

**MANUAL DE NORMAS  
REGISTRO DE INFORMAÇÕES E  
CONDIÇÕES DE INSTRUMENTO  
FINANCEIRO DERIVATIVO  
VINCULADO AO CUSTO DA DÍVIDA  
ORIGINALMENTE CONTRATADA EM  
EMPRÉSTIMO ENTRE RESIDENTE OU  
DOMICILIADO NO PAÍS E RESIDENTE  
OU DOMICILIADO NO EXTERIOR**



VERSÃO: 25/01/2010

**MANUAL DE NORMAS  
REGISTRO DE INFORMAÇÕES E CONDIÇÕES DE INSTRUMENTO  
FINANCEIRO DERIVATIVO VINCULADO AO CUSTO DA DÍVIDA  
ORIGINALMENTE CONTRATADA EM EMPRÉSTIMO ENTRE RESIDENTE OU  
DOMICILIADO NO PAÍS E RESIDENTE OU DOMICILIADO NO EXTERIOR**

**ÍNDICE**

<b>CAPÍTULO PRIMEIRO – DO OBJETIVO</b>	<b>3</b>
<b>CAPÍTULO SEGUNDO – DAS DEFINIÇÕES</b>	<b>3</b>
<b>CAPÍTULO TERCEIRO – DO REGISTRO DAS INFORMAÇÕES E DAS CONDIÇÕES RELATIVAS A INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO</b>	<b>4</b>
<b>CAPÍTULO QUARTO – DO AGENTE REGISTRADOR</b>	<b>5</b>
<b>CAPÍTULO QUINTO – DA BAIXA DO REGISTRO DAS INFORMAÇÕES E DAS CONDIÇÕES RELATIVAS A INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO</b>	<b>6</b>
<b>CAPÍTULO SEXTO – DO PROCEDIMENTO PARA REGISTRO, PARA ATUALIZAÇÃO E PARA A BAIXA DE INFORMAÇÕES E DE CONDIÇÕES RELATIVAS A INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO</b>	<b>6</b>
<b>CAPÍTULO SÉTIMO – DOS PROCEDIMENTOS VEDADOS AO PARTICIPANTE</b>	<b>7</b>
<b>CAPÍTULO OITAVO – DAS DISPOSIÇÕES GERAIS</b>	<b>7</b>

**MANUAL DE NORMAS  
REGISTRO DE INFORMAÇÕES E CONDIÇÕES DE INSTRUMENTO  
FINANCEIRO DERIVATIVO VINCULADO AO CUSTO DA DÍVIDA  
ORIGINALMENTE CONTRATADA EM EMPRÉSTIMO ENTRE RESIDENTE OU  
DOMICILIADO NO PAÍS E RESIDENTE OU DOMICILIADO NO EXTERIOR**

**CAPÍTULO PRIMEIRO – DO OBJETIVO**

**Artigo 1º**

O presente Manual de Normas é instituído pela **CETIP S.A. – Balcão Organizado de Ativos e Derivativos (“CETIP”)** e tem por objetivo definir as regras que disciplinam o registro, a atualização e a baixa das informações e condições relativas a Instrumento Financeiro Derivativo, definido no inciso V do Artigo 2º deste Manual de Normas, no correspondente MÓDULO.

**CAPÍTULO SEGUNDO – DAS DEFINIÇÕES**

**Artigo 2º**

Para os efeitos deste Manual de Normas entende-se por, na sua forma singular ou plural:

- I - Agente Registrador – a Instituição Financeira responsável pela exatidão das informações e das condições, constantes do MÓDULO, pertinentes a Instrumento Financeiro Derivativo.
- II - Conta de Cliente – a Conta de Cliente 1 (um) ou a Conta de Cliente 2 (dois).
- III - Cliente – o Cliente 1 (um) ou o Cliente 2 (dois).
- IV - Instituição Financeira – o Participante que seja instituição financeira nacional.
- V - Instrumento Financeiro Derivativo – o instrumento financeiro derivativo, como opção, contrato a termo, contrato futuro e *swap*, independentemente do referencial, que se vincule ao custo da dívida originalmente contratada em empréstimo entre residente ou domiciliado no País e residente ou domiciliado no exterior, inclusive por pessoa natural ou jurídica não financeira, realizada nos

termos da Resolução nº 2.770, de 30 de agosto de 2000, do Conselho Monetário Nacional.

- VI - Módulo de Derivativos Realizados no Exterior (“MÓDULO”) – subdivisão do Sistema de Registro destinada ao registro e à manutenção das condições e informações relativas a instrumentos financeiros derivativos contratados no exterior.
- VII - Norma da CETIP – Manual de Normas, Manual de Operações, Código de Conduta, Comunicado ou Carta-Circular expedidos pelo Diretor Geral.
- VIII - Participante – o detentor de Direito(s) de Acesso.
- IX - Regulamento – o Regulamento da CETIP para Acesso de Participante, para Admissão de Ativo, para Negociação, para Registro de Operação, para Custódia Eletrônica e para Liquidação.
- X - Sistema de Custódia Eletrônica – o conjunto de Módulos, integrantes de sistema administrado e operacionalizado pela CETIP, destinados, dentre outros, à Custódia Eletrônica de Ativos e, quando for o caso, ao cálculo e processamento dos Eventos e das demais obrigações pecuniárias relativos aos Ativos em Custódia Eletrônica.

### **CAPÍTULO TERCEIRO – DO REGISTRO DAS INFORMAÇÕES E DAS CONDIÇÕES RELATIVAS A INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO**

#### **Artigo 3º**

A CETIP aceita o registro de informações e de condições de Instrumento Financeiro Derivativo em que a parte residente ou domiciliada no País seja:

- I - um Participante; ou
- II - um Cliente.

§1º – O Cliente referido no inciso II deste Artigo deve ter sido previamente cadastrado pelo Participante titular da Conta de Cliente em Módulo específico do Sistema de Custódia Eletrônica, na forma estabelecida em Norma da CETIP.

§2º – A parte residente ou domiciliada no País, de Instrumento Financeiro Derivativo vinculado ao custo de empréstimo não destinado a repasse, que não for Participante, deverá, obrigatoriamente, ser Cliente do correspondente Agente Registrador.

#### **Artigo 4º**

O registro de que trata o Artigo 3º deve conter:

- I - a(s) moeda(s) contratada(s);
- II - o(s) prazo(s) pactuado(s);
- III - a data de vencimento;
- IV - os dados identificadores da parte residente ou domiciliada no exterior;
- V - o(s) parâmetro(s) utilizado(s);
- VI - a forma de liquidação; e
- VII - as demais informações e condições previstas em Norma da CETIP.

### **CAPÍTULO QUARTO – DO AGENTE REGISTRADOR**

#### **Artigo 5º**

Atua(m) como Agente Registrador:

- I - a(s) parte(s) de Instrumento Financeiro Derivativo residente(s) ou domiciliada(s) no País; ou
- II - em não havendo parte de Instrumento Financeiro Derivativo residente ou domiciliada no País que seja Instituição Financeira, o Participante com essa natureza que for designado para tal.

#### **Artigo 6º**

O Agente Registrador deve efetuar a manutenção das informações e das condições relativas ao Instrumento Financeiro Derivativo, atualizando-as sempre que forem alteradas.

**Artigo 7º**

O cadastramento no MÓDULO de informação ou de condição incorreta pertinente a Instrumento Financeiro Derivativo, bem como a ausência da atualização referida no artigo 6º e/ou da baixa mencionada no artigo 8º, caracterizam a Inadimplência Regulamentar do(s) Agente(s) Registrador(es), sujeitando-o(s) às penalidades estabelecidas no Regulamento.

**CAPÍTULO QUINTO – DA BAIXA DO REGISTRO DAS INFORMAÇÕES E DAS CONDIÇÕES RELATIVAS A INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO****Artigo 8º**

Na data de vencimento informada na forma do Artigo 4º, o registro das condições e das informações relativas a Instrumento Financeiro Derivativo é automaticamente baixado do MÓDULO.

**Artigo 9º**

Ocorrendo a liquidação antecipada de Instrumento Financeiro Derivativo, o(s) Agente(s) Registrador(es) deve(m) proceder à baixa do registro das respectivas informações e condições no MÓDULO.

**CAPÍTULO SEXTO – DO PROCEDIMENTO PARA REGISTRO, PARA ATUALIZAÇÃO E PARA A BAIXA DE INFORMAÇÕES E DE CONDIÇÕES RELATIVAS A INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO****Artigo 10**

O registro e a atualização de informações e condições relativas a Instrumento Financeiro Derivativo no MÓDULO são efetuados:

- I - na hipótese de o empréstimo ter sido efetuado para repasse, mediante:
  - a) os comandos das partes residentes ou domiciliadas no País, quando ambas forem Participantes;
  - b) o comando único da Instituição Financeira que seja parte residente ou domiciliada no País, quando a outra parte residente ou domiciliada no País for seu Cliente; ou

- c) os comandos da Instituição Financeira que seja parte residente ou domiciliada no País e da Instituição Financeira titular da Conta de Cliente, quando a outra parte residente ou domiciliada no País for Cliente de outra instituição que não aquela; e
- II - na hipótese de o empréstimo não ter sido efetuado para repasse, mediante:
- a) o comando único da parte residente ou domiciliada no País, quando ela for Instituição Financeira;
  - b) os comandos da parte residente ou domiciliada no País e do Agente Registrador designado na forma do inciso II do Artigo 5º, quando aquela, embora Participante, não seja Instituição Financeira; ou
  - c) o comando único do referido Agente Registrador designado, quando a parte residente ou domiciliada no País for um Cliente.

Parágrafo único – O disposto neste Artigo também se aplica à baixa das informações e condições de Instrumento Financeiro Derivativo liquidado antecipadamente.

## **CAPÍTULO SÉTIMO – DOS PROCEDIMENTOS VEDADOS AO PARTICIPANTE**

### **Artigo 11**

É vedado ao Participante praticar qualquer ato que esteja em desacordo com o Regulamento, o presente Manual de Normas ou com as demais Normas da CETIP, assim como em desacordo com quaisquer disposições legais e regulamentares.

## **CAPÍTULO OITAVO – DAS DISPOSIÇÕES GERAIS**

### **Artigo 12**

O Diretor Geral é competente para dirimir eventuais dúvidas ou omissões deste instrumento, através de Norma da CETIP, complementando o disposto neste Manual de Normas.

### **Artigo 13**

Este Manual de Normas entra em vigor na data de 25 de janeiro de 2010.