

**MANUAL DE MOVIMENTAÇÃO DE GARANTIAS NO EXTERIOR**

**DAR-GMOG**

**2019**

---

**SUMÁRIO**

1. INTRODUÇÃO.....	3
2. GARANTIAS OFFSHORE ACEITAS COMO GARANTIA .....	3
3. MOVIMENTAÇÃO GARANTIA VIA DTCC .....	3
3.1 Depósito.....	3
3.2 Retirada.....	5
4. MOVIMENTAÇÃO GARANTIA VIA EUROCLEAR.....	6
4.1 Depósito.....	6
4.1.1 Entre contas Euroclear .....	7
4.1.2 Euroclear via FED .....	8
4.1.3 Euroclear via DTCC.....	9
4.2 Retirada.....	10
4.2.1 Entre contas Euroclear .....	11
4.2.2 Euroclear via FED .....	12
4.2.3 Euroclear via DTCC.....	13
5. DÓLARES NORTE-AMERICANOS COMO GARANTIA .....	14
5.1 Depósito.....	14
5.1.1 Através da conta de liquidação da B3 .....	14
5.1.2 Direto da conta do cliente .....	15
5.2 Retirada.....	16
5.2.1 Para a conta de liquidação da B3.....	17
5.2.2 Para a conta do cliente.....	17
6. EVENTOS .....	18
6.1 Pagamento de cupom .....	18
6.2 Vencimento .....	18
7. PRECIFICAÇÃO.....	18
8. CUSTOS.....	18
9. FAZER/NÃO FAZER.....	18
9.1 Fazer.....	18
9.2 Não fazer.....	18

---

## 1. INTRODUÇÃO

Conforme a Resolução CMN 4.569/2017, investidores não residentes são autorizados a depositar garantias no exterior para as transações nos mercados financeiro e de capitais no Brasil. Há dois tipos de investidor:

- definido pela Resolução CMN 2.687/2000: aqueles que liquidam em dólares norte-americanos suas operações realizadas nos mercados agrícolas da B3 e podem depositar títulos de emissão do tesouro norte-americano e dólares como garantia de suas operações;
- definido pela Resolução CMN 4.373/2014: aqueles que negociam opções, termo, operações de empréstimo (BTB), índices, derivativos listados e mercado de balcão, podem depositar como garantia, dólares norte-americanos, títulos de emissão do tesouro norte-americano, ADR (American Depositary Receipt) de ação elegível à aceitação como garantia e título de emissão do tesouro alemão.

O Banco Central do Brasil por meio da Circular Bacen 3.838/2017, estabeleceu que o montante total de ativos que pode ser mantido no exterior para fins de cumprimento de requisição de garantias não poderá ultrapassar 8% do valor agregado da margem requerida pelo sistema de compensação e liquidação. Sendo assim, faz-se necessário a solicitação de limite para utilização de garantias no exterior para a equipe de Garantias da B3, por meio da corretora representante.

## 2. ATIVOS OFFSHORE ACEITOS COMO GARANTIA

São aceitos como garantias: títulos de emissão do tesouro norte-americano (US Treasuries), títulos de emissão do tesouro alemão (German Bonds) e ADRs (American Depositary Receipts) de ação elegível à aceitação como garantia. Na The Depository Trust & Clearing Corporation (DTCC), são aceitos US Treasuries e ADRs. Na Euroclear, são aceitos German Bonds, US Treasuries e ADRs.

## 3. MOVIMENTAÇÃO GARANTIA VIA DTCC

### 3.1 Depósito

Número da conta da B3 na DTCC: 0822

O depósito de títulos via DTCC é realizado seguindo o fluxo da Figura 1.

**Figura 1. Fluxo de retirada via DTCC**



Para o participante efetuar o lançamento no sistema de garantias (NGA), é necessário preencher os campos indicados na Figura 2.

Figura 2. Tela do NGA para depósito via DTCC

Tipo da Garantia	Título Internacional
Finalidade de Cobertura	Garantias de Operações

Identificador da Garantia	<input type="text"/>	→	ISIN do ativo
Data da Negociação	<input type="text"/>	→	Data de negociação e liquidação devem ser informadas pelo custodiante
Data de Liquidação	<input type="text"/>		
Quantidade	<input type="text"/>		

Depositária Destino	DTCC - 0822
---------------------	-------------

Dados Origem			
Método	DTCC	→	Conta do custodiante na DTCC - Número até 4 dígitos
Conta	<input type="text"/>		

### Número de conta na DTCC

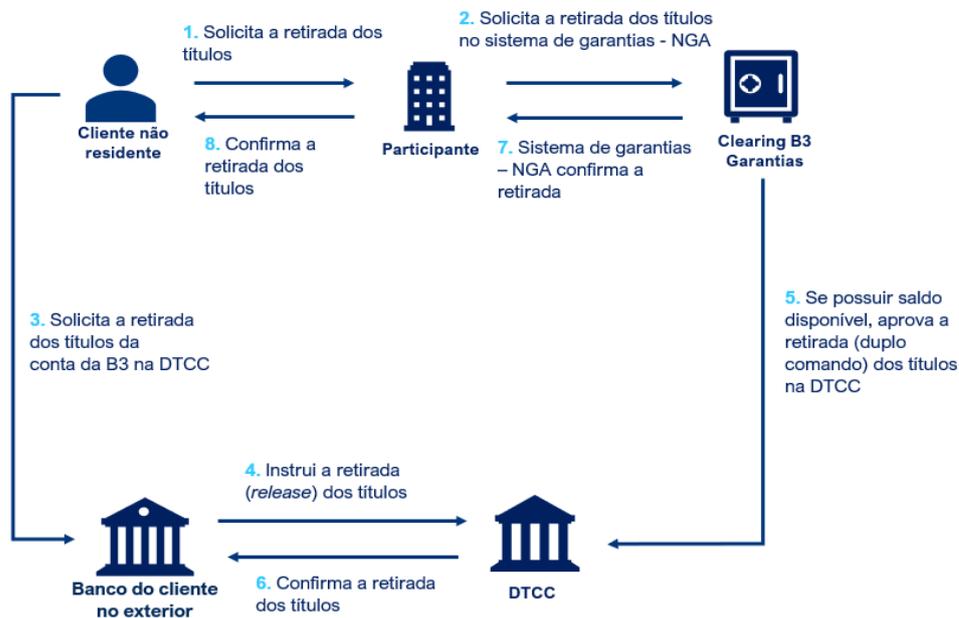
Conta da B3 na DTCC = 0822

### Formato

- **DTC ABA #:** 026002066
- **Nome do DTC:** DTC SDFS
- **Conta de recebimento:** CUST
- **Recebendo informações do banco:** FDO / número de participante no DTCC (nota: este seria o participante que enviará o depósito, não a B3)
- **Valor em dinheiro:** 0.00
- **Montante total:** quantidade de títulos a ser transferida

### 3.2 Retirada

A retirada de títulos via DTCC é realizada seguindo o fluxo da Figura 3.

**Figura 3. Fluxo de retirada via DTCC**

#### 4. MOVIMENTAÇÃO GARANTIA VIA EUROCLEAR

##### 4.1 Depósito

- Depósito de clientes com jurisdição nos Estados Unidos da América (US)

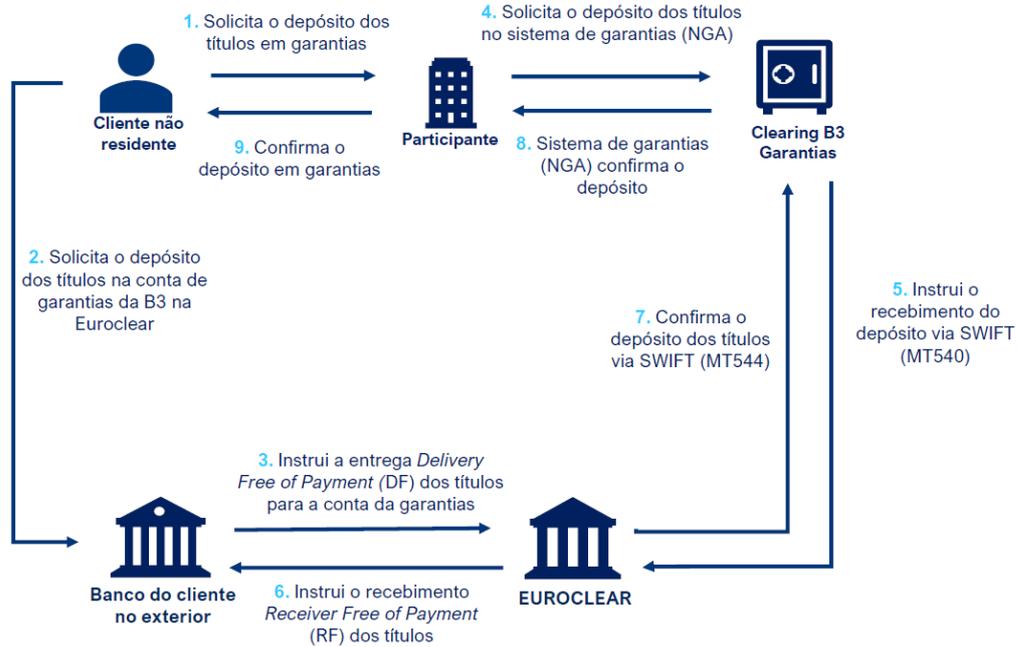
**Número de conta da B3 na Euroclear: 25393**

- Depósito de clientes com jurisdição fora dos Estados Unidos da América (US)

**Número de conta da B3 na Euroclear: 17957**

O depósito de ativos via Euroclear é realizado seguindo o fluxo da Figura 4.

Figura 4. Fluxo de depósito via Euroclear



#### 4.1.1 Entre contas Euroclear

O participante solicita o depósito no sistema de garantia (NGA). É necessário preencher os campos indicados na Figura 5.

Figura 5. Tela do NGA para depósito via Euroclear

<b>Tipo da Garantia</b>	Título Internacional
<b>Finalidade de Cobertura</b>	Garantias de Operações
<b>Identificador da Garantia</b>	<input type="text"/> → ISIN do ativo
<b>Data da Negociação</b>	<input type="text"/> → Data de negociação e liquidação devem ser informadas pelo custodiante
<b>Data de Liquidação</b>	<input type="text"/> → Data de negociação e liquidação devem ser informadas pelo custodiante
<b>Quantidade</b>	<input type="text"/>
<b>Depositária Destino</b>	EUROCLEAR - 238990
<b>Dados Origem</b>	
<b>Método</b>	EUROCLEAR
<b>Conta</b>	<input type="text"/> → Conta do custodiante na Euroclear - Número de 5 dígitos

#### 4.1.2 Euroclear via FED

O participante solicita o depósito no sistema de garantia (NGA). É necessário preencher os campos indicados na Figura 6.

**Figura 6. Tela do NGA para depósito Euroclear via FED**

<b>Tipo da Garantia</b>	Título Internacional
<b>Finalidade de Cobertura</b>	Garantias de Operações

<b>Identificador da Garantia</b>	<input type="text"/>	→ ISIN do ativo
<b>Data da Negociação</b>	<input type="text"/>	→ Data de negociação e liquidação devem ser informadas pelo custodiante
<b>Data de Liquidação</b>	<input type="text"/>	
<b>Quantidade</b>	<input type="text"/>	

<b>Depositária Destino</b>	EUROCLEAR   98606
----------------------------	-------------------

<b>Dados Origem</b>		
<b>Método</b>	via FED	
<b>ABA Code</b>	<input type="text"/>	→ Número ABA do custodiante - Número de 9
<b>Nome da Conta</b>	<input type="text"/>	→ Conta do investidor abaixo da conta do custodiante
<b>SubConta (Opcional)</b>	<input type="text"/>	→ Nome da subconta do investidor
<b>Conta DTCC</b>	<input type="text"/>	→ Número da conta do custodiante no DTCC

#### Fedwire formato (livre de pagamento) para clientes com jurisdição nos Estados Unidos:

- **Conta Fed:** 021000021 / EURCLR
- **SPC INS:** G23019 EURO25393
- **DTCYID:** 1970

#### Fedwire formato (livre de pagamento) para clientes com jurisdição fora dos Estados Unidos:

- **Conta Fed:** 021000021 / EURCLR
- **SPC INS:** G23019 EURO17957
- **DTCYID:** 1970

#### 4.1.3 Euroclear via DTCC

O participante solicita o depósito no sistema de garantia (NGA). É necessário preencher os campos indicados na Figura 7.

**Figura 7. Tela do NGA para depósito Euroclear via DTCC**

<b>Tipo da Garantia</b>	Título Internacional
<b>Finalidade de Cobertura</b>	Garantias de Operações

<b>Identificador da Garantia</b>	<input type="text"/>	ISIN do ativo
<b>Data da Negociação</b>	<input type="text"/>	Data de negociação e liquidação devem ser informadas pelo custodiante
<b>Data de Liquidação</b>	<input type="text"/>	
<b>Quantidade</b>	<input type="text"/>	

<b>Depositária Destino</b>	EUROCLEAR - 238990
----------------------------	--------------------

<b>Dados Origem</b>		
<b>Método</b>	via DTCC	
<b>Conta</b>	<input type="text"/>	Conta do custodiante na DTC - Número até 4 d
<b>SubConta (Opcional)</b>	<input type="text"/>	Conta do investidor abaixo da conta do custodi

**DTC formato (livre de pagamento) para clientes com jurisdição nos Estados Unidos:**

- **Conta DTC:** 1970
- **SPC INS:** G21691 EURO25393
- **Banco agente:** 00025787
- **Número da instituição:** 00026097

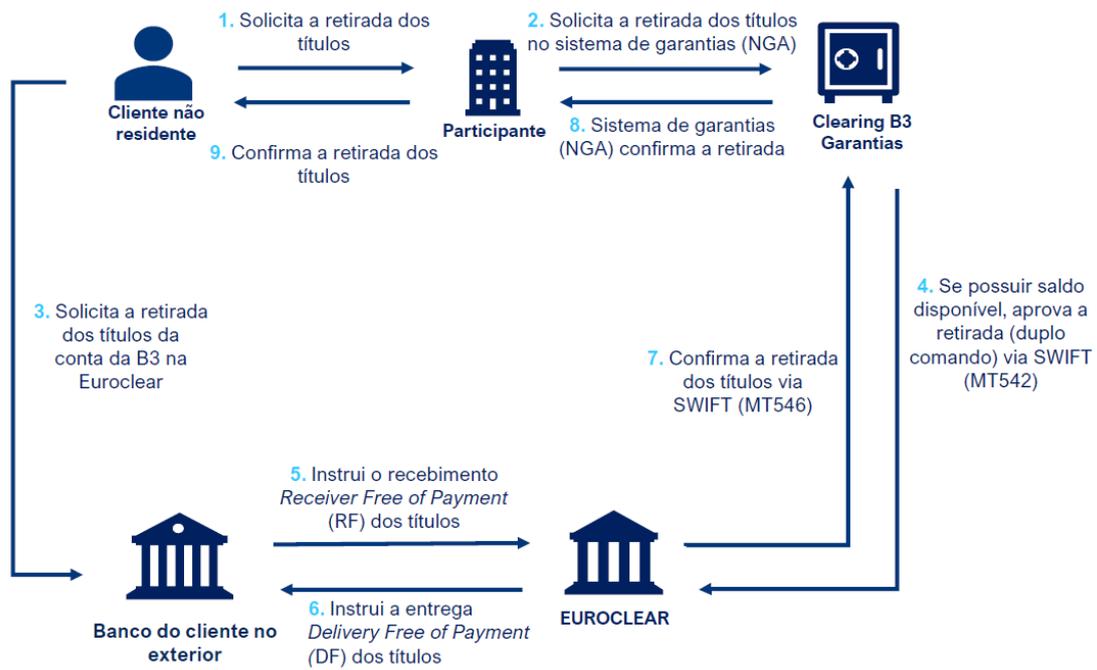
**DTC formato (livre de pagamento) para clientes com jurisdição fora dos Estados Unidos:**

- **Conta DTC:** 1970
- **SPC INS:** G21691 EURO17957
- **Banco agente:** 00025787
- **Número da instituição:** 00026097

**4.2 Retirada**

A retirada de títulos via Euroclear é realizada seguindo o fluxo da Figura 8.

**Figura 8. Fluxo de retirada via Euroclear**



### 4.2.1 Entre contas Euroclear

O participante solicita a retirada no sistema de garantia (NGA). É necessário preencher os campos indicados na Figura 9.

**Figura 9. Tela do NGA para retirada via Euroclear**

#### Requisição de Aceite de Retirada

MC	88711	TESTE CERTIFICAÇÃO RTC
PNP	88711	TESTE CERTIFICAÇÃO RTC
CL	989309	CONTA NORMAL 2687 SLF
Documento	880.000.002/0156-68	
Tipo de Pessoa	Pessoa Jurídica Não Residente Outros	
Atividade	60.00 - DEMAIS FUNDOS OU ENTIDADES DE INVESTIMENTO COLETIVO	
Categoria	CLIENTE	

Tipo da Garantia	9 - Título Internacional
Finalidade de Cobertura	1 - Garantias de Operações

Número do Ativo	2019000041685
Identificador da Garantia	US912810EW46
Cusip	912810EW4
Sub Tipo	US TREASURY BONDS
Data da Negociação	18/06/2019
Data de Liquidação	18/06/2019

→ Data de negociação e liquidação devem ser informadas pelo custodiante

Depositária Origem	EUROCLEAR   98606
--------------------	-------------------

Dados Destino	
Método	EUROCLEAR
Conta	

→ Conta do custodiante na Euroclear - Número de 5 dígitos

Quantidade Depositada	1.000
Quantidade Distribuída	0
Quantidade Disponível	1.000

Quantidade a Retirar	100
----------------------	-----

**Confirmar** **Voltar**

#### 4.2.2 Euroclear via FED

O participante solicita a retirada no sistema de garantia (NGA). É necessário preencher os campos indicados na Figura 10.

Figura 10. Tela do NGA para retirada Euroclear via FED

#### Requisição de Aceite de Retirada

<b>MC</b>	88711	TESTE CERTIFICAÇÃO RTC
<b>PNP</b>	88711	TESTE CERTIFICAÇÃO RTC
<b>CL</b>	989309	CONTA NORMAL 2687 SLF
<b>Documento</b>	880.000.002/0156-68	
<b>Tipo de Pessoa</b>	Pessoa Jurídica Não Residente Outros	
<b>Atividade</b>	60.00 - DEMAIS FUNDOS OU ENTIDADES DE INVESTIMENTO COLETIVO	
<b>Categoria</b>	CLIENTE	

<b>Tipo da Garantia</b>	9 - Título Internacional
<b>Finalidade de Cobertura</b>	1 - Garantias de Operações

<b>Número do Ativo</b>	2019000041685	
<b>Identificador da Garantia</b>	US912810EW46	
<b>Cusip</b>	912810EW4	
<b>Sub Tipo</b>	US TREASURY BONDS	
<b>Data da Negociação</b>	<input type="text" value="18/06/2019"/>	→
<b>Data de Liquidação</b>	<input type="text" value="18/06/2019"/>	→

Data de negociação e liquidação devem ser informadas pelo custodiante

<b>Depositária Origem</b>	EUROCLEAR   98606
---------------------------	-------------------

<b>Dados Destino</b>		
<b>Método</b>	<input type="text" value="via FED"/>	
<b>ABA Code</b>	<input type="text" value="021000018"/>	→
<b>Nome da Conta</b>	<input type="text" value="HSBCLDN"/>	→
<b>SubConta (Opcional)</b>	<input type="text"/>	→
<b>Conta DTCC</b>	<input type="text" value="24943"/>	→

Número ABA do custodiante - Número de 9 dígitos  
Conta do investidor abaixo da conta do custodiante  
Nome da subconta do investidor  
Número da conta do custodiante no DTCC

<b>Quantidade Depositada</b>	1.000
<b>Quantidade Distribuída</b>	0
<b>Quantidade Disponível</b>	1.000

<b>Quantidade a Retirar</b>	<input type="text" value="100"/>
-----------------------------	----------------------------------

**Confirmar****Voltar**

### 4.2.3 Euroclear via DTCC

O participante solicita a retirada no sistema de garantia (NGA). É necessário preencher os campos indicados na Figura 11.

Figura 11. Tela do NGA para retirada Euroclear via DTCC

#### Requisição de Aceite de Retirada

MC	88711	TESTE CERTIFICAÇÃO RTC
PNP	88711	TESTE CERTIFICAÇÃO RTC
CL	989309	CONTA NORMAL 2687 SLF
Documento	880.000.002/0156-68	
Tipo de Pessoa	Pessoa Jurídica Não Residente Outros	
Atividade	60.00 - DEMAIS FUNDOS OU ENTIDADES DE INVESTIMENTO COLETIVO	
Categoria	CLIENTE	

Tipo da Garantia	9 - Título Internacional
Finalidade de Cobertura	1 - Garantias de Operações

Número do Ativo	2019000041685	
Identificador da Garantia	US912810EW46	
Cusip	912810EW4	
Sub Tipo	US TREASURY BONDS	
Data da Negociação	<input type="text" value="18/06/2019"/>	→
Data de Liquidação	<input type="text" value="18/06/2019"/>	→

Data de negociação e liquidação devem ser informadas pelo custodiante

Depositária Origem	EUROCLEAR   98606
--------------------	-------------------

Dados Destino		
Método	<input type="text" value="via DTCC"/>	
Conta	<input type="text"/>	→
SubConta (Opcional)	<input type="text"/>	→

Conta do custodiante na DTC - Número até 4 dígitos

Conta do investidor abaixo da conta do custodiante

Quantidade Depositada	1.000
Quantidade Distribuída	0
Quantidade Disponível	1.000

Quantidade a Retirar	<input type="text" value="100"/>
----------------------	----------------------------------

## 5. DÓLARES NORTE-AMERICANOS COMO GARANTIA

### 5.1 Depósito

Número da conta da B3 no Citibank: 40804863

Os dólares podem ser transferidos para conta de garantias através da conta de liquidação ou através da própria conta do cliente. Para isso, os processos são diferentes, conforme mostrado nos fluxos das Figuras 12 e 13.

#### 5.1.1 Através da conta de liquidação da B3

Figura 12. Fluxo de depósito de dólares através da conta de liquidação



#### 5.1.2 Direto da conta do cliente

Figura 13. Fluxo de depósito de dólares direto da conta do cliente



O participante solicita o depósito no sistema de garantia (NGA). É necessário preencher os campos indicados na Figura 14.

Figura 14. Tela do NGA para depósito de dólares

Requisição de Aceite de Depósito

MC	53104	CLIENTE TESTE LOTE
PNP	53104	CLIENTE TESTE LOTE
CL	1502	VALIDATION TABAJARA CO.
Documento	25462.588000.126887.1.1	
Tipo de Pessoa	Pessoa Jurídica Não Residente Com CVM	
Atividade	57.00 - ENTIDADES DE PREVIDÊNCIA	
Categoria	CLIENTE	

Tipo da Garantia	Moeda Estrangeira
Finalidade de Cobertura	Garantias de Operações

Identificador da Garantia	Dólar
Número de Referência	<input type="text"/> → Número de Ref. SWIFT**
Valor	<input type="text"/>

\*\* O número de Ref. SWIFT deve ser informado pelo cliente: no **campo 20** – Sender Reference da MT103 ou no **campo 21** – Related Reference da MT202. Quando os dólares vêm da conta de liquidação, quem informa o número de Ref. SWIFT é a própria equipe de Liquidação da B3, via LNR.

#### Número de conta no Citibank

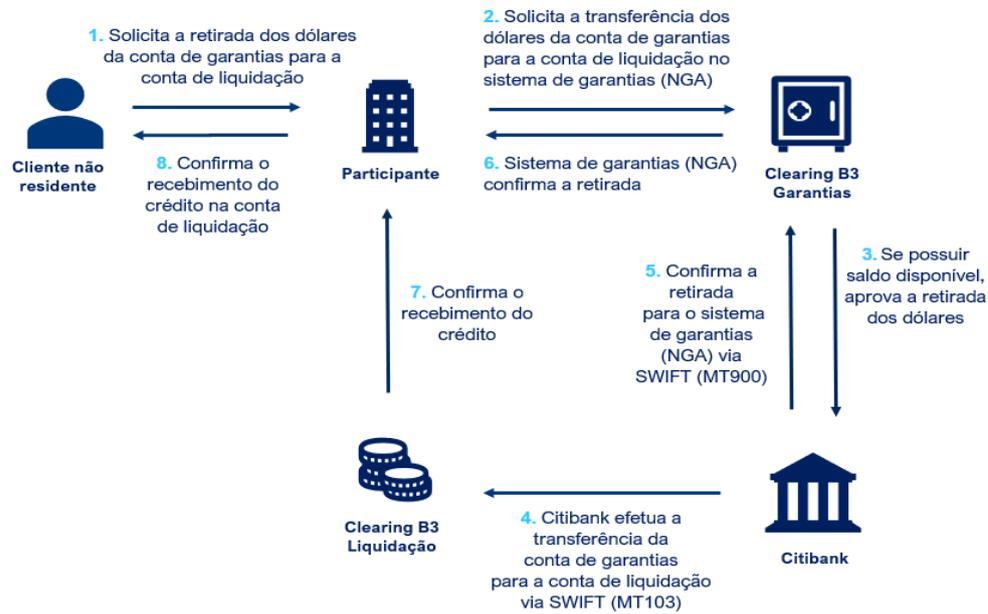
- **Conta da B3 no Citibank:** 40804863
- **Chips:** 0008
- **ABA:** 021000089
- **SWIFT:** CITIUS33

## 5.2 Retirada de garantias

Semelhante ao depósito, a retirada de dólares pode acontecer de duas formas: retirada para a conta de liquidação e retirada direto para a conta do cliente. Os fluxos estão demonstrados nas Figuras 15 e 16.

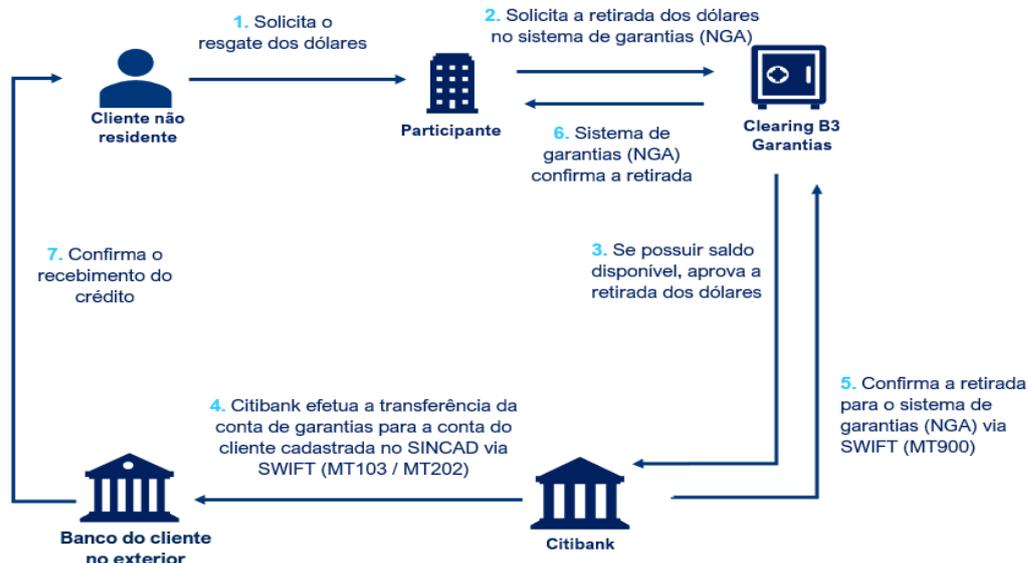
### 5.2.1 Para a conta de liquidação

Figura 15. Fluxo de retirada de dólares para a conta de liquidação



### 5.2.2 Para a conta do cliente

Figura 16. Fluxo de retirada de dólares para a conta do cliente



---

## 6. EVENTOS

### 6.1 Pagamento de cupom

Para os títulos depositados em garantia, será solicitada a retirada ou substituição em dez dias úteis antes do pagamento de cupom ou vencimento a contar do record date.

### 6.2 Vencimento

A B3 não autoriza o depósito de garantias que irão pagar cupom ou vencer nos próximos dez dias úteis a contar do record date.

## 7. PRECIFICAÇÃO

É publicado no site da B3 ([www.b3.com.br/pt\\_br/produtos-e-servicos/compensacao-e-liquidacao/clearing/administracao-de-riscos/garantias/garantias-aceitas/](http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/compensacao-e-liquidacao/clearing/administracao-de-riscos/garantias/garantias-aceitas/)) uma lista com os colaterais aceitos em garantias. Se o ISIN do título internacional escolhido para depósito não estiver na lista, deve-se informar a equipe de Garantias da B3 para que seja realizado o cadastro. A solicitação precisa ser feita com antecedência, pois a valorização do ativo acontece em D+1.

## 8. CUSTOS

Os custos da B3 cobrados pela DTCC e Euroclear pela custódia de ativos são compartilhados proporcionalmente pelos participantes da B3 que solicitam esse serviço e podem transferir esses custos para o investidor.

## 9. FAZER/NÃO FAZER

### 9.1 Fazer

- Retirar o título antes do vencimento e antes de pagar cupom.
- Antes de realizar o depósito na depositária (DTCC/Euroclear), consultar junto à B3 por meio da corretora representante se o ativo é aceito como garantia.
- Sempre informar o código de referência SWIFT para a corretora representante no Brasil ao realizar um depósito em dólares.

### 9.2 Não fazer

- Não depositar títulos em D-10 antes do vencimento/cupom.
- Não instruir o depósito (delivery free) antes de verificar se o ISIN é elegível como colateral na B3.

### Nossos contatos

E-mail: [garantias@b3.com.br](mailto:garantias@b3.com.br)

Telefone: +55(11) 2565-5032