

MANUAL DE NORMAS DE INSTRUMENTO ELEGÍVEL PARA COMPOR PATRIMÔNIO DE REFERÊNCIA

MANUAL DE NORMAS

INSTRUMENTO ELEGÍVEL PARA COMPOR PATRIMÔNIO DE REFERÊNCIA

SUMÁRIO

CAPÍTULO I – DO OBJETIVO	3
CAPÍTULO II – DAS DEFINIÇÕES	4
CAPÍTULO III – DA ATIVIDADE DE REGISTRO DE CONTRATO ELEGÍVEL A PR – BRASIL	4
CAPÍTULO IV – DA ATIVIDADE DE DEPÓSITO CENTRALIZADO DE LETRA FINANCEIRA ELEGÍVEL A PR	4
CAPÍTULO V – DO MERCADO DE BALCÃO ORGANIZADO PARA OPERAÇÃO COM LETRA FINANCEIRA ELEGÍVEL A PR E COM CONTRATO ELEGÍVEL A PR – BRASIL	4
CAPÍTULO VI – DOS PARTICIPANTES ENVOLVIDOS NO REGISTRO DE CONTRATO ELEGÍVEL A PR – BRASIL E NO DEPÓSITO CENTRALIZADO DE LETRA FINANCEIRA ELEGÍVEL A PR	6
Seção I – Das atribuições e responsabilidades aplicáveis ao Devedor de IECP, de IECI – Capital Complementar e de IECI – Nível II	6
Seção II – Das atribuições e responsabilidades específicas aplicáveis ao Emissor de LFSC e de LFSN	6
CAPÍTULO VII – DAS CARACTERÍSTICAS ESPECÍFICAS APLICÁVEIS AOS INSTRUMENTOS ELEGÍVEIS A PR	7
Seção I – Do Regime aplicável ao Contrato Elegível a PR – Brasil e à Letra Financeira Elegível a PR	7
Seção II – Do serviço de natureza exclusivamente informacional relativa ao IECE – Capital Complementar e ao IECE – Nível II	7
CAPÍTULO VIII – DA LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA DE EVENTO E DE OPERAÇÃO COM CONTRATO ELEGÍVEL A PR – BRASIL E COM LETRA FINANCEIRA ELEGÍVEL A PR	8
CAPÍTULO IX – DAS DISPOSIÇÕES FINAIS	9

MANUAL DE NORMAS

INSTRUMENTO ELEGÍVEL PARA COMPOR PATRIMÔNIO DE REFERÊNCIA

CAPÍTULO I – DO OBJETIVO

Artigo 1

O presente Manual de Normas tem por objetivo, observado o disposto no Regulamento do Segmento Cetip UTVM e no Manual de Normas do Subsistema de Registro, do Subsistema de Depósito Centralizado e do Subsistema de Compensação e Liquidação, definir disposições específicas aplicáveis aos instrumentos elegíveis para compor Patrimônio de Referência (“Instrumentos Elegíveis a PR”) relativas:

- I - ao Registro de Contrato Elegível a PR – Brasil para compor Capital Principal (“IECP”), Capital Complementar (“IECI – Capital Complementar”) e Nível II (“IECI - Nível II”);
- II - ao Depósito Centralizado de Letra Financeira Elegível a PR para compor Capital Complementar (“LFSC”) e Nível II (“LFSN”);
- III - ao Mercado de Balcão Organizado para operação com Letra Financeira Elegível a PR e com Contrato Elegível a PR – Brasil;
- IV - ao Registro de operação com Contrato Elegível a PR – Brasil não cursada no Mercado de Balcão Organizado;
- V - aos Participantes envolvidos no Registro de Contrato Elegível a PR – Brasil e no Depósito Centralizado de Letra Financeira Elegível a PR;
- VI - às características específicas aplicáveis aos Instrumentos Elegíveis a PR; e
- VII - à Liquidação Financeira de Evento e de operação com o Contrato Elegível a PR – Brasil e com a Letra Financeira Elegível a PR, operacionalizada por meio do Subsistema de Compensação e Liquidação.

Parágrafo único – Os Contratos Elegíveis a PR – Brasil e as Letras Financeiras Elegíveis a PR são classificados como Ativo Financeiro para os fins do Regulamento do Segmento Cetip UTVM, bem como dos Manuais de Normas e dos Manuais de Operações relativos ao Segmento Cetip UTVM, em razão do disposto na alínea “a” do inciso I do Artigo 2º da Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 4.593, de 28 de agosto de 2017.

CAPÍTULO II – DAS DEFINIÇÕES

Artigo 2

Às definições dos termos com iniciais em maiúscula, em suas formas no singular e no plural, utilizadas neste Manual de Normas aplicam-se as definições e os significados constantes do Glossário das Normas do Segmento Cetip UTVM.

Parágrafo único – Os termos usuais dos mercados financeiro e de capitais, os de natureza jurídica, econômica e contábil e os termos técnicos de qualquer outra natureza empregados neste Manual de Normas e não constantes do Glossário das Normas do Segmento Cetip UTVM têm os significados geralmente aceitos no Brasil.

CAPÍTULO III – DA ATIVIDADE DE REGISTRO DE CONTRATO ELEGÍVEL A PR – BRASIL

Artigo 3

Aplicam-se ao IECF, ao IECI – Capital Complementar e ao IECI - Nível II as disposições relativas à atividade de Registro de Ativos Financeiros constantes do Regulamento do Segmento Cetip UTVM, do Manual de Normas do Subsistema de Registro, do Subsistema de Depósito Centralizado e do Subsistema de Compensação e Liquidação e deste Manual de Normas e as instruções constantes do Manual de Operações – Cadastramento e Emissão – Títulos e Valores Mobiliários.

CAPÍTULO IV – DA ATIVIDADE DE DEPÓSITO CENTRALIZADO DE LETRA FINANCEIRA ELEGÍVEL A PR

Artigo 4

Aplicam-se à LFSC e à LFSN as disposições relativas à atividade de Depósito Centralizado de Ativos Financeiros constantes do Regulamento do Segmento Cetip UTVM e do Manual de Normas do Subsistema de Registro, do Subsistema de Depósito Centralizado e do Subsistema de Compensação e Liquidação e deste Manual de Normas e as instruções constantes do Manual de Operações – Cadastramento e Emissão – Títulos e Valores Mobiliários e do Manual de Operações – Funções – Títulos e Valores Mobiliários.

CAPÍTULO V – DO MERCADO DE BALCÃO ORGANIZADO PARA OPERAÇÃO COM LETRA FINANCEIRA ELEGÍVEL A PR E COM CONTRATO ELEGÍVEL A PR – BRASIL

Artigo 5

As operações disponíveis para LFSC e para LFSN na Plataforma Eletrônica estão relacionadas nos Manuais de Operações da Plataforma Eletrônica.

Artigo 6

O Subsistema de Registro admite o registro de operação de cessão de crédito com IECI – Capital Complementar e com IECI - Nível II previamente realizada fora do Segmento Cetip UTVM, nos termos do Regulamento do Segmento Cetip UTVM e do

Manual de Normas do Subsistema de Registro, do Subsistema de Depósito Centralizado e do Subsistema de Compensação e Liquidação.

Artigo 7

A cessão de crédito realizada fora do Subsistema de Registro deve ser comunicada à Diretoria de Depositária e Operações de Balcão.

§1º – O instrumento de cessão de crédito de IECI – Capital Complementar ou de IECI - Nível II deve permanecer à disposição da B3 e da BSM.

§2º – As partes envolvidas em cessão de crédito a que se refere o caput isentam a B3, em caráter irrevogável e irretratável, de qualquer responsabilidade pelo crédito indevido de Evento em razão do descumprimento do disposto no caput.

Artigo 8

O Subsistema de Registro não admite o registro de operação:

- I - de cessão de crédito de IECI; e
- II - de assunção de dívida de IECI, de IECI – Capital Complementar e de IECI - Nível II.

§1º – As informações relativas às operações acima devem ser comunicadas à Diretoria de Depositária e Operações de Balcão.

§2º – Os instrumentos de cessão de crédito de IECI e de assunção de dívida de IECI, de IECI – Capital Complementar e de IECI - Nível II devem permanecer à disposição da B3 e da BSM.

§3º – As partes envolvidas em cessão de crédito ou em assunção de dívida a que se refere este Artigo isentam a B3 de qualquer responsabilidade pelo crédito indevido de Evento em razão do descumprimento do disposto no §1º.

Artigo 9

O Subsistema de Depósito Centralizado admite o registro de operação previamente realizada com LFSC e com LFSN fora do Segmento Cetip UTVM, nos termos do Regulamento do Segmento Cetip UTVM e do Manual de Normas do Subsistema de Registro, do Subsistema de Depósito Centralizado e do Subsistema de Compensação e Liquidação.

CAPÍTULO VI – DOS PARTICIPANTES ENVOLVIDOS NO REGISTRO DE CONTRATO ELEGÍVEL A PR – BRASIL E NO DEPÓSITO CENTRALIZADO DE LETRA FINANCEIRA ELEGÍVEL A PR

Seção I – Das atribuições e responsabilidades aplicáveis ao Devedor de IECP, de IECI – Capital Complementar e de IECI – Nível II

Artigo 10

O Devedor de IECP, de IECI – Capital Complementar e o de IECI – Nível II atua no Subsistema de Registro, nos termos do Regulamento do Segmento Cetip UTVM e deste Manual de Normas, na qualidade de Agente de Registro.

Artigo 11

O Devedor de IECP, o de IECI – Capital Complementar e o de IECI – Nível II assume, no exercício de suas funções, todos os deveres e obrigações estabelecidos para o Emissor no Regulamento do Segmento Cetip UTVM devendo, adicionalmente:

- I - efetuar a guarda do correspondente contrato e de toda a documentação a ele relativa, assumindo, para todos os efeitos legais, a qualidade de fiel depositário; e
- II - no caso de IECP e de IECI – Capital Complementar:
 - a) observar as condições de suspensão de pagamento ou de extinção de pagamento estabelecidas na regulamentação aplicável; e
 - b) em ocorrendo condição de não pagamento de Evento na forma da regulamentação em vigor, comunicar à Diretoria de Depositária e Operações de Balcão, até a data prevista para a Liquidação Financeira de Evento.

Parágrafo único – A informação de que trata a alínea “b” do inciso II será comunicada ao Banco Central do Brasil.

Seção II – Das atribuições e responsabilidades específicas aplicáveis ao Emissor de LFSC e de LFSN

Artigo 12

O Emissor de LFSC e o de LFSN atuam no Subsistema de Depósito Centralizado, nos termos do Regulamento do Segmento Cetip UTVM e deste Manual de Normas, na qualidade de Agente de Depósito.

Artigo 13

O Emissor de LFSC e o de LFSN assumem, no exercício de suas funções, todos os deveres e obrigações estabelecidos para o exercício dessa atividade no Regulamento do Segmento Cetip UTVM devendo, adicionalmente, no caso de LFSC:

- I - observar as condições de suspensão de pagamento de Evento ou de

extinção de pagamento de Evento estabelecidas na regulamentação aplicável; e

- II - em ocorrendo condição de não pagamento de Evento na forma da regulamentação em vigor, comunicar à Diretoria de Depositária e Operações de Balcão, até a data prevista para a Liquidação Financeira de Evento.

Parágrafo único – A informação de que trata o inciso II será comunicada ao Banco Central do Brasil.

Seção III – Das atribuições e responsabilidades aplicáveis aos demais Participantes envolvidos no Registro ou no Depósito Centralizado de Contrato Elegível a PR – Brasil e a Letra Financeira Elegível a PR

Artigo 14

Aplicam-se aos demais Participantes envolvidos no Registro de IECP, de IECE – Capital Complementar e de IECE – Nível II e no Depósito Centralizado de LFSC e de LFSN, ao atuarem para si próprios ou no exercício de função para terceiros, os deveres e obrigações estabelecidos no Regulamento do Segmento Cetip UTMV.

CAPÍTULO VII – DAS CARACTERÍSTICAS ESPECÍFICAS APLICÁVEIS AOS INSTRUMENTOS ELEGÍVEIS A PR

Seção I – Do Regime aplicável ao Contrato Elegível a PR – Brasil e à Letra Financeira Elegível a PR

Artigo 15

O Regime aplicável ao IECP, ao IECE – Capital Complementar e ao IECE - Nível II é exclusivamente o de Registro.

Artigo 16

O Regime aplicável à LFSC e à LFSN é exclusivamente o de Depósito Centralizado.

Seção II – Do serviço de natureza exclusivamente informacional relativa ao IECE – Capital Complementar e ao IECE – Nível II

Artigo 17

A B3 presta serviço de natureza exclusivamente informacional para o Instrumento Elegível PR – Exterior para compor Capital Complementar (“IECE – Capital Complementar”) e Nível II (“IECE – Nível II”) tratado no Regulamento do Segmento Cetip UTMV.

Artigo 18

A exclusão das informações relativas a IECE – Capital Complementar e de IECE – Nível II é efetuada:

- a) pelo Devedor, na hipótese de liquidação antecipada do instrumento; ou
- b) de forma automática, na data de vencimento do instrumento informada pelo Devedor.

Artigo 19

O Devedor de IECE – Capital Complementar e o de IECE – Nível II atuam no Segmento Cetip UTVM com as mesmas atribuições estabelecidas no Regulamento do Segmento Cetip UTVM para Agente de Registro devendo, adicionalmente:

- I - efetuar a guarda dos correspondentes instrumentos e de toda a documentação a eles relativas, assumindo, para todos os efeitos legais, a qualidade de fiel depositário;
- II - efetuar o Lançamento das informações relativas ao instrumento, atualizando-as sempre que forem alteradas;
- III - comunicar à Diretoria de Depositária e Operações de Balcão as informações relativas à operação que tenha esses instrumentos por objeto; e
- IV - comunicar à Diretoria de Depositária e Operações de Balcão sobre o pagamento de Evento ou, quando previsto na regulamentação em vigor, sobre a ocorrência de condição de não pagamento de Evento.

Parágrafo único – A informação de que trata o inciso IV será comunicada ao Banco Central do Brasil.

CAPÍTULO VIII – DA LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA DE EVENTO E DE OPERAÇÃO COM CONTRATO ELEGÍVEL A PR – BRASIL E COM LETRA FINANCEIRA ELEGÍVEL A PR

Artigo 20

O Evento de IECE – Nível II e de LFSN é liquidado exclusivamente na modalidade Liquidação por Compensação Multilateral de recursos financeiros com transferência de recursos financeiros pelo líquido e de Ativos pelo bruto, ressalvado o disposto no inciso III do Artigo 21.

Artigo 21

São liquidados exclusivamente na modalidade Liquidação por Transferência do Bruto, em Tempo Real, de recursos financeiros e de Ativos:

- I - a operação realizada no mercado secundário com IECE – Capital Complementar e com LFSC;
- II - o Evento de IECE, de IECE – Capital Complementar e de LFSC; e
- III - o Evento de IECE – Nível II e de LFSN que tenha sido suspenso da modalidade Liquidação por Compensação Multilateral de recursos

financeiros com transferência de recursos financeiros pelo líquido e de Ativos pelo bruto.

Parágrafo único – A Liquidação Financeira de cessão de crédito de IECI – Capital Complementar operacionalizada no Subsistema de Compensação e Liquidação não é evidência de que o negócio foi efetivado, devendo as partes contratantes formalizar o instrumento de cessão nos termos da legislação vigente.

Artigo 22

A Liquidação Financeira de cessão de crédito de IECI – Capital Complementar e de IECI – Nível II e a de operação realizada no mercado secundário com LFSC e com LFSN que envolvam dois Participantes, sendo um deles o Devedor ou o Emissor, ou empresa do seu conglomerado financeiro, podem ser processadas na modalidade Liquidação por Compensação Multilateral de recursos financeiros com transferência de recursos financeiros pelo líquido e de Ativos pelo bruto ou na modalidade Liquidação por Transferência do Bruto, em Tempo Real, de recursos financeiros e de Ativos, a critério dos Participantes.

Artigo 23

Na ausência de cadastramento de preço unitário de Evento de IECP, de IECI – Complementar, de IECI – Nível II, de LFSC ou de LFSN, nas hipóteses em que for requerido, o Devedor ou o Emissor, deverá efetuar a Liquidação Financeira do Evento fora do ambiente do Segmento Cetip UTVM.

Parágrafo único – Ocorrendo a situação referida no *caput*, o Devedor ou o Emissor, deverá comprovar a realização do pagamento de Evento, observando as instruções constantes do Manual de Operações – Funções – Títulos e Valores Mobiliários.

CAPÍTULO IX – DAS DISPOSIÇÕES FINAIS

Artigo 24

O Presidente é competente para dirimir eventuais dúvidas ou omissões deste Manual de Normas.

Artigo 25

O presente Manual de Normas cancela e substitui o Manual de Normas de Instrumento Elegível para Compor Patrimônio de Referência, emitido em 20 de agosto de 2018.

Artigo 26

Este Manual de Normas entra em vigor na data de 25 de março de 2019.