

MANUAL DE NORMAS ATUAÇÃO DA CETIP COMO AGENTE DE CÁLCULO



VERSÃO: 21/06/2010

**MANUAL DE NORMAS
ATUAÇÃO DA CETIP COMO AGENTE DE CÁLCULO**

ÍNDICE

CAPÍTULO PRIMEIRO – DO OBJETIVO	3
CAPÍTULO SEGUNDO – DAS DEFINIÇÕES	3
CAPÍTULO TERCEIRO – DAS METODOLOGIAS DE CÁLCULO, DOS MODELOS DE CÁLCULO E DAS FONTES DE DADOS UTILIZADOS PELA CETIP NA MARCAÇÃO A MERCADO	4
CAPÍTULO QUARTO – DA INDICAÇÃO, DA SUBSTITUIÇÃO, DA DESTITUIÇÃO E DA RENÚNCIA DA CETIP COMO AGENTE DE CÁLCULO	4
Seção I – Da Indicação da CETIP como Agente de Cálculo	4
Seção II – Da Substituição e da Destituição da CETIP como Agente de Cálculo	5
Seção III – Da Renúncia da CETIP da Função de Agente de Cálculo	5
CAPÍTULO QUINTO – DO REGISTRO DO PREÇO OU DO VALOR APURADO NA MARCAÇÃO A MERCADO NO MID	5
CAPÍTULO SEXTO – DAS TAXAS E DOS DEMAIS CUSTOS DEVIDOS POR PARTICIPANTE VINCULADO QUE INDIQUE A CETIP COMO AGENTE DE CÁLCULO	5
CAPÍTULO SÉTIMO – DAS DISPOSIÇÕES GERAIS	6

MANUAL DE NORMAS ATUAÇÃO DA CETIP COMO AGENTE DE CÁLCULO

CAPÍTULO PRIMEIRO – DO OBJETIVO

Artigo 1º

O presente Manual de Normas é instituído pela **CETIP S.A. – BALCÃO ORGANIZADO DE ATIVOS E DERIVATIVOS** (“CETIP”), com o objetivo de descrever as regras e os aspectos específicos pertinentes à sua atuação como Agente de Cálculo.

§1º – Na função de Agente de Cálculo, a CETIP efetua a Marcação a Mercado de *swap*, termo ou opção registrado em Sistema (“Operação de Derivativo”), bem como do(s) respectivo(s) Ativo(s) Garantidor(es).

§2º – Os tipos de Operação de Derivativo e de Ativo Garantidor para os quais a CETIP pode ser indicada para atuar como Agente de Cálculo são divulgados em Manual de Operações e/ou em Comunicados.

CAPÍTULO SEGUNDO – DAS DEFINIÇÕES

Artigo 2º

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

- I - Alienação/Cessão Fiduciária – a alienação fiduciária e a cessão fiduciária, reguladas pelo Artigo 66-B da Lei nº 4.728/1965, incluído pela Lei nº 10.931/2004, e pelo Decreto-Lei nº 911/1969, sucessivamente complementados pelo disposto nos artigos 1.361 e seguintes do Código Civil Brasileiro.
- II - Ativo Garantidor – o valor mobiliário, título ou outro direito de crédito alienado ou cedido fiduciariamente em garantia de Operação de Derivativo.
- III - Diretor Geral – o Diretor Geral da CETIP.
- IV - Marcação a Mercado – a atividade que tem como principal objetivo identificar o valor de uma Operação de Derivativo e do(s) respectivo(s) Ativo(s) Garantidor(es) em uma determinada data, utilizando-se modelos matemáticos para esse fim.

- V - MID – Módulo de Informação de Derivativos, integrante do Sistema de Registro.
- VI - Norma da CETIP – Manual de Normas, Manual de Operações, Código de Conduta, Comunicado ou Carta-Circular expedidos pelo Diretor Geral.
- VII - Operação de Derivativo – o *swap*, a opção ou o termo registrado em Sistema .
- VIII - Participante – o detentor de Direito(s) de Acesso.
- IX - Participante Vinculado – o Participante que seja parte da Operação de Derivativo ou o Participante cujo Cliente seja parte da operação.
- X - 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.
- XI - Sistema – o Sistema de Registro, ou o Sistema de Compensação e Liquidação, ou o Sistema de Custódia Eletrônica.

CAPÍTULO TERCEIRO – DAS METODOLOGIAS DE CÁLCULO, DOS MODELOS DE CÁLCULO E DAS FONTES DE DADOS UTILIZADOS PELA CETIP NA MARCAÇÃO A MERCADO

Artigo 3º

As metodologias de cálculo, os modelos de cálculo e as fontes de dados utilizados pela CETIP na Marcação a Mercado constam do documento “Metodologia CETIP de Marcação a Mercado”.

CAPÍTULO QUARTO – DA INDICAÇÃO, DA SUBSTITUIÇÃO, DA DESTITUIÇÃO E DA RENÚNCIA DA CETIP COMO AGENTE DE CÁLCULO

Seção I – Da Indicação da CETIP como Agente de Cálculo

Artigo 4º

O registro de indicação da CETIP como Agente de Cálculo no MID é permitido para o(s) Participante(s) Vinculado(s) que tenha(m) previamente firmado o Termo de Compromisso e Adesão a este Manual de Normas.

Parágrafo único – As regras e os procedimentos relativos ao registro de indicação da CETIP como Agente de Cálculo constam do Manual de Normas de Agente de Cálculo e Acelerador e do correspondente Manual de Operações.

Seção II – Da Substituição e da Destituição da CETIP como Agente de Cálculo

Artigo 5º

Os procedimentos e as regras pertinentes à substituição e à destituição da CETIP como Agente de Cálculo constam do Manual de Normas de Agente de Cálculo e Acelerador e do correspondente Manual de Operações.

Seção III – Da Renúncia da CETIP da Função de Agente de Cálculo

Artigo 6º

É facultado à CETIP, mediante informação ao(s) Participante(s) Vinculado(s) que a tenha(m) indicado como Agente de Cálculo, interromper a prestação desse serviço, a qualquer tempo, para uma ou mais Operações de Derivativos e seu(s) Ativo(s) Garantidor(es).

Parágrafo único – A renúncia mencionada no *caput* deste Artigo será informada ao(s) correspondente(s) Participante(s) Vinculado(s) com 48 (quarenta e oito) horas de antecedência, podendo tal comunicação processar-se por meio eletrônico.

CAPÍTULO QUINTO – DO REGISTRO DO PREÇO OU DO VALOR APURADO NA MARCAÇÃO A MERCADO NO MID

Artigo 7º

O procedimento para registro de preço ou de valor apurado na Marcação a Mercado no MID consta de Manual de Operações ou de Comunicado.

CAPÍTULO SEXTO – DAS TAXAS E DOS DEMAIS CUSTOS DEVIDOS POR PARTICIPANTE VINCULADO QUE INDIQUE A CETIP COMO AGENTE DE CÁLCULO

Artigo 8º

O(s) Participante(s) Vinculado(s) arcam com as taxas e os demais custos pertinentes à indicação da CETIP como Agente de Cálculo, conforme tabela de preços, divulgada na página da CETIP na rede mundial de computadores (www.cetip.com.br).

Artigo 9º

Na falta de pagamento de taxa ou custo referidos no Artigo 7º, aplicam-se os procedimentos previstos no Regulamento, no Capítulo que dispõe sobre os emolumentos, taxas e outros custos devidos pelo Participante.

CAPÍTULO SÉTIMO – DAS DISPOSIÇÕES GERAIS

Artigo 10

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 11

Este Manual de Normas entra em vigor na data de 21 de junho de 2010.