendentes de PU, a Cetip enviará aos Bancos liquidantes dos participantes devedores as mensagens LTR0001 com os respectivos resultados bilaterais dos seus não liquidantes, provenientes dos resgates e rebates de Swap ou Termo de Moeda.

Processo 2

O Banco liquidante do participante devedor, caso não concorde em efetuar a transferência, deverá obrigatoriamente enviar a mensagem LTR0002 rejeitando o valor. O horário limite para tal na modalidade Bruta é 17h45, e na modalidade Bilateral é 13h55.

Processo 3

Na hipótese de concordância do pagamento pelo Banco liquidante devedor, este deverá efetuar a transferência financeira para a Conta de Liquidação da Cetip no STR através da mensagem LTR0004. Neste caso, não é obrigatório o envio da mensagem LTR0002 confirmando previamente o valor, pois quando da efetivação do depósito, está implícita a sua confirmação. O horário limite para tal na modalidade Bruta é 17h45 e na modalidade Bilateral é 13h55.

Não é permitido o depósito a menor do valor devido, sendo que a Cetip efetuará, imediatamente, ao seu recebimento, a devolução através da mensagem LTR0006.

Processo 4

Quando do recebimento da mensagem LTR0004R2, confirmando o depósito por parte do Banco liquidante do participante devedor, a Cetip fará a liberação da custódia, quando aplicável, para o participante comprador.

Processo 5

Imediatamente após o recebimento da LTR0004R2, a Cetip enviará ao STR a mensagem LTR0005, creditando o valor devido ao Banco liquidante do participante credor.

Processo 6

Se por alguma razão, a operação que originou o envio da mensagem LTR0001 tenha sido cancelada antes do recebimento pela Cetip da efetivação transferência de recurso no STR (LTR0004R2), esta câmara enviará ao Banco liquidante devedor a mensagem LTR0012, cancelando esta ordem.

9.3 Fluxo de Mensagens - Modalidade Bruta ou Bilateral no STR (uso da LTR0003)

(através de pagamento direto pelo devedor ao Credor)



Processo 1

Para a modalidade Bruta: A Cetip, imediatamente após a aprovação dos lançamentos das partes e respectivo bloqueio do ativo, quando aplicável, na posição do vendedor, enviará a mensagem LTR0001 ao Banco liquidante do participante devedor.

Para a modalidade Bilateral: Às 11h05, após o encerramento do horário para as partes atualizarem os contratos pendentes de PU, a Cetip enviará aos Bancos liquidantes dos participantes devedores as mensagens LTR0001 com os respectivos resultados bilaterais dos seus não liquidantes, provenientes dos resgates e rebates de Swap ou Termo de Moeda.

Processo 2

O Banco liquidante do participante devedor, caso não concorde em efetuar a transferência, deverá obrigatoriamente enviar a mensagem LTR0002 rejeitando o valor. O horário limite para tal na modalidade Bruta é 17h45, e na modalidade Bilateral é 13h55.

Processo 3

Na hipótese de concordância do pagamento pelo Banco liquidante devedor, este deverá efetuar a transferência financeira para a Conta de Liquidação da Cetip no STR através da mensagem LTR0003. Neste caso, não é obrigatório o envio da mensagem LTR0002 confirmando previamente o valor, pois quando da efetivação do depósito, está implícita a sua confirmação. O horário limite para tal na modalidade Bruta é 17h45 e na modalidade Bilateral é 13h55.

Processo 4

Quando do recebimento da mensagem LTR0003R3, confirmando o depósito por parte do Banco liquidante do participante devedor, a Cetip fará a liberação da custódia, quando aplicável, para o participante comprador.

Este processo somente será executado caso os seguintes campos da LTR0003R3 recebida pela Cetip estejam com o conteúdo rigorosamente idêntico aos enviados na LTR0001:

- ISPBIFCredtd
- NumCtrlLTROr
- VlrLanc

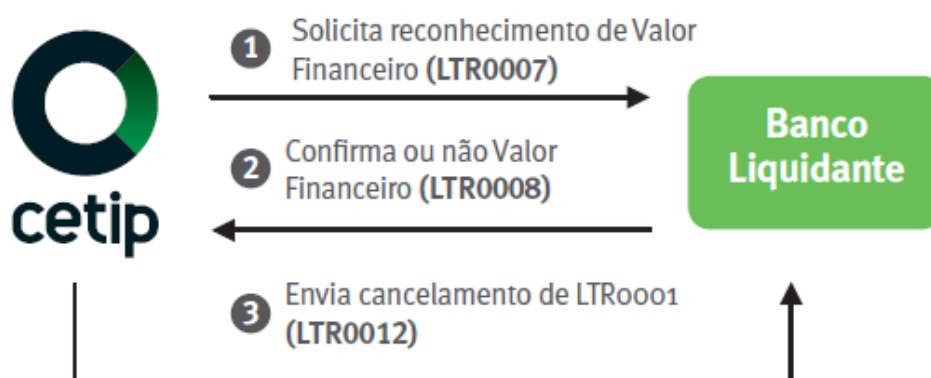
Processo 5

Imediatamente após o recebimento da LTR0003R3 e nas condições descritas no processo 4, a Cetip enviará ao Banco liquidante do participante credor a mensagem CTP3003, informando os dados complementares da operação que originou a transferência.

Processo 6

Se por alguma razão, a operação que originou o envio da mensagem LTR0001 tenha sido cancelada antes do recebimento pela Cetip da efetivação transferência de recurso no STR (LTR0003R3), esta câmara enviará ao Banco liquidante devedor a mensagem LTR0012, cancelando esta ordem.

9.4 Fluxo de Mensagens - Bruta no Banco Liquidante (*Book-Transfer*)



Processo 1

Para a modalidade BRUTA: a Cetip, imediatamente após a aprovação dos lançamentos das partes e respectivo bloqueio do ativo, quando aplicável, na posição do vendedor, enviará a mensagem LTR0007 ao Banco liquidante com informações referentes ao montante a ser transferido do não liquidante devedor para o não liquidante credor no próprio ambiente do Banco.

Para a modalidade Bilateral: Às 11h05, após o encerramento do horário para as partes atualizarem os contratos pendentes de PU, a Cetip enviará aos Bancos liquidantes as mensagens LTR0007 com os respectivos resultados bilaterais dos seus não liquidantes provenientes dos resgates e rebates de Swap ou Termo de Moeda.

Processo 2

Para os casos de “Book-Transfer” com confirmação automática pelo sistema da Cetip, não se faz necessário a confirmação ou recusa através da mensagem LTR0008 pelo Banco liquidante. A mensagem LTR0007 será apenas informativa e tal indicação encontra-se na tag “IndrConfc” (Indicador Confirmação) com valor = “N”.

Quando do recebimento da LTR0007 e a tag “IndrConfc” for igual a “S”, o Banco liquidante deverá obrigatoriamente enviar a mensagem LTR0008 confirmando ou rejeitando o valor do participante devedor.

Processo 3

Se por alguma razão, a operação que originou a mensagem LTR0007 tenha sido cancelada antes da confirmação pelo Banco liquidante, a Cetip enviará a mensagem LTR0012 de cancelamento da ordem original.

9.5 Estruturação das Tags “Histórico” e “Número Operação LTR”

(para as mensagens LTR0001, LTR0005R2 e LTR0007)

Liquidação pelo BRUTO de operações lançadas em todos os SISTEMAS exceto TERMO:

- a) LTR0001:
 - na tag "Histórico" = EM BRANCO
 - na tag "Número Operação LTR" = "IdentdSistCETIP"#"Num Comando do devedor na operação imputada no sistema";
- b) LTR0005R2 ou CTP3003:
 - na tag "Histórico" = EM BRANCO;
 - na tag "Número Operação LTR" = "IdentdSistCETIP"#"Num Comando do credor na operação imputada no sistema";
- c) LTR0007
 - na tag "Histórico" = EM BRANCO;
 - na tag "Número Operação LTR Debitado" = EM BRANCO;
 - na tag "Número Operação LTR Creditado" = EM BRANCO;

na tag "Número Operação LTR " = "IdentdSistCETIP"#"Num Comando da operação imputada no sistema";

Liquidação pelo BRUTO de operações lançadas no sistema TERMO:

a) LTR0001:

na tag "Histórico" = "IdentdSistCETIP"#"Número do Contrato";

na tag "Número Operação LTR" = "IdentdSistCETIP"#"Num Comando do devedor na operação imputada no sistema";

b) LTR0005R2 ou CTP3003:

na tag "Histórico" = "IdentdSistCETIP"#"Número do Contrato";

na tag "Número Operação LTR" = "IdentdSistCETIP"#"Num Comando do credor na operação imputada no sistema";

c) LTR0007:

na tag "Histórico" = "IdentdSistCETIP"#"Número do Contrato";

na tag "Número Operação LTR Debitado" = "IdentdSistCETIP"#"Num Comando do devedor na operação imputada no sistema";

na tag "Número Operação LTR Creditado" = "IdentdSistCETIP"#"Num Comando do credor na operação imputada no sistema";

na tag "Número Operação LTR" = EM BRANCO;

9.6 Liquidação Bilateral para Swap ou Termo de Moeda

Será gerado um arquivo a ser disponibilizado a todos os Bancos liquidantes às 11h00 (horário de início das mensagens Bilaterais) para auxiliar na reconciliação das mensagens de liquidação e as respectivas operações que compõem o saldo bilateral. Este conterá as seguintes informações:

- Número Seqüencial da mensagem de liquidação
- Tipo da operação (resgate ou rebate de swap ou termo de moeda)
- Número do contrato
- resultado (a crédito ou a débito) do contrato.

Neste arquivo apenas serão disponibilizados os contratos cujo Banco liquidante pode ter visibilidade, isto é, para aqueles não liquidantes que ele preste também o serviço de digitação.

Estarão "netados" os valores de termo de moeda e swap.

a) LTR0001:

na tag "Histórico" = "BILAT"#"Número Seqüencial disponibilizado no arquivo";

na tag "Número Operação LTR" = EM BRANCO.

b) LTR0005R2 ou CTP3003:

na tag "Histórico" = "BILAT"#"Número Seqüencial disponibilizado no arquivo";

na tag "Número Operação LTR" = EM BRANCO.

c) LTR0007

na tag "Histórico" = "BILAT"#"Número Seqüencial disponibilizado no arquivo";

na tag "Número Operação LTR Debitado" = EM BRANCO;

na tag "Número Operação LTR Creditado" = EM BRANCO.

10 GLOSSÁRIO

C

Conta de Liquidação da Cetip: A conta mantida pela Cetip no Banco Central, para efeito de prestação de serviço auxiliar ao processo de Liquidação Financeira efetuado entre os Participantes.

I

Inadimplência Financeira: O não pagamento de obrigação pecuniária assumida por um Participante.

J

Janela Multilateral Cetip: Período de tempo alocado à Liquidação Diferida pelo Líquido (liquidação de obrigações em determinado momento posterior ao da Aprovação das correspondentes operações), de obrigações objeto de Compensação Multilateral, operacionalizada pela Cetip.

L

Liquidação Bilateral: Compensação bilateral entre Participantes.

Liquidação Bruta: Modalidade em que as obrigações são remetidas para liquidação "uma a uma", no momento de sua Aprovação.

R

Rejeição: Anulação automática de operação ainda não validada no processo de Aprovação.

S

Sistema de Compensação e Liquidação: O conjunto de Módulos, integrantes de sistema administrado e operacionalizado pela Cetip, destinados à prestação dos serviços de compensação e liquidação.