

**MANUAL DE NORMAS  
REGISTRO DE  
INFORMAÇÕES E  
CONDIÇÕES DE  
INSTRUMENTO  
FINANCEIRO DERIVATIVO  
CONTRATADO NO  
EXTERIOR**



VERSÃO: 22/02/2010

MANUAL DE NORMAS  
REGISTRO DE INFORMAÇÕES E CONDIÇÕES DE INSTRUMENTO  
FINANCEIRO DERIVATIVO CONTRATADO NO EXTERIOR

ÍNDICE

CAPÍTULO PRIMEIRO – DO OBJETIVO _____	3
CAPÍTULO SEGUNDO – DAS DEFINIÇÕES _____	3
CAPÍTULO TERCEIRO – DA POSSIBILIDADE DA PARTE DE INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO LOCALIZADA NO PAÍS SER PARTICIPANTE OU CLIENTE _____	4
CAPÍTULO QUARTO – DO REGISTRO DAS INFORMAÇÕES E DAS CONDIÇÕES RELATIVAS AO INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO _____	5
CAPÍTULO QUINTO – DAS RESPONSABILIDADES DA INSTITUIÇÃO REGISTRADORA _____	5
CAPÍTULO SEXTO – DA BAIXA AUTOMÁTICA DO REGISTRO DAS INFORMAÇÕES E DAS CONDIÇÕES RELATIVAS A INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO _____	6
CAPÍTULO SÉTIMO – DO PROCEDIMENTO PARA REGISTRO, PARA ATUALIZAÇÃO E PARA BAIXA DE INFORMAÇÕES E DE CONDIÇÕES RELATIVAS A INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO _____	6
CAPÍTULO OITAVO – DOS PROCEDIMENTOS VEDADOS AO PARTICIPANTE _____	6
CAPÍTULO NONO – DAS DISPOSIÇÕES GERAIS _____	7

---

**MANUAL DE NORMAS  
REGISTRO DE INFORMAÇÕES E CONDIÇÕES DE INSTRUMENTO  
FINANCEIRO DERIVATIVO CONTRATADO 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 contratado no exterior por instituição financeira, ou por outra instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil, bem como por sua dependência ou por empresa integrante do seu conglomerado financeiro, no Módulo de Derivativos Realizados no Exterior.

### **CAPÍTULO SEGUNDO – DAS DEFINIÇÕES**

#### **Artigo 2º**

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

- I - Instituição Registradora – a instituição financeira, ou outra instituição autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil, que efetue o registro de condições e informações relativas à posição que tenha assumido em instrumento financeiro derivativo, ou que tenha sido assumida por dependência ou por empresa integrante de seu conglomerado financeiro, no MÓDULO, conforme disposto na Resolução do CMN nº 3.824, de 16 de dezembro de 2009.
- 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 - Dependência/Empresa Integrante de Conglomerado Financeiro – a dependência de Instituição Registradora, ou a empresa integrante do seu conglomerado financeiro, parte de Instrumento Financeiro Derivativo.
- V - Instrumento Financeiro Derivativo – o instrumento financeiro derivativo contratado no exterior por instituição financeira, ou por outra instituição

autorizada a funcionar pelo Banco Central do Brasil, bem como por sua dependência ou por empresa integrante do seu conglomerado financeiro.

- VI - Módulo de Derivativos Realizados no Exterior (“MÓDULO”) – subdivisão do Sistema de Custódia Eletrônica 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 – DA POSSIBILIDADE DA PARTE DE INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO LOCALIZADA NO PAÍS SER PARTICIPANTE OU CLIENTE**

#### **Artigo 3º**

A Dependência/Empresa Integrante de Conglomerado Financeiro localizada no País poderá ser um Participante ou um Cliente da Instituição Registradora.

§1º – A parte de Instrumento Financeiro Derivativo localizada no País que não for a própria Instituição Registradora, sua dependência ou integrante do seu conglomerado financeiro deverá ser Cliente da Instituição Registradora.

§2º – Os dados identificadores do Cliente referido no *caput* e no §1º serão cadastrados no MÓDULO pela Instituição Registradora, por ocasião do registro das informações e das condições do Instrumento Financeiro Derivativo.

## **CAPÍTULO QUARTO – DO REGISTRO DAS INFORMAÇÕES E DAS CONDIÇÕES RELATIVAS AO INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO**

### **Artigo 4º**

O registro de informações e de condições de Instrumento Financeiro Derivativo deve conter:

- I - o(s) ativo(s) subjacente(s);
- II - o(s) valor(es) envolvido(s);
- III - a(s) moeda(s) contratada(s);
- IV - o(s) prazo(s) pactuado(s);
- V - a data de vencimento;
- VI - os dados identificadores da parte residente ou domiciliada no exterior;
- VII - os dados identificadores da Dependência/Empresa Integrante de Conglomerado Financeiro localizada no exterior, quando for o caso;
- VIII - o(s) parâmetro(s) utilizado(s);
- IX - a forma de liquidação; e
- X - as demais informações e condições previstas em Norma da CETIP.

## **CAPÍTULO QUINTO – DAS RESPONSABILIDADES DA INSTITUIÇÃO REGISTRADORA**

### **Artigo 5º**

A Instituição Registradora é responsável:

- I - pela exatidão das informações e das condições pertinentes a Instrumento Financeiro Derivativo registradas no MÓDULO;
- II - pela atualização das informações e das condições pertinentes a Instrumento Financeiro Derivativo no MÓDULO, sempre que forem alteradas; e
- III - por proceder à baixa do registro das informações e condições no MÓDULO, se ocorrer a liquidação antecipada do Instrumento Financeiro Derivativo.

**Artigo 6º**

O descumprimento de qualquer das atribuições referidas no Artigo 5º caracteriza a Inadimplência Regulamentar da Instituição Registradora, sujeitando-a as penalidades estabelecidas no Regulamento.

**CAPÍTULO SEXTO – DA BAIXA AUTOMÁTICA DO REGISTRO DAS INFORMAÇÕES E DAS CONDIÇÕES RELATIVAS A INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO****Artigo 7º**

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.

**CAPÍTULO SÉTIMO – DO PROCEDIMENTO PARA REGISTRO, PARA ATUALIZAÇÃO E PARA BAIXA DE INFORMAÇÕES E DE CONDIÇÕES RELATIVAS A INSTRUMENTO FINANCEIRO DERIVATIVO****Artigo 8º**

O registro de informações e condições relativas a Instrumento Financeiro Derivativo no MÓDULO, bem como a sua atualização e a sua baixa no caso de vencimento antecipado, são efetuados mediante comando único da Instituição Registradora.

Parágrafo único – A Instituição Registradora deve efetuar o registro das informações e condições de Instrumento Financeiro Derivativo no prazo determinado na Resolução do CMN nº 3.824, de 16 de dezembro de 2009.

**CAPÍTULO OITAVO – DOS PROCEDIMENTOS VEDADOS AO PARTICIPANTE****Artigo 9º**

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 NONO – 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 22 de fevereiro de 2010.