

MANUAL DE OPERAÇÕES GESTÃO DE COLATERAL

CONTEÚDO

| | | |
|----------|--|-----------|
| 1 | ATUALIZAÇÕES DA VERSÃO | 3 |
| 2 | INTRODUÇÃO À GESTÃO DE COLATERAL | 4 |
| 2.1 | Conhecendo o Produto | 4 |
| 2.2 | Utilização do serviço | 4 |
| 2.3 | Critérios de Elegibilidade | 4 |
| 2.4 | Definições Relevantes | 7 |
| 2.5 | Conceitos | 8 |
| 2.6 | Relação dos Ativos Elegíveis..... | 9 |
| 2.7 | Tratamento de Eventos Corporativos | 9 |
| 2.8 | Ações dos botões das telas | 10 |
| 2.9 | Acesso ao Módulo de Gestão de Colateral | 10 |
| 3 | REGISTROS..... | 12 |
| 3.1 | Solicitação de Transferência de Ativos (Cetip) | 12 |
| 3.2 | Solicitação de Transferência de Ativos (Selic)..... | 13 |
| 3.3 | Solicitação de Transferência (Garantias em Dinheiro) | 14 |
| 3.4 | Solicitação de Retirada de Ativos (Cetip) | 15 |
| 3.5 | Solicitação de Retirada de Ativos (Selic) | 16 |
| 3.6 | Solicitação de Retirada (Garantias em Dinheiro)..... | 17 |
| 4 | CETIP COLATERAL | 19 |
| 4.1 | Introdução | 19 |
| 5 | ACESSO AO CETIP COLATERAL | 19 |
| 5.1 | Ativação de usuários..... | 19 |
| 5.2 | Primeiro Acesso ao Sistema | 20 |
| 5.3 | Acesso Diário | 23 |
| 6 | GESTÃO DE USUÁRIOS..... | 25 |
| 7 | GESTÃO DE COLATERAL..... | 27 |
| 7.1 | Seção 1: Listas de Pendências | 29 |
| 7.1.1 | Resumo das Informações Diárias..... | 29 |
| 7.2 | Seção 2: Dados do Contrato | 29 |
| 7.2.1 | Contratos | 29 |
| 7.3 | Seção 3: Colateral..... | 30 |
| 7.3.1 | Exposições de colateral..... | 30 |
| 7.3.2 | Volume em dinheiro | 33 |
| 7.3.3 | Quantidade de ativo em garantia..... | 34 |
| 7.3.4 | Conta Alocação..... | 34 |
| 7.3.5 | Verificação de Elegibilidade..... | 36 |
| 7.4 | Seção 4: Instruções | 36 |
| 7.4.1 | Gestão de Colateral | 36 |
| 7.4.2 | Instruções Enviadas..... | 37 |
| 7.4.3 | Upload de Arquivo de Instruções..... | 38 |
| 7.5 | Seção 6: Relatórios | 38 |
| 7.5.1 | Relatórios sob Demanda | 38 |
| 7.5.2 | Relatórios Gerenciais..... | 38 |
| 7.6 | Seção 7: Ferramentas..... | 39 |
| 7.6.1 | Simulação Estendida | 39 |
| 7.6.2 | Simulação em Tempo Real | 39 |
| 8 | GESTÃO DE COLATERAL - CONFIGURAÇÕES | 39 |
| 8.1 | Seção 1: Dados do Contrato..... | 39 |
| 8.1.1 | Informação das garantias aceitas..... | 39 |
| 8.1.2 | Exclusão de ativos | 40 |
| 8.1.3 | Participantes | 40 |
| 8.2 | Seção 2: Títulos Elegíveis..... | 41 |
| 8.2.1 | Títulos | 41 |
| 8.3 | Seção 3: Emissores | 41 |
| 8.3.1 | Emissores | 41 |
| 8.3.2 | Perfil do Usuário | 42 |
| 9 | TRATAMENTO PARA LIBERAÇÃO DE GARANTIAS | 44 |

1 ATUALIZAÇÕES DA VERSÃO

| Versão | Atualizado em | Referência | Atualização |
|------------|---------------|--|--|
| 18/07/2011 | 21/07/2017 | Em todo manual | Atualização do documento devido a interface do Cetip Colateral |
| 18/07/2011 | 21/07/2017 | Tratamento para liberação de garantias | Melhoria da descrição do item IV em “Critérios de Elegibilidade” |
| 18/07/2011 | 03/07/2017 | Tratamento para liberação de garantias | Melhoria da descrição das tabelas dos itens 1.2.1 e 1.2.2. |
| 18/07/2011 | 25/11/2016 | Em todo manual | Atualização do documento devido ao lançamento da nova interface do Cetip Colateral |
| 18/07/2011 | 12/08/2016 | Tratamento para liberação de garantias | Atualização do texto. |
| 18/07/2011 | 18/05/2016 | Tratamento para liberação de garantias | Atualização das informações no tópico. |
| 18/07/2011 | 06/05/2016 | Critérios de Elegibilidade | Alteração na descrição do texto sobre Exposição. |
| 18/07/2011 | 26/10/2015 | Em todo o manual | Formatação das tabelas. |
| 18/07/2011 | 28/09/2015 | Em todo o manual | Atualização do documento, maior detalhamento dos processos. |
| 18/07/2011 | 03/12/2014 | Diversas Funções | Atualização de telas devido a novo layout. |
| 18/07/2011 | 31/10/2014 | Atualizações da Versão | Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais nova para a mais antiga. |
| 18/07/2011 | 22/09/2014 | Em todo o manual | Arrumação das funções conforme estão no NoMe e o caminho completo; e Nas descrições dos campos, inclusão da informação se o preenchimento é obrigatório ou não. |
| 18/07/2011 | 03/07/2013 | Solicitação de Retirada de Ativos (SELIC) | Mudança na descrição do campo de “Conta SELIC (conta cessão fiduciária com interveniente)” para “Conta SELIC (conta cessão fiduciária ALOCAÇÃO)”. |
| 18/07/2011 | 03/07/2013 | Solicitação de Transferência de Ativos (SELIC) | Mudança na descrição do campo de “Conta SELIC (conta cessão fiduciária com interveniente)” para “Conta SELIC (conta cessão fiduciária ALOCAÇÃO)”. |

2 INTRODUÇÃO À GESTÃO DE COLATERAL

2.1 Conhecendo o Produto

O Cetip|Colateral, módulo de Gestão de Colateral, oferece ferramentas de administração de garantias em relações bilaterais possibilitando, assim, a mitigação de risco para operações no âmbito do mercado financeiro ou de capitais, brasileiro ou internacional, em conformidade com a legislação que lhe é aplicável. Também contempla operações de derivativos registradas no mercado de balcão, por meio de modelo e tecnologia amplamente difundida nos mercados internacionais para administração de ativos entregues como garantia. O regime legal aplicado na constituição das garantias é a alienação fiduciária e/ou cessão fiduciária.

Para se tornar usuário do módulo de gestão de colateral, o participante deve formalizar seu pedido para que sejam tomadas as providências de criação de login e geração de senhas.

Pelo seu alto nível de automação, o Cetip|Colateral elimina em grande parte a movimentação manual de ativos usados como garantia, contribuindo assim para eficiência operacional dos usuários além de agregar segurança ao processo de transferência das garantias.

O Cetip|Colateral possibilita às partes envolvidas nas operações a fixação de uma série de parâmetros com aplicações individualizadas, o que pode contribuir para o desenvolvimento do mercado com muito mais segurança.

2.2 Utilização do serviço

Podem ser usuários do sistema Cetip | Colateral, todos os participantes autorizados a atuar na Cetip que atendam aos pré-requisitos indicados no Manual de Normas – Gestão de Garantias. Porém, para se tornar usuário do módulo de gestão de colateral, o participante deve formalizar seu pedido junto a Cetip preenchendo os formulários disponíveis no site www.cetip.com.br/ProdutosServicos/UnidadeTitulos/GestaoDeRisco-CetipColateral.

Após preenchimento e assinatura das pessoas autorizadas, os formulários deverão ser enviados para a Cetip, que efetuará o cadastramento da nova conta.

Após a criação das contas, o Participante receberá dois usuários administradores com certificados e senhas provisórios que permitirão o primeiro acesso ao Cetip | Colateral. Todo o procedimento de acesso ao sistema está descrito neste manual, no item Administração de Usuários.

Para o cadastramento de seus clientes no sistema Cetip | Colateral, o participante deverá realizar procedimento descrito neste manual, no item Gestão de Usuários.

2.3 Critérios de Elegibilidade

Uma das principais ferramentas que o sistema de gestão de colateral oferece é a possibilidade de aplicação de diferentes parâmetros que servirão de base para o sistema administrar ativos em garantia. Os principais Critérios de Elegibilidade são:

- Valor independente: pode ser estabelecido um valor mínimo a ser colateralizado.
- Threshold: estabelece um limite para a falta de colateral, que precisa ser atingido antes de disparar o processo automático de alocação de colateral.

- Montante Mínimo de Transferência: estabelece um valor mínimo para que seja transferido o valor de colateral para a conta do garantido, caso exista valor de exposição a ser coberto. Tal limite é aplicado somente para a Alocação automática de colateral.
- Tratamento diferenciado para um ativo específico: é possível adicionar limites de concentração por tipo de ativo.
- Tratamento diferenciado para Emissores: poderão ser incluídos e/ou excluídos emissões ou emissores específicos para o aceite do colateral.
- Aplicação de deságio: é possível marcar os ratings elegíveis e indicar uma margem (em %) e estabelecer o tempo máximo de vencimento para o título a ser entregue.

Para definição destes parâmetros, os Participantes da relação bilateral devem preencher o Formulário de Elegibilidade de acordo com os critérios de elegibilidade definidos no Instrumento. O Formulário está disponível no site da Cetip em www.cetip.com.br/ProdutosServicos/UnidadeTitulos/GestaoDeRisco-CetipColateral.

Neste documento, deverão ser preenchidas as seguintes informações:

I. Identificação das Contrapartes

Identifica o nome (ou razão social), bem como o CNPJ (ou CPF), o endereço e o número da conta Cetip das partes envolvidas no contrato de colateral. Preenchimento obrigatório.

II. Definição do Garantidor

Indica a(s) parte(s) que atuará(ão) como Garantidora no contrato. É possível definir que apenas uma ou ambas as partes entregarão garantias. Apenas uma das opções deverá ser escolhida. Preenchimento obrigatório.

III. Notificação de Exposição

Estabelece a forma em que a alteração da exposição será realizada: através de notificação bilateral (duplo comando) ou unilateral (indicando qual das partes será responsável pela inserção da informação no sistema). Apenas uma das opções deverá ser escolhida. Preenchimento obrigatório.

IV. Parâmetros de Risco das Contrapartes

Caso o contrato tenha previsão de entrega de Valor Independente, nesta seção é possível indicar qual é o valor no campo apropriado. Caso contrário deixar os campos em branco. Da mesma forma, se houver previsão de adoção de *Threshold* indicar qual o valor (ou se for o caso, o percentual de excesso ou de déficit a ser aplicado sobre o valor da exposição). Indicar somente uma das alternativas (valor ou percentual). Não há obrigatoriedade de preenchimento destas informações.

V. Critérios de Elegibilidade

Estabelece as regras para apropriação de garantias. No item tipo de emissor (público ou privado) é possível restringir as garantias elegíveis como apenas títulos públicos, apenas privados, ou ambos. As regras definidas aqui servirão como parâmetro para que o sistema realize as alocações necessárias, ou seja, serão apropriadas apenas garantias que atendam aos critérios aqui definidos. Preenchimento obrigatório.

VI. Emissores/Emissões Específicas

Neste ponto, como o próprio nome diz, é possível incluir ou excluir emissores (através da razão social) ou emissões (através do código ISIN) específicas da lista de ativos elegíveis para a relação bilateral em questão, bem como os respectivos deságios dos ativos incluídos. Excluir um emissor indica que nenhum ativo deste será aceito. Por outro lado, incluir um emissor indica que apenas ativos dele serão aceitos como garantia. Incluir uma emissão significa que apenas aquele ativo será aceito em garantia. Não há obrigatoriedade de preenchimento destas informações.

VII. Rating do Ativo/Emissor

Aqui é possível indicar, no caso do *rating* do ativo não estiver disponível, se o sistema deve utilizar o rating do emissor ou não. O padrão é utilizar o *rating* do emissor. Preenchimento obrigatório.

VIII. Método de Avaliação

Nesta seção é possível definir a metodologia de cálculo para a aplicação de deságio sobre os ativos entregues em garantia. Existem duas opções: método europeu e método americano. Por padrão, o sistema é configurado com o método europeu, sendo possível alterar esta configuração simplesmente marcando a outra opção. Preenchimento obrigatório.

IX. Precificação

Indica que serão utilizados os preços acruados (preço sujo) para calcular o valor do colateral. Não existe preenchimento a ser realizado.

X. Valor Mínimo da Transferência

Estabelece o valor mínimo de garantias que o sistema irá movimentar no processo de alocação. Se deixado em branco, entende-se que qualquer valor pode ser movimentado.

XI. Moeda como Colateral

Este campo indica que, no caso de depósito de dinheiro como garantia, apenas poderá ser utilizado o Real Brasileiro. Não existe preenchimento a ser realizado.

XII. Ratings de Crédito

Nesta seção devem-se indicar os percentuais de deságio a serem aplicados sobre os títulos (de acordo com o rating de crédito), se aplicável. Não há obrigatoriedade de preenchimento destas informações.

XIII. Deságio Variável por Data da Cotação

Aqui é possível aplicar deságio adicional de acordo com a quantidade de dias em que não haja atualização do preço do ativo. Também é possível indicar a quantidade máxima de dias - sem atualização do preço a partir do qual o ativo torna-se inelegível. Não há obrigatoriedade de preenchimento destas informações.

XIV. Limites de Concentração por rating e crédito

Estabelece limites de concentração para ativos e emissores, de acordo com ratings de crédito. Não há obrigatoriedade de preenchimento destas informações.

XV. Concentração por tipo de emissor

Caso os participantes desejem estabelecer limite de concentração por tipo de emissor (público ou privado), a indicação desses limites deve ser feita aqui. Não há obrigatoriedade de preenchimento destas informações.

2.4 Definições Relevantes

Algumas definições devem ser apresentadas para garantir a correta compreensão dos pontos desse documento. A tabela abaixo apresenta tais definições.

| | |
|--|--|
| Agente de Cálculo | A Cetip ou o(s) Participante(s) designado(s) pelas partes do Instrumento para identificar, mediante utilização de modelos de apreçamento, os valores das Operações, nas datas estabelecidas no correspondente Instrumento, para efeito de apurar o valor de eventual Exposição, bem como registrar esse valor, seu credor e seu devedor no Módulo de Gestão de Garantias. |
| Ativos Elegíveis | Os Ativos Elegíveis na Cetip, a Moeda Nacional, e/ou os Títulos Públicos Elegíveis no SELIC. |
| Instrumento de Prestação de Garantias (“Instrumento”) | O documento em que as partes estipulam os termos aplicáveis à prestação de garantias das Operações Garantidas. |
| Conta Livre | Conta Própria ou de Cliente de titularidade do Participante Cetip |
| Conta Alocação (conta tipo 62) | Conta na Cetip, de titularidade de Participante, destinada ao registro dos Ativos Elegíveis na Cetip e à representação da Moeda Nacional e dos Títulos Públicos Elegíveis no SELIC pertencentes ao Participante. |
| Conta Garantia ou Conta Colateral (conta tipo 64) | A Conta na Cetip, de titularidade de Participante, destinada ao registro das Garantias na Cetip e à representação da Garantia em Moeda Nacional e das Garantias no SELIC que esse Participante receba, por meio de Gestão de Garantias, de outro Participante ou de Cliente com o qual tenha firmado Instrumento. Neste manual a Conta Garantia poderá estar identificada como conta colateral em algumas situações. |
| Conta Cessão Fiduciária Alocação com Interviente Cetip (“Conta SELIC Alocação”) | Conta aberta pela Cetip no SELIC, individualizada por Participante e/ou por Cliente, destinada ao registro dos Títulos Públicos Elegíveis no SELIC pertencentes ao Participante, e/ou aos seus Clientes. |
| Conta Cessão Fiduciária Garantia com Interviente Cetip (“Conta SELIC Garantia”) | Conta aberta pela Cetip no SELIC, individualizada por Participante e/ou por Cliente, destinada ao registro das Garantias no SELIC que esses venham a receber. |
| Exposição | Valor financeiro apurado por Agente de Cálculo que deve ser garantido na forma prevista no Instrumento. |
| Operações de Derivativos | O <i>swap</i> , o <i>termo</i> , a <i>opção</i> e/ou qualquer outra modalidade de operação de derivativos celebrada pelas partes do Instrumento na forma da regulamentação em vigor. |
| Unidade Organizacional (OU) | É o participante Cetip. A sua criação é o passo inicial para utilização do Cetip Colateral, com a atribuição de número e nome de identificação. Paralelamente, são gerados os usuários administradores e suas senhas de acesso. Os administradores, por sua vez, têm poderes para criar os usuários finais do sistema. |
| Critério de Elegibilidade | O critério de composição de Garantias determinado no Instrumento. |

2.5 Conceitos

Processo de Auto-alocação

Os ativos que serão oferecidos em garantia devem ser disponibilizados na conta Alocação do garantidor, a partir da qual os ativos são transferidos automaticamente para a conta Garantia do favorecido de acordo com a necessidade, onde ficam bloqueados. A base para as transferências são os valores das exposições informadas. Neste caso, ocorre o disparo automático da auto-alocação, ou seja, é realizada a transferência da quantidade necessária de ativos da conta Alocação (na Cetip, tipo de conta 62) para a conta Garantia (na Cetip, tipo de conta 64). O processo de auto-alocação visa a otimização do uso de colateral e ocorrerá com uma frequência de até 15 minutos.

Processo de Auto-retirada

Se a exposição for menor do que o valor das Garantias na Conta Colateral, ocorre o disparo da auto-retirada, ou seja, ocorre a movimentação da quantidade excedente na conta Garantia de volta para a conta Alocação.

Os processos de auto-alocação e auto-retirada podem ser desabilitados, caso as partes entendam que o sistema não deve realizar movimentações automáticas. Desta maneira, a movimentação de garantias passa a ser realizada exclusivamente mediante a mudança de exposição da relação bilateral.

Processo de Substituição

Se um ativo utilizado como colateral for requerido pelo garantidor, o sistema de gestão de colateral irá automaticamente tentar substituir por outro ativo elegível (seguindo os parâmetros definidos no formulário de elegibilidade) disponível na conta Alocação e, após esta alocação, autorizará a retirada do ativo requerido.

Processo de Valoração

Os preços atribuídos aos ativos depositados como colateral são os preços de mercado fornecidos por provedores de informações financeiras (preços de mercado), ou os calculados pela Cetip (preços teóricos).

A metodologia de apreçamento dos Ativos Elegíveis a serem entregues como Garantia ou liberados para o Garantidor encontra-se disponível para consulta no site da Cetip (www.cetip.com.br), na seção “Produtos e Serviços / Gestão de Risco / Cetip | Colateral / Metodologia Cetip de Marcação a Mercado”.

2.6 Relação dos Ativos Elegíveis

Podem ser oferecidos em garantia títulos privados que estejam custodiados na Cetip e títulos públicos federais custodiados no SELIC, conforme quadro abaixo:

| | |
|---|--|
| <p>Ativos custodiados na Cetip</p> | <ul style="list-style-type: none"> • Debênture • CDB – Certificados de Depósito Bancário • DI – Depósito Interfinanceiro • Letras Financeiras • Outros Ativos Sob Consulta <p>O código de identificação dos ativos elegíveis a ser utilizado é o ISIN (código internacionalmente utilizado inclusive no Brasil). Caso o ativo atenda a esse requisito, mas não esteja cadastrado no sistema de gestão de colateral, o participante deve entrar em contato com a Gerência de Garantias e solicitar a avaliação do cadastramento.</p> |
| <p>Ativos Custodiados no SELIC</p> | <p>A maioria dos títulos públicos federais é cadastrada automaticamente como elegível. Todavia, para utilizá-los os investidores devem ter aberta a conta de cessão fiduciária com interveniente, na qual a Cetip atua como o interveniente. Para ter a conta de cessão fiduciária com interveniente aberta, um pedido formal é encaminhado à Cetip, conforme modelo disponível no site www.cetip.com.br – Produtos e Serviços – Gestão de Colateral. A Cetip é quem conduz o processo de abertura.</p> |
| <p>Garantia em Moeda</p> | <p>É oferecida também a possibilidade de se entregar dinheiro como garantia. Neste caso o participante utiliza funcionalidade própria para solicitar o depósito, o que gera um débito no financeiro do participante que, uma vez liquidado, é disponibilizado para alocação. O dinheiro será mantido em uma conta segregada junto ao banco liquidante da Cetip.</p> |

2.7 Tratamento de Eventos Corporativos

A Cetip faz o controle dos eventos de custódia dos ativos entregues em garantia, inclusive daqueles custodiados no SELIC, aplicando o seguinte tratamento em cada um dos casos:

Juros, Amortizações e demais eventos (exceto resgate):

- Se o ativo estiver depositado em conta Alocação (conta tipo 62), ou seja, quando o ativo ainda não foi transferido para a conta Colateral, o beneficiário será o titular da conta e o respectivo valor será transferido por meio de crédito via janela de liquidação.
- Se o ativo estiver depositado em conta colateral (conta tipo 64) o beneficiário será aquele que entregou a garantia (titular da conta Alocação tipo 62) e o respectivo valor será transferido por meio de crédito via janela de liquidação.

Resgate ou vencimento de ativos:

- Se o ativo estiver depositado em conta Alocação (conta tipo 62), ou seja, quando ainda não foi transferido para a conta Colateral, o valor recebido pela Cetip será entregue ao titular da conta por meio de crédito via janela de liquidação.
- Se o ativo estiver depositado na conta Colateral (conta tipo 64) o valor do ativo recebido pela Cetip será posicionado como garantia, em substituição ao ativo vencido.

A Cetip recomenda a substituição dos títulos entregues em garantias antes do vencimento, pois nesse processo o ativo é transformado em dinheiro, não havendo nenhum tipo de correção monetária no período em que estiver alocado.

2.8 Ações dos botões das telas

Os botões das telas exibidas ao longo do manual estão relacionados às seguintes ações:

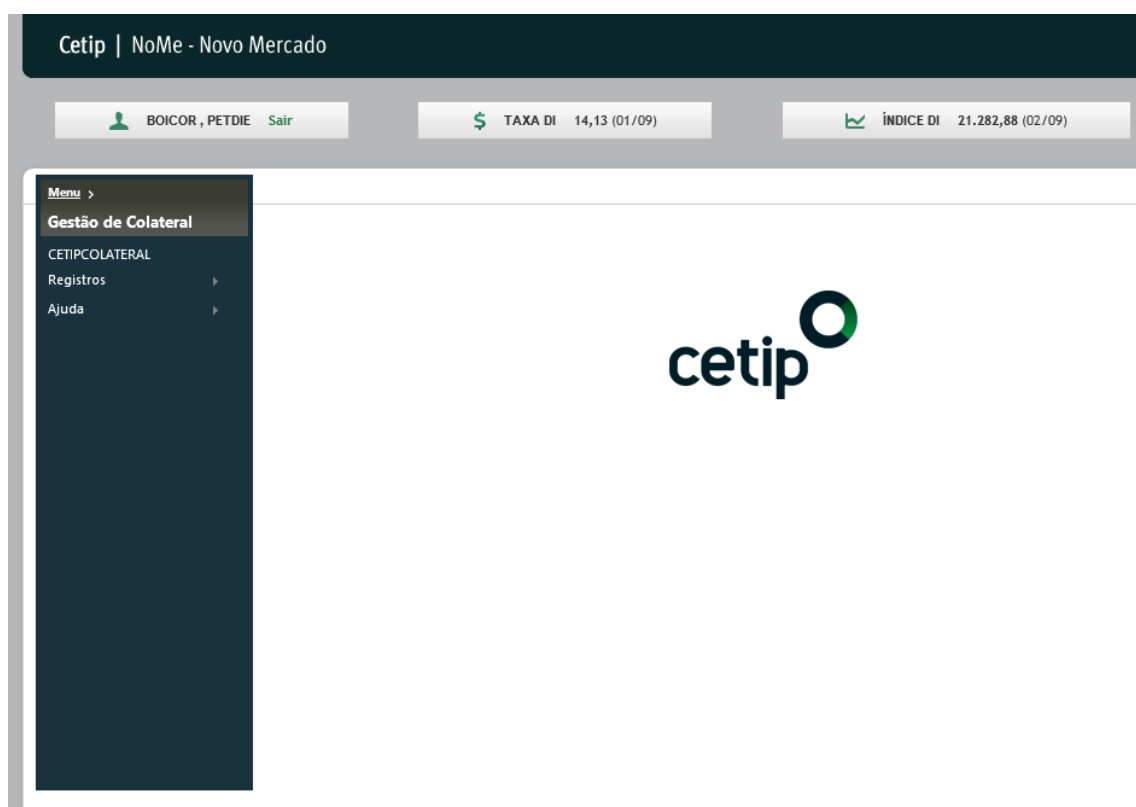
| Botão | Funcionalidade |
|---------------|--|
| Enviar | Processa as informações, levando para a tela de confirmação. |
| Limpar Campos | Limpa os campos já preenchidos. |
| Desistir | Não processa as informações, saindo da tela e voltando à página do NoMe. |
| Prosseguir | Prossegue com a ação indicada na tela. |
| Pesquisar | Realiza pesquisa de acordo com dados inseridos na tela filtro. |
| Voltar | Volta à tela anterior com os últimos dados digitados. |
| Confirmar | Confirma os dados apresentados em tela. |
| Corrigir | Retorna à tela anterior com os dados editados para possível correção. |
| Atualizar | Reexecuta a consulta a partir dos filtros informados na tela de filtro. |

2.9 Acesso ao Módulo de Gestão de Colateral

O acesso ao módulo “Gestão de Colateral” se dá através do no NoMe – Novo Mercado, conforme indicado abaixo.

Digite em seu browser o endereço: <https://nome.cetip.net.br/>

The screenshot shows the Cetip NoMe - Novo Mercado interface. At the top, there is a header with the logo and navigation links. Below the header, there are several status bars displaying information such as 'CETIP, CAROLC Sair', 'TAXA DI 14,13 (01/09)', 'ÍNDICE DI 21.282,88 (02/09)', and 'HORÁRIO 16:28:03'. The main content area is titled 'PRODUÇÃO' and features a table with the following columns: URL, Data/Hora criação, Data início, Data fim, Conta Participante, Front Office, and Back Office. A single row of data is visible in the table. Below the table, there is an 'Atualizar' button. On the left side, a dark sidebar menu is open, with 'Gestão de Colateral' highlighted in green.



No menu do módulo de Gestão de Colateral, serão apresentadas as opções de seleção citadas abaixo.

| Opções | Descrição |
|-------------------|--|
| Registros | Permite ao Participante efetuar as transferências dos ativos elegíveis para conta alocação, solicitar a retirada dos ativos disponíveis da alocação para a conta própria ou ainda, solicitar a substituição de ativo entregue em garantia. |
| Cetip Colateral | Permite ao Participante o acesso a todas as informações relativas às alocações de colateral e também o lançamento das exposições a serem cobertas. |
| Ajuda | Documento com maiores esclarecimentos. |

Para ter acesso às opções das funções “Cetip | Colateral” e “Registro”, há a necessidade de cadastramento prévio do participante e das contas dos clientes do participante. Este processo é feito pela Cetip mediante solicitação formal do participante. Os modelos das cartas de solicitação estão disponíveis no site da Cetip (www.cetip.com.br), conforme indicado abaixo. O processo completo se dá com o cumprimento das seguintes etapas:

| Ação | Responsabilidade | Observação |
|--|------------------|---|
| Enviar correspondência Específica | Participante | A correspondência encontra-se disponível no site da Cetip (www.cetip.com.br), menu Produtos e Serviços, item Gestão de Colateral. |
| Criação das contas 62, 64 e UO. | Cetip | A conta Garantia (64), conta Alocação (62) e a Unidade Organizacional é criada pela Cetip sob a responsabilidade do administrador de segurança Cetip. |
| Associação de permissão | Cetip | O administrador de permissão Cetip associa a Unidade Organizacional ao Participante. |
| Envio de dois usuários administradores | Cetip | Envio de certificados de administrador e senhas provisórios ao Participante que permitirão o acesso ao Cetip Colateral. |

| | | |
|---|--------------|--|
| Geração dos Certificados | Participante | O primeiro acesso ao Módulo Cetip Colateral deverá ser realizado utilizando a senha fornecida ao Participante pela Cetip. Esta senha, que é temporária, deverá ser alterada no primeiro acesso ao sistema. Nota: A nova senha deverá conter entre 8 e 24 caracteres, e deve conter três dos quatro itens a seguir: pontuação (inclusive caracteres especiais), números, letras maiúsculas e letras minúsculas. Deverá ainda ser diferente das senhas armazenadas no histórico do usuário. |
| Criação de Usuários e Grupo de Usuários | Participante | No momento do primeiro acesso ao Módulo Cetip Colateral, o Participante deve cadastrar todos os usuários (administradores ou de negócios) que utilizarão o mesmo. |
| Navegação e Utilização do Cetip Colateral | Participante | Depois de cumpridas as etapas anteriores, o participante Cetip pode se conectar ao Cetip Colateral. |

3 REGISTROS

3.1 Solicitação de Transferência de Ativos (Cetip)

Caminho: Gestão de Colateral > Registros > Solicitação de Transferência > Ativos Cetip

Visão Geral

Por meio dessa função o Participante comanda a transferência de ativos Cetip de sua Conta Própria ou Conta Cliente para a Conta Alocação. A conta Alocação é de titularidade do Participante Cetip e é utilizada exclusivamente para receber os ativos que poderão ser utilizados no processo automatizado de alocação de garantias.

Tela Solicitação de Transferência > Ativos Cetip

Solicitação de Transferência de Ativos (Cetip)

Solicitante (Conta)

CPF/CNPJ Solicitante

Código do IF

Quantidade

Descrição dos campos da Tela de Solicitação de Transferência de Ativos (Cetip)

| Campo | Descrição |
|----------------------|---|
| Solicitante (Conta) | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código Cetip do solicitante. |
| CPF/CNPJ Solicitante | Identificação do comitente. Não é necessário o preenchimento do campo caso da solicitação seja efetuada pela conta própria do Participante. Caso a conta do solicitante seja uma conta cliente (10 ou 20), é necessário o preenchimento do campo “CPF/CNPJ”. |
| Código do IF | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código do instrumento financeiro do título Cetip. |
| Quantidade | Campo de Preenchimento Obrigatório. Quantidade de ativo a ser transferido. |

Tela de Confirmação para Transferência de Ativo Cetip

Solicitação de Transferência de Ativos (Cetip)

Solicitante (Conta) 05000.00-5
 Solicitante (Nome Simplificado) RIOBM
 Solicitante (Conta Pool) 05000.62-7
 Solicitante (CLS) C0500
 CPF/CNPJ Solicitante
 Nome/Razão Social Comitente
 Código do IF LF0013000TF
 Código ISIN BRAAAAABBBBCM6
 Quantidade 1,00000000

Após a confirmação é enviada a mensagem informando o número da operação de transferência. Exemplo: Operação 2011060711210956 efetuada.

3.2 Solicitação de Transferência de Ativos (Selic)

Caminho: Gestão de Colateral > Registros > Solicitação de Transferência > Ativos Selic

Visão Geral

Nesta função o Participante comanda a transferência de ativos públicos de sua Conta Própria no SELIC para a Conta Alocação (conta de cessão fiduciária com interveniente). A conta Alocação é de titularidade do Participante Cetip e é utilizada exclusivamente para receber os ativos que poderão de ser utilizados no processo automatizado de alocação de garantias.

Tela Solicitação de Transferência > Ativos Selic

Solicitação de Transferência de Ativos (Selic)

Solicitante (Conta)

CPF/CNPJ Solicitante

Código do IF

Quantidade

Conta Selic

Número da Operação Selic

Descrição dos campos da Tela de Solicitação de Transferência de Ativos (Selic)

| Campo | Descrição |
|--|--|
| Solicitante (Conta) | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código Cetip do solicitante. |
| CPF/CNPJ Solicitante | Identificação do comitente. Não é necessário o preenchimento do campo caso da solicitação seja efetuada pela conta própria do Participante. Caso a conta do solicitante seja uma conta cliente (10 ou 20), é necessário o preenchimento do campo “CPF/CNPJ”. |
| Código do IF | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código do instrumento financeiro do título SELIC. O código IF é representado pelo código SELIC do ativo mais a sua data de vencimento (formato: aaaammdd). |
| Quantidade | Campo de Preenchimento Obrigatório. Quantidade de ativo a ser transferido. |
| Conta SELIC (conta cessão fiduciária alocação) | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código da conta SELIC do participante solicitante. |
| Número da Operação SELIC | Campo de Preenchimento Obrigatório. Informar o número de comando para operação de transferência. |

Tela de Confirmação para Transferência de Ativo SELIC

Solicitação de Transferência de Ativos (Selic)

Solicitante (Conta) 05000.00-5
 Solicitante (Nome Simplificado) RIOBM
 Solicitante (Conta Pool) 00001489-2
 Solicitante (CLS) C0500
 CPF/CNPJ Solicitante
 Nome/Razão Social Comitente
 Código do IF 23547820150504
 Código ISIN BRSTNCLF0RS2
 Quantidade 1,00000000

Após a confirmação é enviada a mensagem informando o número da operação de transferência. Exemplo: Operação 2011060711210976 efetuada.

Além disso, para concluir a movimentação, é necessário que o participante envie uma mensagem do tipo SEL1063 no ambiente do Selic. O preenchimento da mensagem, bem como o funcionamento do sistema Selic, pode ser obtido no manual do usuário do Selic.

3.3 Solicitação de Transferência (Garantias em Dinheiro)

Caminho: Gestão de Colateral > Registros > Solicitação de Transferência > Garantias em Dinheiro

Visão Geral

A função permite ao Participante Cetip, interessado em utilizar dinheiro em garantias, efetivar o depósito na Conta de liquidação da Cetip. O Envio dos recursos, solicitado por esta função, ocorrerá por meio do Sistema de Transferência de Reserva (STR).

Tela Garantias em Dinheiro

Depósito de Garantias em Dinheiro

Solicitante (Conta) 05000.00.5

CPF/CNPJ Solicitante

Valor Financeiro Depósito 1000,00

Enviar Limpar Campos Desistir

Descrição dos campos da Tela de Solicitação de Transferência (Garantias em Dinheiro)

| Campo | Descrição |
|---------------------------|--|
| Solicitante (Conta) | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código Cetip do solicitante. |
| CPF/CNPJ Solicitante | Identificação do comitente. Não é necessário o preenchimento do campo caso da solicitação seja efetuada pela conta própria do Participante. Caso a conta do solicitante seja uma conta cliente (10 ou 20), é necessário o preenchimento do campo "CPF/CNPJ". |
| Valor Financeiro Depósito | Campo de Preenchimento Obrigatório. Valor desejado de transferência. |

Tela de Confirmação para Transferência de Garantias em Dinheiro

Depósito de Garantias em Dinheiro

Solicitante (Conta) 05000.00-5

Solicitante (Nome Simplificado) RIOBM

Solicitante (Conta Pool) 05000.62-7

Solicitante (CLS) C0500

CPF/CNPJ Solicitante

Nome/Razão Social Comitente

Valor Financeiro Depósito 1.000,00

Confirmar Corrigir Desistir

3.4 Solicitação de Retirada de Ativos (Cetip)

Caminho: Gestão de Colateral > Registros > Solicitação de Retirada > Ativos Cetip

Visão Geral

A função permite ao Participante solicitar a retirada de ativos Cetip de sua Conta Alocação para a Conta Própria ou Conta Cliente. A função também permite a requisição de devolução de ativos entregues em garantia. Neste caso os ativos somente serão devolvidos se houver outros ativos elegíveis disponíveis na conta Alocação.

Tela Solicitação de Retirada de Ativos Cetip

Solicitação de Retirada de Ativos (Cetip)

Solicitante (Conta) 05000.00.5

CPF/CNPJ Solicitante

Código do IF CDB014HCKHW

Quantidade 1,00

Enviar Limpar Campos Desistir

Descrição dos campos da Tela de Solicitação de Retirada de Ativos (Cetip)

| Campo | Descrição |
|----------------------|--|
| Solicitante (Conta) | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código Cetip do solicitante. |
| CPF/CNPJ Solicitante | Identificação do comitente. Não é necessário o preenchimento do campo caso da solicitação seja efetuada pela conta própria do Participante. Caso a conta do solicitante seja uma conta cliente (10 ou 20), é necessário o preenchimento do campo “CPF/CNPJ”. |
| Código do IF | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código do instrumento financeiro do título Cetip. |
| Quantidade | Campo de Preenchimento Obrigatório. Quantidade de ativo a ser retirado. |

Tela de Confirmação de retirada de Ativo Cetip**Solicitação de Retirada de Ativos (Cetip)**

Solicitante (Conta) 05000.00-5
 Solicitante (Nome Simplificado) RIOBM
 Solicitante (Conta Pool) 05000.62-7
 Solicitante (CLS) C0500
 CPF/CNPJ Solicitante
 Nome/Razão Social Comitente
 Código do IF CDB014HCKHW
 Código ISIN BRAAAABBBCM6
 Quantidade 1,00000000

Após a confirmação é enviada uma mensagem informando o número da operação de transferência. Exemplo: Operação 20110607112101000 efetuada.

3.5 Solicitação de Retirada de Ativos (Selic)

Caminho: Gestão de Colateral > Registros > Solicitação de Retirada > Ativos Selic

Visão Geral

Nesta função o Participante comanda a retirada de ativos públicos de sua Conta Alocação para a Conta Própria no SELIC. A função também permite a requisição de devolução de ativos entregues em garantia. Neste caso os ativos somente serão devolvidos se houver outros ativos elegíveis disponíveis na conta Alocação.

Tela Solicitação de Retirada de Ativos Selic

Solicitação de Retirada de Ativos (Selic)

Solicitante (Conta) 02191 ,00 -3

CPF/CNPJ Solicitante

Código do IF 10000020140101

Quantidade 2 ,

Conta Selic 99999977 -1

Número da Operação Selic 123698

Tipo Posição PROPRIA_LIVRE

Descrição dos campos da Tela de Solicitação de Retirada de Ativos (Selic)

| Campo | Descrição |
|--|--|
| Solicitante (Conta) | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código Cetip do solicitante. |
| CPF/CNPJ Solicitante | Identificação do comitente. Não é necessário o preenchimento do campo caso da solicitação seja efetuada pela conta própria do Participante. Caso a conta do solicitante seja uma conta cliente (10 ou 20), é necessário o preenchimento do campo “CPF/CNPJ”. |
| Código do IF | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código do instrumento financeiro do título SELIC. O código IF é representado pelo código SELIC do ativo mais a sua data de vencimento (formato: aaaammdd). |
| Quantidade | Campo de Preenchimento Obrigatório. Quantidade de ativo a ser retirado. |
| Conta SELIC (conta cessão fiduciária ALOCAÇÃO) | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código da conta cessão fiduciária alocação do participante solicitante no SELIC. |
| Número da Operação SELIC | Campo de Preenchimento Obrigatório, deve conter o número da operação lançada no SELIC. |
| Tipo de Posição | Campo de Preenchimento Obrigatório. Posição que o ativo encontra-se no sistema. |

Tela de Confirmação de retirada de Ativo SELIC

Solicitação de Retirada de Ativos (Selic)

Solicitante (Conta) 02191.00-3
 Solicitante (Nome Simplificado) PUMABM
 Solicitante (Conta Pool) 02191.62-5
 Solicitante (CLS) G0009
 CPF/CNPJ Solicitante
 Nome/Razão Social Comitente
 Código do IF 10000020140101
 Código ISIN BRSTNCLTN6M6
 Quantidade 2,00000000
 Conta Selic 99999977-1
 Número da Operação Selic 123698
 Tipo Posição PROPRIA_LIVRE

Além disso, para concluir a movimentação, é necessário que o participante envie uma mensagem do tipo SEL1063 no ambiente do Selic. O preenchimento da mensagem, bem como o funcionamento do sistema Selic, pode ser obtido no manual do usuário do Selic.

3.6 Solicitação de Retirada (Garantias em Dinheiro)

Caminho: Gestão de Colateral > Registros > Solicitação de Retirada > Garantias em Dinheiro

Visão Geral

A função permite ao Participante Cetip realizar a retirada do dinheiro depositado em garantias. A função também permite a requisição de devolução de dinheiro entregue em garantia. Neste caso o valor em dinheiro somente será devolvido se houver outros ativos elegíveis disponíveis na conta Alocação.

Tela Retirada de Garantias em Dinheiro

Retirada de Garantias de Dinheiro

Solicitante (Conta)

CPF/CNPJ Solicitante

Valor Financeiro Retirada

Descrição dos campos da Tela de Solicitação de Retirada (Garantia em Dinheiro)

| Campo | Descrição |
|---------------------------|---|
| Solicitante (Conta) | Campo de Preenchimento Obrigatório. Código Cetip do solicitante. |
| CPF/CNPJ Solicitante | Identificação do comitente. Não é necessário o preenchimento do campo caso da solicitação seja efetuada pela conta própria do Participante. Caso a conta do solicitante seja uma conta cliente (10 ou 20), é necessário o preenchimento do campo "CPF/CNPJ". |
| Valor Financeiro Depósito | Campo de Preenchimento Obrigatório. Valor desejado de retirada. |

Tela de Confirmação para Retirada de Garantias em Dinheiro

Retirada de Garantias de Dinheiro

Solicitante (Conta) 05000.00-5
 Solicitante (Nome Simplificado) RIOBM
 Solicitante (Conta Pool) 05000.62-7
 Solicitante (CLS) C0500
 CPF/CNPJ Solicitante
 Nome/Razão Social Comitente
 Valor Financeiro Retirada 1.000,00

4 CETIP | COLATERAL

4.1 Introdução

Recomenda-se verificar primeiramente os requisitos tecnológicos para acesso ao sistema, sendo necessário utilizar:

- Windows Server 2008 R2 Standard SP1 ou mais atual;
- Java SE 8 (JRE) update 65 (32-bit) ou superior;
- Internet Explorer IE11 ou superior;

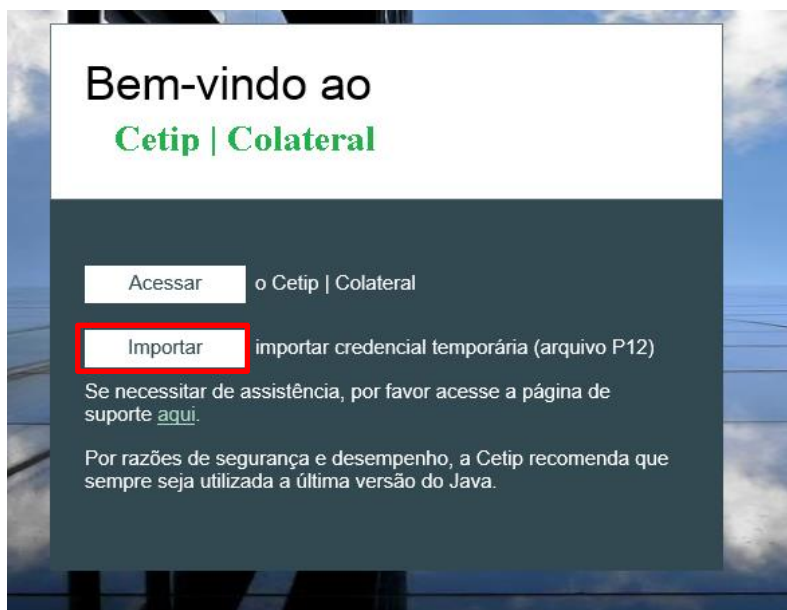
5 ACESSO AO CETIP | COLATERAL

5.1 Ativação de usuários

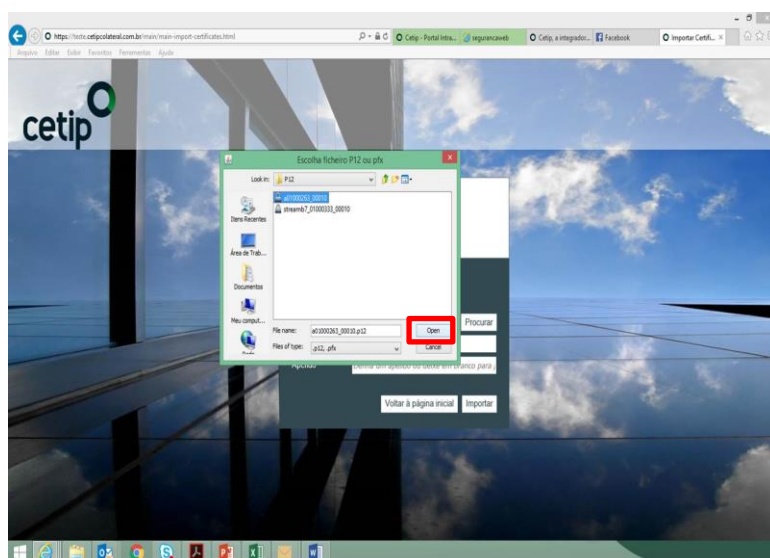
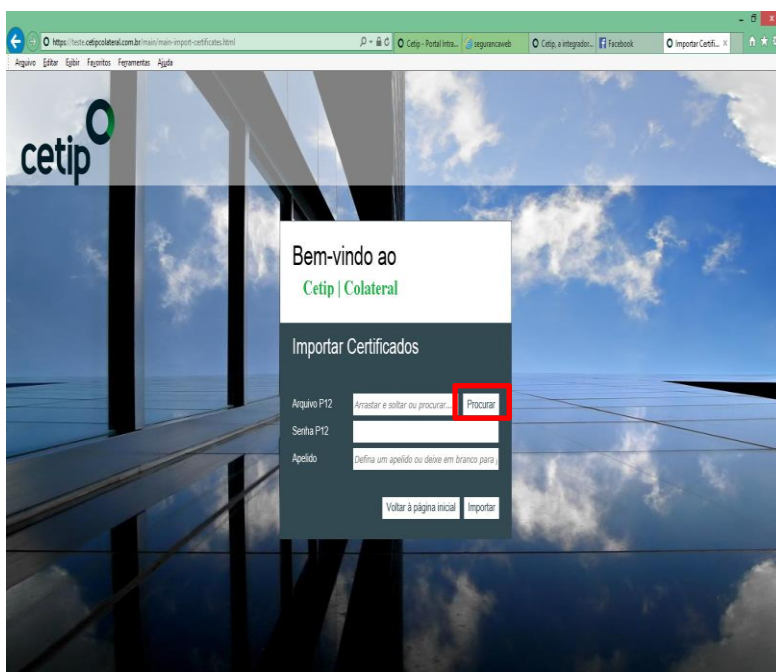
O primeiro passo para a utilização do Cetip | Colateral consiste na ativação do usuário.

Para que seja possível utilizar o Cetip | Colateral, serão enviados dois certificados e senhas provisórios para dois administradores do participante, que, por sua vez, serão capazes de criar outros usuários e grupos de usuários. Os certificados (arquivo do tipo “p12”) e as senhas provisórias serão enviados, via e-mail seguro para o participante.

Para iniciar a ativação dos usuários é preciso acessar a página do Cetip | Colateral e clicar no botão “Importar”.



O sistema iniciará o processo de carregamento. Assim que este processo for finalizado a tela abaixo será exibida e será necessário clicar no botão “Procurar”. Será aberta uma janela para que o arquivo “p12” salvo previamente seja carregado.



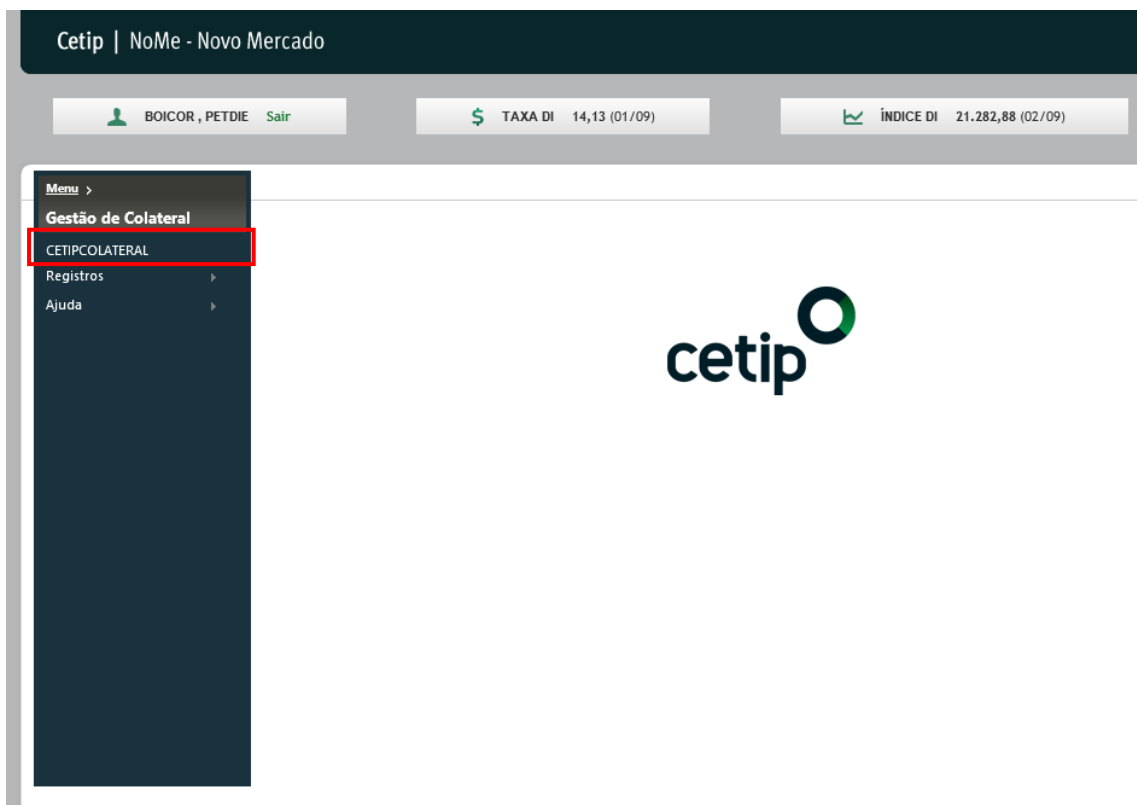
No campo “Senha P12”, deverá ser incluída a senha fornecida pela Cetip. Em seguida, o usuário deverá clicar no botão “Importar”.

Quando o sistema finalizar o processo de importação do arquivo, uma mensagem será exibida e o usuário deverá clicar no botão “Voltar à página Inicial” para que seja possível acessar o sistema. A partir daí, o usuário administrador estará pronto para acessar o ambiente. O mesmo processo deverá ser repetido para o segundo administrador.

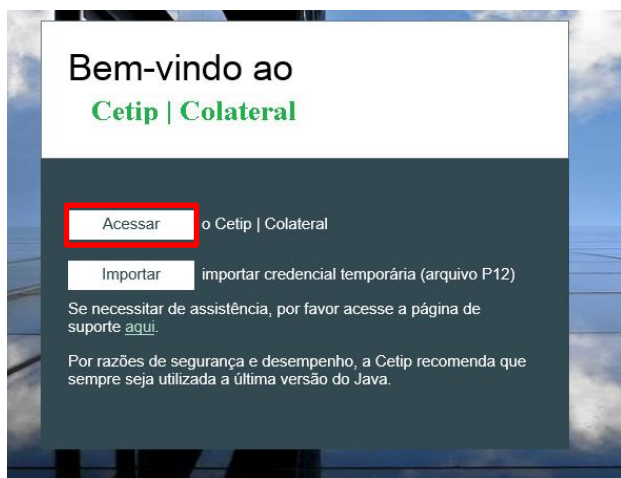
Depois de finalizado o processo de ativação do usuário, será possível acessar o sistema.

5.2 Primeiro Acesso ao Sistema

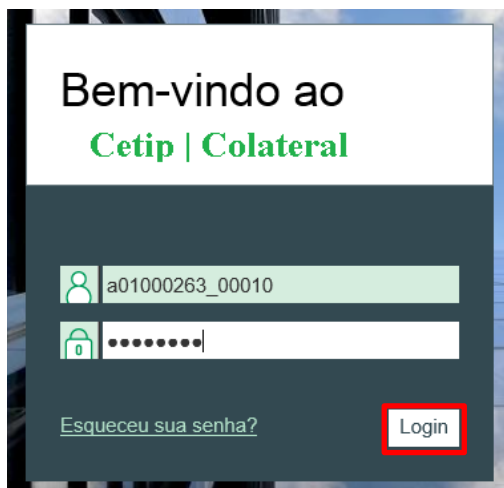
Para realizar o primeiro acesso ao sistema, é necessário acessar o NoMe e, através do item de menu “Gestão de Colateral > Cetip | Colateral” conforme descrito acima, o usuário será redirecionado para a página do Cetip | Colateral.



Nesta página, é preciso clicar em “Acessar” para iniciar.



Será exibida uma lista com os certificados que foram previamente instalados. O usuário deverá escolher o certificado, aguardar o carregamento da aplicação, digitar a senha que foi fornecida e clicar em “Login”.



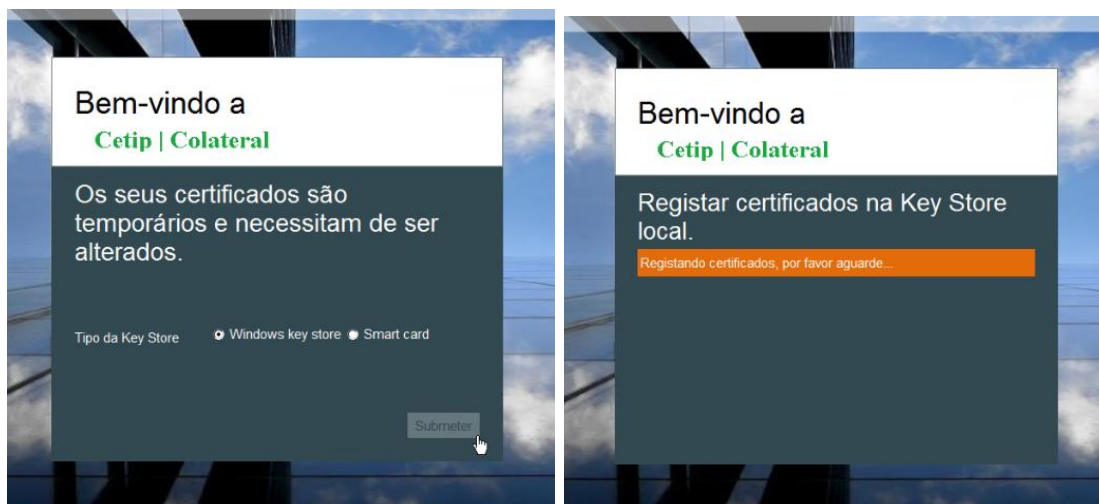
Na sequência o sistema irá solicitar a alteração da senha temporária por outra senha.



A nova senha deverá seguir os seguintes critérios:

- Possuir, no mínimo, 8 caracteres
- Possuir uma combinação de letras maiúsculas e minúsculas e pelo menos um número ou um caractere especial.

Depois de alterar a senha, também será necessário alterar o certificado para acesso (o certificado fornecido é temporário e válido apenas para o primeiro acesso). O usuário deve escolher a opção "Windows Key Store" na tela exibida, digitar a senha criada acima e, na sequência, clicar em "Enviar".



Ao término do processamento do sistema, a tela abaixo será exibida:



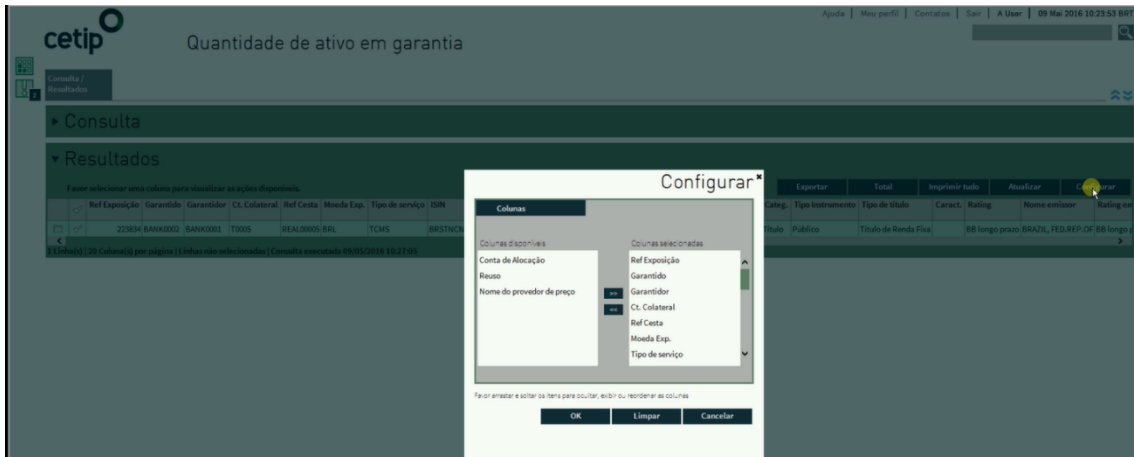
Para poder começar a utilizar o Cetip | Colateral o usuário deve reiniciar o navegador e realizar o login novamente.

5.3 Acesso Diário

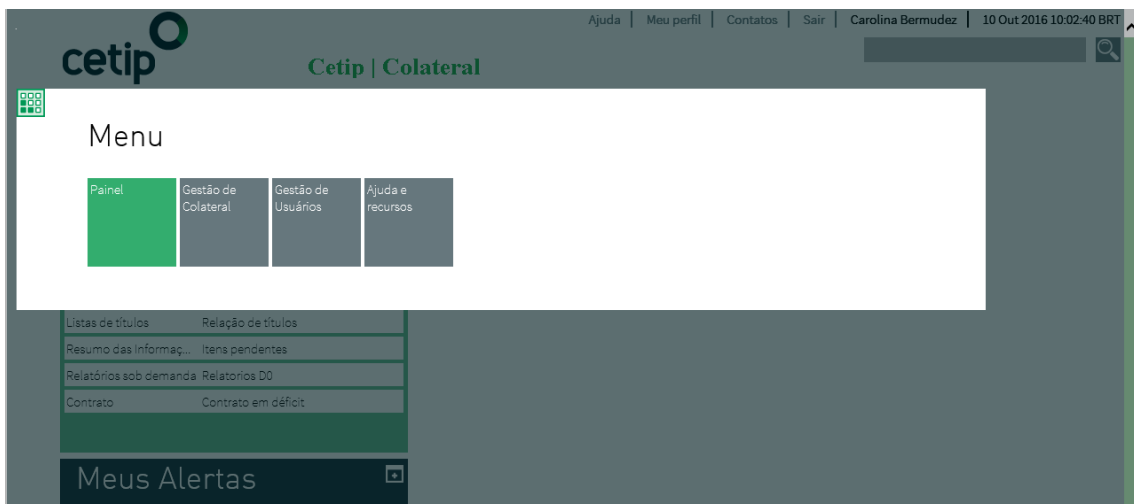
Após ter realizado o primeiro acesso ao sistema, conforme descrito no item acima, o usuário deverá sempre selecionar o certificado (que foi criado conforme acima) e a respectiva senha para utilizar o Cetip | Colateral.

A tela principal do sistema será como a mostrada abaixo, onde serão disponibilizados alguns atalhos, tais como as consultas configuradas previamente pelo usuário (“Minhas Consultas”), além de eventuais ações que o usuário precisa realizar (“Meus Alertas”).

Existe a possibilidade de se configurar cada uma das consultas disponíveis no sistema de acordo com as necessidades do usuário. É possível inserir ou excluir algumas informações, além de alterar a ordem das colunas para melhor visualização das informações disponibilizadas. Para que as alterações sejam salvas para utilização no futuro, basta clicar no botão “Configurar” e selecionar quais campos ficarão visíveis na consulta. Para alterar a ordem das colunas, basta arrastá-las e para o local desejado.



Para visualizar o menu com as funcionalidades disponíveis, basta posicionar o mouse sobre o item destacado abaixo:

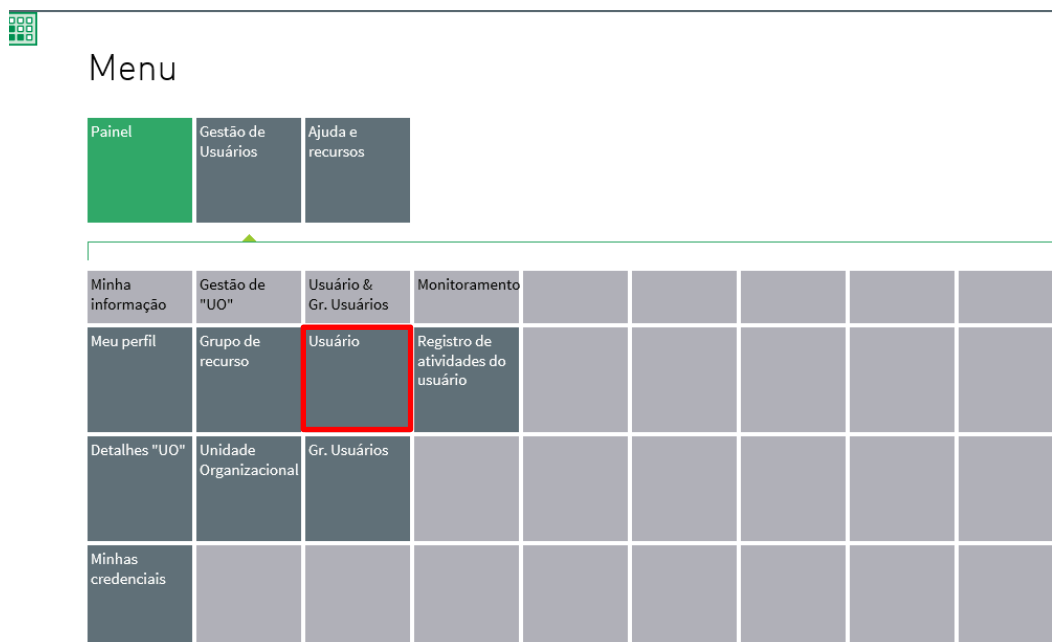


O menu acima irá exibir funcionalidades diferentes de acordo com o perfil do usuário. Cada uma dessas funcionalidades será descrita ao longo do manual.

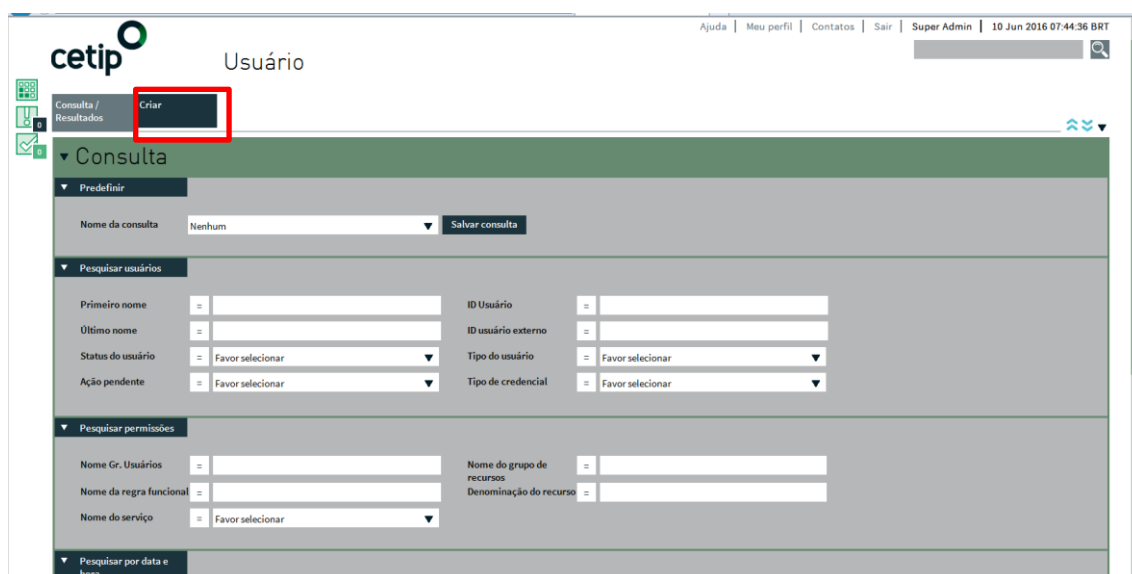
6 GESTÃO DE USUÁRIOS

A criação de usuários é realizada apenas por usuários administradores. Eles podem criar usuários de negócios, usuários administradores, bem como conceder para cada um deles alguns acessos específicos no sistema. Por padrão, o sistema está configurado de tal forma que a criação de um usuário seja feita por um usuário administrador e finalizada por outro (princípio “Feito/conferido”).

Para proceder com a criação de usuários, após o login no sistema, será necessário acessar o item “Gestão de Usuários”, categoria “Usuário & Gr. Usuários”, função “Usuário”.



A tela abaixo será exibida e, para iniciar o processo de criação, será necessário clicar no botão “Criar”:



Na tela de criação de usuário, as seguintes informações são mandatórias:

- Nome
- Sobrenome
- Endereço de e-mail do usuário
- Telefone
- Tipo de Usuário: estão disponíveis as opções de usuário de negócios e usuário administrador. O usuário de negócios pode realizar as movimentações de colateral e fazer consultas (de acordo com o perfil do usuário). Já o usuário administrador, conforme citado anteriormente, é responsável pela criação de usuários e concessão de acessos às funcionalidades do sistema.
- Propriedades do usuário: apenas os itens cujo “Nome da Propriedade” é “Feito/Conferido” são mandatórios. Aqui será definido se as ações realizadas pelo usuário que está sendo criado deverão ser confirmadas por outro usuário (duplo comando) ou não.
- Perfil do usuário: Aqui é necessário escolher se o usuário criado (no caso de usuário de negócios) terá acesso total ao sistema (e assim realizar movimentações de colateral) ou acesso somente de leitura (sendo possível apenas realizar consultas no sistema). Para usuário administrador este campo deverá ser deixado em branco.

| Nome do serviço | Nome da propriedade | Categoria | Atualizável por | Valor |
|-----------------|-----------------------|--------------------|--|---------------|
| Gestão Usuários | Smart card | Tipo de credencial | Todos os tipos de usuários administradores | Permitidos |
| Gestão Usuários | Armazenamento Windows | Tipo de credencial | Todos os tipos de usuários administradores | Permitidos |
| Gestão Usuários | Feito/Conferido | Feito/Conferido | Todos os tipos de usuários administradores | duplo comando |
| Gestão Usuários | Usuário Fuso Horário | Sistema | Todos os tipos de usuários administradores | BRT |
| Gestão Usuários | Idioma de preferência | Sessão | Todos os tipos de usuários administradores | Português |

Depois de preencher os campos necessários, basta clicar em “Enviar”. Neste momento será necessário que o outro usuário administrador entre no sistema para finalizar a criação do usuário.

Ao realizar o login no sistema, o usuário administrador verificará uma atividade pendente no quadro “Minhas Tarefas”, na página inicial (esta pendência será exibida para todos os usuários administradores do Participante, exceto aquele que iniciou a criação do usuário). Também é

possível verificar através da Consulta de Usuários (caminho: Menu > Usuários & Gr. Usuários > Usuário).

Neste momento é possível que o usuário finalize ou cancele a criação do usuário. Caso decida pela finalização, será necessário definir:

- Senha do usuário: criação de senha temporária para o novo usuário
- Certificado P12: determinação do local em que o certificado será salvo, bem como definição de senha para o mesmo.

7 GESTÃO DE COLATERAL

O item Gestão de Colateral Atividade e Configurações estão disponíveis apenas para usuários de negócios. As seguintes seções estarão disponíveis e, em cada uma delas, funcionalidades para o usuário:

Gestão de Colateral - Atividade

- Lista de pendências
 - Resumo das informações diárias
- Dados do contrato
 - Contratos
- Colateral
 - Exposições de colateral
 - Quantidade de ativos em garantia
 - Volume em dinheiro
 - Conta Alocação
 - Verificação de Elegibilidade
- Instruções
 - Gestão de colateral
 - Instruções enviadas
 - *Upload* de arquivos de instruções
- Relatórios
 - Relatórios sob demanda
 - Relatórios gerenciais
- Ferramentas
 - Simulação estendida
 - Tempo real

Gestão de Colateral - Configurações

- Dados do contrato
 - Informações das garantias aceitas
 - Exclusão de ativos
 - Participantes
- Títulos elegíveis
 - Títulos
 - Relação de títulos
 - Conteúdo de emissores específicos
 - Inelegibilidade
- Emissores
 - Emissores



Menu

| | | | | |
|--------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------|------------------|
| Painel | Gestão de Colateral - Atividade | Gestão de Colateral - Configurações | Gestão de Usuários | Ajuda e recursos |
|--------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------|------------------|

| | | | | | | |
|--------------------------------|-------------------|---------------------------------|---------------------------------|------------------------|---------------------|--|
| Lista de Pendências | Dados do contrato | Colateral | Instruções | Relatórios | Ferramentas | |
| Resumo das Informações Diárias | Contratos | Exposições de colateral | Gestão de Colateral | Relatórios sob demanda | Simulação estendida | |
| | | Volume em dinheiro | Instruções enviadas | Relatórios Gerenciais | Tempo real | |
| | | Quantidade de ativo em garantia | Upload de Arquivo de Instruções | | | |
| | | Conta Alocação | | | | |
| | | Verificação de Elegibilidade | | | | |



Menu

| | | | | |
|--------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------|------------------|
| Painel | Gestão de Colateral - Atividade | Gestão de Colateral - Configurações | Gestão de Usuários | Ajuda e recursos |
|--------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------------|------------------|

| | | | | | | |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------|--|--|--|--|
| Dados do contrato | Títulos Elegíveis | Emissores | | | | |
| Informação das garantias aceitas | Títulos | Emissores | | | | |
| Exclusão de ativos | Relação de títulos | | | | | |
| Participantes | Conteúdo de emissores específicos | | | | | |
| | Inelegibilidade | | | | | |

A seguir, serão descritos os detalhes de cada uma das seções e funcionalidades disponíveis aos Participantes usuários do produto Cetip | Colateral.

Gestão de Colateral - Atividade

7.1 Seção 1: Listas de Pendências

7.1.1 Resumo das Informações Diárias

Nesta função será possível verificar as instruções pendentes que necessitam de algum tipo de ação por parte do usuário. A partir dessas notificações, é possível autorizar, rejeitar ou modificar cada uma delas.

O fluxo das instruções irá depender do nível “Feito/Conferido” que foi definido previamente na criação dos usuários.

7.2 Seção 2: Dados do Contrato

Todas as características de um contrato estão centralizadas no item “Dados do Contrato”. Este item está subdividido nas seguintes funcionalidades:

7.2.1 Contratos

Nesta funcionalidade é possível consultar informações acerca de todos os contratos estabelecidos pelo Participante. Entende-se por contrato cada relação bilateral estabelecida entre o Participante e determinada contraparte, que é regida pelas informações fornecidas no Formulário de Elegibilidade (detalhado na seção “Introdução à Gestão de Colateral” deste manual). A consulta possui vários campos que podem ser preenchidos (ou não) para que os resultados sejam mais ou menos acurados. Para uma consulta mais genérica é possível deixar todos os campos em branco.

| Garantido | Garantidor | Ref Cesta | Cl. Colateral | Tipo de serviço | Tipo do contrato | Status Contrato | Colateral Exigido (BRL) | Valor Colateral (BRL) | Colateral Confirmado (BRL) | Saldo de Colateral (BRL) | Saldo Col. Conf. (BRL) | Excesso/Deficit (%) | Manual/Automático | Ref Contrato |
|-----------|------------|-----------|---------------|-----------------|-------------------------------|-----------------|-------------------------|-----------------------|----------------------------|--------------------------|------------------------|----------------------|-------------------|--------------|
| BANK001 | BANK002 | REAL0006 | T0006 | TCMS | Transferencia de título Ativo | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 % Auto Alocação | | 130501 |
| BANK001 | CETIP | POOL | P0004 | TCMS | Transferencia de título Ativo | | 245.783,30 | 245.783,30 | 245.783,30 | 0,00 | 0,00 | 0,00 % Manual | | 130499 |
| BANK002 | BANK001 | REAL0005 | T0005 | TCMS | Transferencia de título Ativo | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 % Auto Alocação | | 130500 |

A aba “Resultados” trará todos os contratos que atenderem às especificações do usuário. Ao selecionar um contrato nos resultados da consulta, o usuário poderá visualizar os detalhes do mesmo, através do botão “Abrir detalhes” ou se redirecionar para outras funções, a partir do botão “Ir para”: Exposições, Participantes e Quantidade de Ativo em Garantia.

7.3 Seção 3: Colateral

Todas as informações mais importantes do sistema de gestão de colateral estão reunidas no item “Colateral”. Este item está subdividido nas seguintes funcionalidades:

7.3.1 Exposições de colateral

A funcionalidade “Exposições de colateral” exhibe a relação de exposições do Participante, bem como todos os detalhes de cada uma delas. É possível realizar diversas consultas a partir de critérios, tais como:

- Referência de exposição;
- Contraparte;
- Informações específicas do contrato (referência do contrato, status);
- Valor do colateral.

A partir dos resultados da consulta executada, será possível que o usuário selecione uma linha na relação de resultados exibida e, clicando no botão “Criar”, realize o ajuste de principal para a relação escolhida. A tela aberta virá com algumas informações já preenchidas (tais como os campos: Garantido, Garantidor, Referência da Exposição etc.). Além disso, através do botão “Ir para”, é possível ser redirecionado para as seguintes funções do sistema: “Instruções Enviadas”, “Contratos”, “Participantes”, “Gestão de Colateral”, “Quantidade de ativo em garantia”. O botão “Abrir Detalhes” traz todas as informações no que diz respeito à exposição da relação selecionada.

Para realizar o ajuste de principal (mudança de exposição) também é possível realizar os seguintes passos:

Uma vez identificada a relação bilateral onde se deseja realizar a mudança de exposição, deve-se selecionar a respectiva linha e clicar em “Ações”, seguido de “Instruções” e “Ajuste de Principal”.

| Ref. Exposição | Garantido | Instruções | Ações | Tipo de serviço | Manual/Automático | Data Abertura | Data de Fechamento | Status Exp. | Moeda Exp. | Valor da Exposição | Principal Não Entregue | Valor Colateral | Colateral Não Confirmado | Saldo de Colateral |
|----------------|-----------|------------|-------|-----------------|-------------------|---------------|--------------------|-------------|------------|--------------------|------------------------|-----------------|--------------------------|--------------------|
| 223834 | BANK002 | BANK001 | T0005 | REAL0005 | T0005 | Auto Alocação | 04/11/2011 | Em curso | BRL | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

Na tela seguinte as informações abaixo deverão ser inseridas:

- “Ref. Instrução do Cliente”: campo onde o Participante deve inserir uma referência, que futuramente pode utilizada para identificar essa operação de maneira mais rápida;
- “Data de Exec”: deve ser selecionada a data da alteração do valor da exposição. Usualmente deverá ser a data do dia, mas pode ser estabelecida uma data futura;
- “Novo valor de exposição”: deve ser inserido o novo valor de exposição, expresso em BRL (reais).

Após preencher as informações nos três campos, o Participante deve clicar em “Enviar” e o sistema irá gerar mensagens de confirmação da ação na parte inferior da tela.

Para acompanhar o andamento da operação, é possível clicar no atalho de operações pendentes da página inicial ou através da consulta “Gestão de Colateral > Instruções > Gestão de Colateral”, selecionar como tipo de instrução a opção “Ajuste de Principal”, conforme sequência de telas abaixo.

Consulta / Resultados

Consulta

Predefinir

Nome da consulta: Nenhum Salvar consulta

Características do contrato

Resumo

Ref Instrução = Data de Exec. De 07/09/2016 Até 21/09/2016

Tipo Instrução = Ajuste de Principal ▼ Status da Instrução = Favor selecionar ▼

Parte = Ref Instrução do Cliente =

Contraparte = Modo de envio = Favor selecionar ▼

ID Instrução liquidação = Criar usuário =

Ref Contrato =

Instrução

Exposição

Contrato

Ordenar

Através dessa consulta também é possível verificar o histórico de operações efetivadas no sistema.

Collateral Management

Query / List

List

Please select a row to see available actions.

| Inc. ID | Inc. type | Instructing party | Instructing party role | Counterparty | Exp. ref. | Bids ref. | Value date | Inc. ref. | Reception timestamp | Last update timestamp | Inc. status | Input media | Print All | Refresh | Configure |
|----------|------------------|-------------------|------------------------|--------------|-----------|-----------|------------|------------------|---------------------|-----------------------|-------------|-----------------|-----------|---------|-----------|
| 32997942 | Change principal | DBS00001 | Coll. Receiver | BNDE0001 | 225587 | REAL0002 | 30/06/2016 | DBS000016 | 30/06/2016 22:36:33 | 30/06/2016 22:36:35 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32997775 | Change principal | BNDE0001 | Coll. Giver | DBS00001 | 225587 | REAL0002 | 30/06/2016 | BNDES_30/06/16 | 30/06/2016 21:44:26 | 30/06/2016 22:36:35 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32992880 | Change principal | HSDC0001 | Coll. Receiver | BNDE0001 | 229226 | REAL0004 | 26/08/2016 | HSDC | 26/08/2016 21:46:13 | 26/08/2016 21:46:13 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32925370 | Change principal | BSDB0001 | Coll. Receiver | BNDE0001 | 219487 | REAL0011 | 25/08/2016 | Sonnet250016 | 25/08/2016 21:42:22 | 25/08/2016 21:42:24 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32924370 | Change principal | BNDE0001 | Coll. Giver | HSDC0001 | 229226 | REAL0004 | 26/08/2016 | HSDC250016 | 26/08/2016 21:52:26 | 26/08/2016 21:44:49 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32922931 | Change principal | BNDE0001 | Coll. Giver | HSDC0001 | 229226 | REAL0004 | 26/08/2016 | BNDES_26/08/16 | 26/08/2016 20:29:17 | 26/08/2016 20:29:18 | Unmatched | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32923890 | Change principal | BNDE0001 | Coll. Giver | BSDB0001 | 219487 | REAL0011 | 26/08/2016 | BNDES_26/08/16 | 26/08/2016 20:27:06 | 26/08/2016 21:42:24 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32920071 | Change principal | BAHL0001 | Coll. Receiver | BNDE0001 | 229832 | REAL0006 | 24/08/2016 | BAHL240016 | 24/08/2016 18:00:38 | 24/08/2016 18:00:40 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32920020 | Change principal | BNDE0001 | Coll. Giver | BAHL0001 | 229832 | REAL0006 | 24/08/2016 | BNDES_24/08/16 | 24/08/2016 17:23:14 | 24/08/2016 18:00:40 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32854402 | Change principal | BNDE0001 | Coll. Giver | BAHL0001 | 229832 | REAL0006 | 23/08/2016 | BNDES_23/08/16 | 23/08/2016 22:53:03 | 23/08/2016 22:53:05 | Unmatched | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32855581 | Change principal | BNDE0001 | Coll. Giver | BAHL0001 | 229832 | REAL0006 | 23/08/2016 | BNDES_23/08/16 | 23/08/2016 22:38:50 | 23/08/2016 22:38:51 | Unmatched | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32855145 | Change principal | BNDE0001 | Coll. Giver | BAHL0001 | 229832 | REAL0006 | 23/08/2016 | BNDES_23/08/2016 | 23/08/2016 21:24:44 | 23/08/2016 21:24:46 | Unmatched | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32848829 | Change principal | SECA0001 | Coll. Receiver | BJPH0001 | 444981 | IND0030 | 28/07/2016 | AUTO | 28/07/2016 21:47:47 | 28/07/2016 21:47:48 | Released | CETIP/AUTOMATIC | | | |
| 32848828 | Change principal | BJPH0001 | Coll. Giver | SECA0001 | 444981 | IND0030 | 28/07/2016 | JP08070016 | 28/07/2016 21:47:47 | 28/07/2016 21:47:48 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32848527 | Change principal | SECA0001 | Coll. Receiver | BJPH0001 | 444981 | IND0030 | 28/07/2016 | SECA20070016 | 28/07/2016 21:47:44 | 28/07/2016 21:47:44 | Included | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32116597 | Change principal | BNDE0001 | Coll. Giver | BSDB0001 | 229061 | REAL0008 | 27/04/2016 | BNDE270416 | 27/04/2016 12:49:58 | 27/04/2016 12:49:58 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32116496 | Change principal | BNDE0001 | Coll. Receiver | BSDB0001 | 229061 | REAL0008 | 27/04/2016 | SAAT270416 | 27/04/2016 12:49:58 | 27/04/2016 12:49:58 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32147418 | Change principal | BSDB0001 | Coll. Receiver | BNDE0001 | 229061 | REAL0008 | 26/04/2016 | SAAT260416 | 26/04/2016 22:34:40 | 26/04/2016 22:34:40 | Unmatched | CETIP/COLATERAL | | | |
| 32137369 | Change principal | SESD0001 | Coll. Receiver | BJPH0001 | 426828 | IND0027 | 01/04/2016 | AUTO | 01/04/2016 18:03:43 | 01/04/2016 18:03:43 | Released | CETIP/AUTOMATIC | | | |
| 2487188 | Change principal | BSDB0001 | Coll. Giver | SESD0001 | 426828 | IND0027 | 01/04/2016 | JP01040016 | 01/04/2016 18:03:43 | 01/04/2016 18:03:43 | Released | CETIP/COLATERAL | | | |

300 Rows out of 221 rows (12 pages) | 30 Rows per page | No selected rows | Query executed: 07/05/2016 09:20:21

Gestão de Colateral

Ajuda | Meu perfil | Contratos | Sair | A User | 09 Mai 2016 09:49:13 BRT

Consulta / Resultados

Consulta

Resultados

Favor selecionar uma coluna para visualizar as ações disponíveis.

| Ref Instrução | Tipo Instrução | Parte | Função Parte | Contraparte | Ref Exposição | Ref Costa | Data de Exec. | Ref Instr. Cliente | Data da Instrução | Última atualização | Status Instrução | Modo de envio | Criar usuário | Contexto subst. |
|---------------|---------------------|----------|--------------|-------------|---------------|-----------|---------------|--------------------|---------------------|---------------------|------------------|-------------------|----------------------|-----------------|
| 31507863 | Ajuste de Principal | BANK0001 | Garantidor | BANK0002 | 223834 | REAL0005 | 04/03/2016 | 123456 | 09/05/2016 06:55:33 | 09/05/2016 06:49:26 | Validado | CETIP Colateral | sb11_0302637_1000087 | |
| 31506703 | Ajuste de Principal | BANK0001 | Garantido | BANK0002 | 223832 | REAL0006 | 04/03/2016 | 13456 | 04/05/2016 06:11:17 | 04/05/2016 06:22:12 | Confirmado | CETIP Colateral | sb11_0302637_1000087 | |

2 Links | 20 Colunas | 2 por página | Links não selecionados | Consulta executada 09/05/2016 09:49:25

Gestão de Colateral

Consulta / Resultados | Ajuste de Principal 223834 | 31507863

Ciclo de vida

| Status Ins. Participante | Data Criação | Mensagem de erro |
|--------------------------|---------------------|------------------|
| Recebido | 09/05/2016 08:55:33 | |
| Para ser validado | 09/05/2016 08:55:34 | |
| Pendente | 09/05/2016 08:55:34 | |

Instrução

Ref Instrução: 31507863

Parte: BANK0001 | Nome da Parte: BANK 0001

Função da Parte: Garantidor

Contraparte: BANK0002 | Nome da Contraparte: BANK 0002

Tipo Instrução: Ajuste de Principal

Ref Instrução do Cliente: 123456 | Status da Instrução: Pendente

Criar usuário: stb11_01002637_1000087 | Modo de envio: CETIP | Colateral

Datas

Data de Exec.: 04/03/2016 | Data da Instrução: 09/05/2016 08:55:33

Última atualização: 09/05/2016 08:55:34

7.3.2 Volume em dinheiro

Nesta funcionalidade é possível verificar o saldo em dinheiro alocado na Conta Garantia selecionada. Este valor será apresentado no campo “Valor Colateral (BRL)”, indicado na imagem abaixo.

Volume em dinheiro

Ajuda | Meu perfil | Contatos | Sair | A User | 09 Mai 2016 10:48:34 BRT

Consulta / Resultados

Consulta

Predefinir

Nome da consulta: Nenhum | Salvar consulta

Características do contrato

Resumo

Referência Exposição: [] | Ref Contrato: []

Código da Moeda: Tudo BRL | Garantido: []

Garantidor: [] | Valor Colateral: []

Valor Colateral (BRL): [] | Quantidade confirmada: []

Quantidade não confirmada: [] | Quantidade Alocada: []

Conta Alocação Original: []

Ordenar

Consultar | Contador | Limpar

Resultados

Volume em dinheiro

Ajuda | Meu perfil | Contatos | Sair | A User | 09 Mai 2016 10:48:34 BRT

Consulta / Resultados

Consulta

Resultados

Favor selecionar uma coluna para visualizar as ações disponíveis.

| | Exportar | Total | Imprimir tudo | Atualizar | Configurar | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|---------------|------------|---------------|---------------|------------|-------------------------|-------------------------|-------------------|-------------|-----------------|--------------------|--------------------|-----------------|-----------------------|-----------------------|--------|----------|----------|------|----------|-----|-------|-------|-----|----------|----------|------|------|----------|----------|--|--|--|--|--|
| <table border="1"> <thead> <tr> <th>Ref Exposição</th> <th>Garantido</th> <th>Garantidor</th> <th>Ct. Colateral</th> <th>Ref Cesta</th> <th>Moeda Exp.</th> <th>Conta Alocação Original</th> <th>Conta de Alocação</th> <th>Cid. Moeda</th> <th>Qtd. Alloc.</th> <th>Qtd. Confirmada</th> <th>Qtd não confirmada</th> <th>Deságio</th> <th>Valor Colateral</th> <th>Valor Colateral (BRL)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>223834</td> <td>BANK0002</td> <td>BANK0001</td> <td>T005</td> <td>REAL0005</td> <td>BRL</td> <td>P0004</td> <td>P0004</td> <td>BRL</td> <td>5.000,00</td> <td>5.000,00</td> <td>0,00</td> <td>0,00</td> <td>5.000,00</td> <td>5.000,00</td> </tr> </tbody> </table> | Ref Exposição | Garantido | Garantidor | Ct. Colateral | Ref Cesta | Moeda Exp. | Conta Alocação Original | Conta de Alocação | Cid. Moeda | Qtd. Alloc. | Qtd. Confirmada | Qtd não confirmada | Deságio | Valor Colateral | Valor Colateral (BRL) | 223834 | BANK0002 | BANK0001 | T005 | REAL0005 | BRL | P0004 | P0004 | BRL | 5.000,00 | 5.000,00 | 0,00 | 0,00 | 5.000,00 | 5.000,00 | | | | | |
| Ref Exposição | Garantido | Garantidor | Ct. Colateral | Ref Cesta | Moeda Exp. | Conta Alocação Original | Conta de Alocação | Cid. Moeda | Qtd. Alloc. | Qtd. Confirmada | Qtd não confirmada | Deságio | Valor Colateral | Valor Colateral (BRL) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 223834 | BANK0002 | BANK0001 | T005 | REAL0005 | BRL | P0004 | P0004 | BRL | 5.000,00 | 5.000,00 | 0,00 | 0,00 | 5.000,00 | 5.000,00 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

1 linha(s) | 29 Coluna(s) por página | 1 linha não selecionada | Consulta executada 09/05/2016 10:48:39

7.3.3 Quantidade de ativo em garantia

Esta funcionalidade exibe a relação de títulos alocados como garantia para determinada(s) exposição(ões). O usuário poderá realizar a consulta a partir de alguns critérios, tais como:

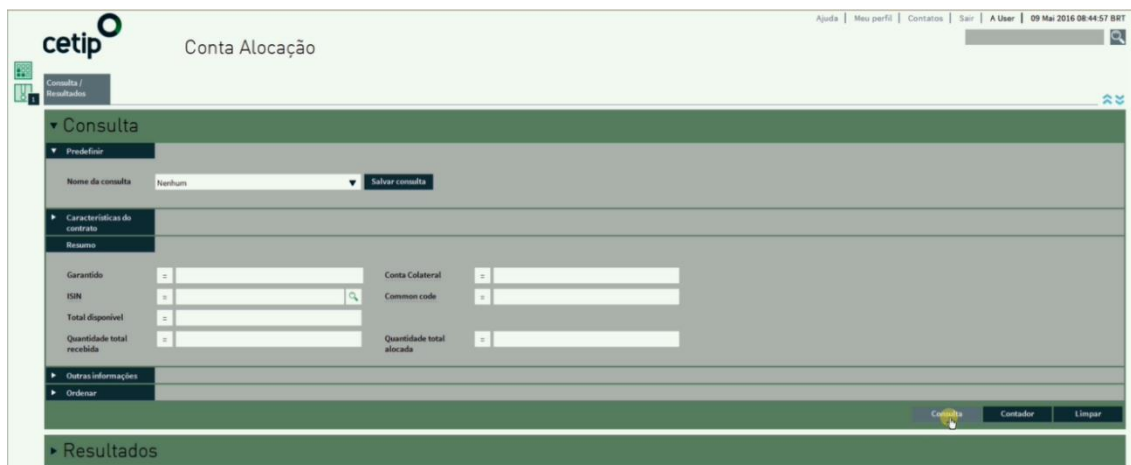
- Código ISIN
- Conta de Colateral

O botão “Total” traz o valor total dos títulos selecionados. Através do botão “Ir para”, é possível ser redirecionado para as seguintes funções: “Instruções Enviadas”, “Contratos”, “Exposições”, “Participantes”, “Gestão de Colateral”, “Títulos”.

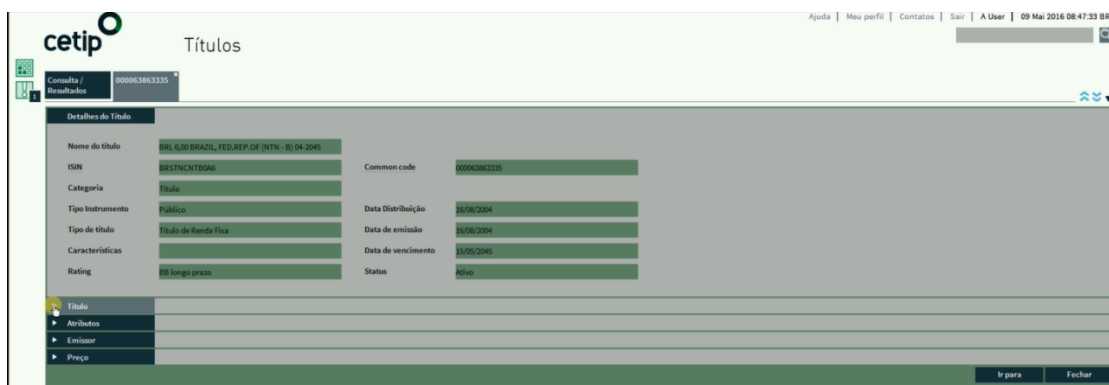
| ISIN | Moeda Exp. | Valor Colateral | Nome do título | Deságio | Tipo Instrumento | Categ. | Tipo de serviço | Tipo de título | Caract. | Common code | Rating | Nome |
|--------------|------------|-----------------|--|---------|------------------|--------|-----------------|----------------------|--------------|----------------|--------|------|
| BRSTNCNTB0A6 | BRL | 440.040.353,73 | BRL 6,00 BRAZIL, FED.REP.OF (NTN - B) 04-2045 | 0,00 | Público | Título | TCMS | Título de Renda Fixa | 000063863335 | BB longo prazo | BRAZIL | |
| BRSTNCNTB0A6 | BRL | 464.925.382,60 | BRL 6,00 BRAZIL, FED.REP.OF (NTN - B) 04-2045 | 0,00 | Público | Título | TCMS | Título de Renda Fixa | 000063863335 | BB longo prazo | BRAZIL | |
| BRSTNCNTB0A6 | BRL | 138.062.185,89 | BRL 6,00 BRAZIL, FED.REP.OF (NTN - B) 04-2045 | 0,00 | Público | Título | TCMS | Título de Renda Fixa | 000063863335 | BB longo prazo | BRAZIL | |
| BRSTNCNTB0A6 | 92.176 | 2.857,720357 | 263.413.231,63 BRL 6,00 BRAZIL, FED.REP.OF (NTN - B) 04-2045 | 0,00 | Público | Título | TCMS | Título de Renda Fixa | 000063863335 | BB longo prazo | BRAZIL | |
| BRSTNCNTB0A6 | 25.670 | 2.857,720357 | 73.357.681,56 BRL 6,00 BRAZIL, FED.REP.OF (NTN - B) 04-2045 | 0,00 | Público | Título | TCMS | Título de Renda Fixa | 000063863335 | BB longo prazo | BRAZIL | |
| BRSTNCNTB0A6 | 482.832 | 2.857,720357 | 1.379.798.835,41 BRL 6,00 BRAZIL, FED.REP.OF (NTN - B) 04-2045 | 0,00 | Público | Título | TCMS | Título de Renda Fixa | 000063863335 | BB longo prazo | BRAZIL | |

7.3.4 Conta Alocação

A funcionalidade “Conta Alocação” traz os títulos e/ou dinheiro, disponíveis na Conta Alocação selecionada. Também está disponível o preço de cada um dos títulos relacionados. Além disso, também é possível visualizar o total de garantias que foi entregue através da Conta Alocação selecionada para os diferentes garantidos em que o garantidor (titular da Conta Alocação em questão) possui relação bilateral firmada.



Também é possível, a partir da funcionalidade “Conta Alocação”, visualizar as características de um título que consta na lista de resultados exibida. Para isso, basta selecionar o título desejado e, a partir do botão “Ir Para”, escolher a opção “Títulos Elegíveis” e, na sequência, “Títulos”, conforme imagens abaixo.



7.3.5 Verificação de Elegibilidade

Nesta seção será possível que o usuário verifique se um título é elegível para determinada relação bilateral no Cetip | Colateral. É possível realizar a verificação através do *upload* de um arquivo contendo os ISINs que se deseja verificar a elegibilidade, através da seleção da Conta Alocação ou, ainda, através da inserção manual do ISIN do título no sistema.

Caso o título não se enquadre nas regras de elegibilidade da relação bilateral, o mesmo será considerado inelegível para aquela relação.

A interface de "Verificação de Elegibilidade" do sistema Cetip apresenta os seguintes elementos:

- Seleção de garantidor:** Campos para "Garantidor" (com ícone de lupa) e "Nome do garantidor".
- Seleção de contrato:** Campo para "Moeda global" com uma seta para baixo.
- Tabela de resultados:** Cabeçalho com colunas: Garantidor, Garantido, Ct. Colateral, Ref Cesta, Tipo de serviço. O conteúdo da tabela indica "Nenhuma linha disponível".
- Botões de ação:** "Limpar" e "Adicionar contrato".
- Opções de elegibilidade:** Seção com "Estratégia" e quatro opções de radio button: "ISIN" (selecionada), "Apenas arquivo", "Sem arquivo" e "Mascarar arquivo".
- Campos de entrada:** Campos para "ISIN" (com ícone de lupa) e "Quantidade".
- Outros campos:** Campo "Common code" com uma barra de texto verde.

7.4 Seção 4: Instruções

Este item centraliza todas as informações acerca das instruções enviadas pelo Participante. As seguintes funcionalidades estão disponíveis:

7.4.1 Gestão de Colateral

Esta funcionalidade possibilita que o usuário visualize as instruções criadas pelo Participante com seus respectivos detalhes ("ID da instrução", "Tipo de instrução", "Parte", "Contraparte" etc.), bem como seu status atual. É possível realizar vários filtros para obter uma lista de resultados acurada.

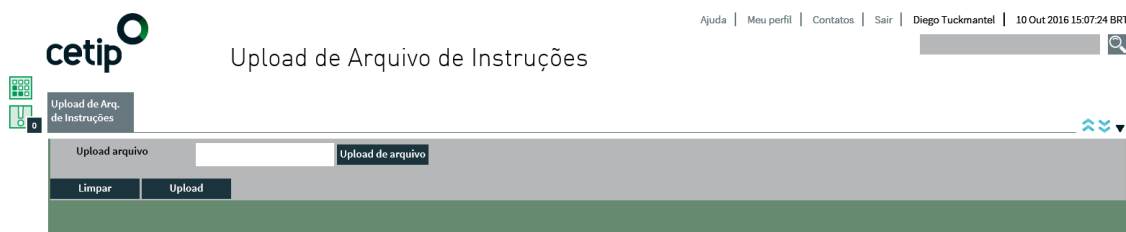
A partir dos resultados da consulta, utilizando o botão “Ir Para” é possível ser redirecionado para as seguintes funções: “Instruções Enviadas”, “Contrato”, “Exposições” e “Participantes”. O botão “Copiar” é tem por finalidade utilizar os principais dados da instrução selecionada para criar uma nova instrução (alguns campos não poderão ser alterados e virão desabilitados e já preenchidos com a informação).

7.4.2 Instruções Enviadas

A funcionalidade de “Instruções Enviadas” disponibiliza para o usuário a lista de instruções geradas pelo sistema. Quando estas instruções são finalizadas, as instruções do Participante serão totalmente processadas. As instruções refletem as movimentações de colateral no sistema. A partir de uma instrução selecionada o usuário poderá ser direcionado, utilizando o botão “Ir para”, para as seguintes funções do sistema: “Contratos”, “Exposições”, “Gestão de colateral” e/ou “Quantidade de ativo em garantia”.

7.4.3 Upload de Arquivo de Instruções

A partir desta funcionalidade é possível criar várias instruções através do *upload* de um arquivo “xls” ou “csv”. Após o *upload*, o sistema exibe as instruções carregadas e destaca eventuais instruções inválidas. Apenas instruções válidas permanecem no arquivo que então é enviado para o processo de autorização. Depois de autorizado, todas as instruções são geradas no sistema.



7.5 Seção 6: Relatórios

7.5.1 Relatórios sob Demanda

Nesta função serão disponibilizados os relatórios gerados a partir de solicitações realizadas no sistema, mais especificadamente nas funções de simulação. Sempre que um relatório for gerado, o usuário será alertado através do quadro “Meus Alertas” na página inicial do sistema.

O relatório resumo traz as informações principais em formato pdf. Já o relatório detalhado contém todas as informações disponíveis em formato “csv”, que pode ser aberto diretamente no Excel.

| Relatórios | Aberto | Íterios | Local | Ref Ceata | Tipo de relatório | Subtipo de relatório | Data da Geração | Data do relatório | Exportar | Imprimir tudo | Atualizar | Configurar |
|------------|---------|----------|----------|---------------------------------|-------------------|----------------------|-----------------|-------------------------|----------|---------------|-----------|------------|
| 1112701 | 7674886 | BANK0001 | REAL0006 | Ceata de garantia - visão geral | Resumido | 08/05/2016 06:27:24 | 04/03/2016 | rel_11_01002637_1000987 | | | | |
| 1112700 | 7674887 | BANK0001 | REAL0006 | Ceata de garantia - visão geral | Resumido | 08/05/2016 04:55:27 | 04/03/2016 | rel_11_01002637_1000987 | | | | |
| 1112699 | 7674886 | BANK0002 | REAL0005 | Ceata de garantia - visão geral | Resumido | 08/05/2016 04:53:33 | 04/03/2016 | rel_11_01002637_1000987 | | | | |

7.5.2 Relatórios Gerenciais

Nesta função são disponibilizados relatórios que contém informações acerca das relações do Participante, tais como, títulos entregues como garantia (valor por contraparte e por tipo de título), valor das garantias entregues (total, por emissor) etc.

7.6 Seção 7: Ferramentas

7.6.1 Simulação Estendida

O principal objetivo da funcionalidade de “Simulação Estendida” é possibilitar ao usuário a verificação sobre como o sistema agiria no caso de criação de diversas exposições com diferentes contrapartes no mesmo dia. Também é possível simular o aumento de exposição para uma relação existente. A simulação poderá ser realizada utilizando os títulos disponíveis na Conta Alocação do Participante ou os títulos disponíveis na Conta Alocação acrescidos de títulos provenientes de arquivo externo (não é possível realizar a simulação utilizando apenas títulos provenientes de arquivo externo). Caso haja exposições subcolateralizadas, será realizada a alocação de garantias para que as mesmas sejam totalmente cobertas. Além disso, é possível realizar o processo de otimização, onde o sistema verifica as exposições existentes e tenta aprimorar a utilização de colateral entre as exposições novas e aquelas já existentes.

Depois de inserir todas as informações necessárias, o usuário deve clicar em “Executar Simulação” para iniciar a simulação. Assim que o sistema finalizar, o relatório da simulação será disponibilizado na função de “Relatórios sob Demanda”.

7.6.2 Simulação em Tempo Real

A simulação em tempo real possibilita ao usuário a verificação sobre como o sistema agiria no caso de criação de diversas exposições com diferentes contrapartes no mesmo dia. Também é possível simular o aumento de exposição para uma relação existente. A simulação poderá ser realizada utilizando os títulos disponíveis na Conta Alocação do Participante ou os títulos disponíveis na Conta Alocação acrescidos de títulos provenientes de arquivo externo ou, ainda, uma combinação dos dois (títulos disponíveis na Conta Alocação e em arquivo externo).

Depois de inserir todas as informações necessárias, o usuário deve clicar em “Executar Simulação” para iniciar a simulação. Assim que o sistema finalizar, o relatório da simulação será disponibilizado na função de “Relatórios sob Demanda”.

8 GESTÃO DE COLATERAL - CONFIGURAÇÕES

8.1 Seção 1: Dados do Contrato

Todas as características de um contrato estão centralizadas no item “Dados do Contrato”. Este item está subdividido nas seguintes funcionalidades:

8.1.1 Informação das garantias aceitas

Nesta funcionalidade será exibida a relação de contratos que o Participante faz parte. A consulta possui vários campos que podem ser preenchidos (ou não) para que os resultados sejam mais ou menos acurados. Para uma consulta mais genérica é possível deixar todos os campos em branco.

A aba “Resultados” trará todos os contratos que atenderem às especificações do usuário, sendo possível se redirecionar para as funções “Contratos” e “Participantes”, através do botão “Ir Para”. Além disso, é possível abrir os detalhes da relação bilateral selecionada, onde estarão exibidas

as informações que foram firmadas através do Relatório de Elegibilidade. Para visualizá-los, basta navegar por entre as abas: “Resumo”, “Elegibilidade”, “Deságio”, “Concentrações”.

8.1.2 Exclusão de ativos

Esta funcionalidade exibe a relação de títulos que foram inseridos no Relatório de Elegibilidade na sessão “VI – Emissores/Emissões Específicas”, campos “Excluir Emissores Específicos” e “Excluir Emissões Específicas”. A consulta possui vários campos que podem ser preenchidos (ou não) para que os resultados sejam mais ou menos acurados. Para uma consulta mais genérica é possível deixar todos os campos em branco.

A aba “Resultados” trará todos os contratos que atenderem às especificações do usuário, sendo possível se redirecionar para as funções “Contratos” e “Participantes”, através do botão “Ir Para”. Além disso, através do botão “Abrir Detalhes” é possível visualizar a lista de títulos que se enquadram na situação de “Excluídos” para a relação bilateral em questão.

8.1.3 Participantes

Esta funcionalidade permite ao usuário visualizar a relação de Garantidos e Garantidores com o qual o mesmo possui relações bilaterais firmadas.

A consulta possui vários campos que podem ser preenchidos (ou não) para que os resultados sejam mais ou menos acurados. Para uma consulta mais genérica é possível deixar todos os campos em branco.

A aba “Resultados” trará todos os Participantes para os quais o usuário tem acesso. Através do botão “Abrir Detalhes” é possível visualizar informações sobre o Participante selecionado.

The screenshot shows the 'Participantes' page in the Cetip Portal. The search filter section is expanded, showing the following fields and options:

- Nome da consulta:** Nenhum (dropdown menu) with a 'Salvar consulta' button.
- Resumo:**
 - Código do Participante:** [input field]
 - Nome do participante:** [input field]
 - Garantido:** Todos, Sim, Não
 - Garantidor:** Todos, Sim, Não
 - Status do Participante:** Todos, Ativo, Inativo
 - MFI-ID:** [input field]
- Ordenar:** [dropdown menu]
- Buttons:** Consulta, Contador, Limpar

The screenshot shows the 'Participantes' page in the Cetip Portal, displaying search results. The results section is expanded, showing the following details for a selected participant:

- Resumo:**
 - Código do Participante:** CETIP
 - Nome do participante:** CETIP
 - Função do Participante:** Garantidor
 - Pais do Participante:** BR - Brasil
 - Status do Participante:** Ativo
 - MFI-ID:** [input field]
- Buttons:** Ir para, Fechar

8.2 Seção 2: Títulos Elegíveis

8.2.1 Títulos

É possível verificar todos os títulos que estão cadastrados no sistema e são elegíveis para serem utilizados em garantias nas relações bilaterais (desde que não exista nenhuma restrição definida no contrato de elegibilidade estabelecido entre as partes) através desta funcionalidade.

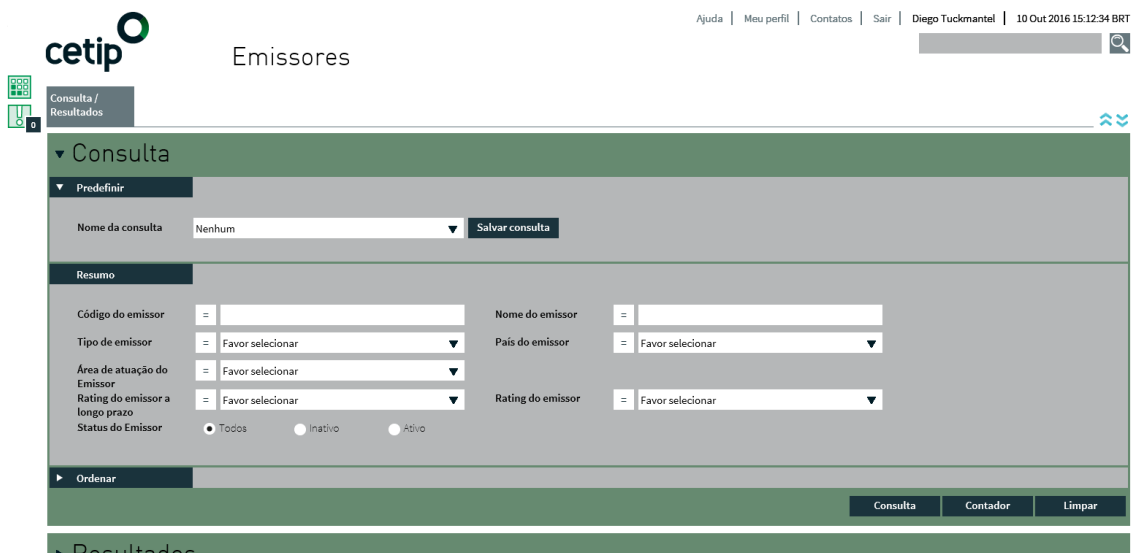
| ISIN | Common code | Nome do título | Data de emissão | Data venc. | Rating | Cod. Moeda | Tipo Instrumento | País emissor | Cat. Mercado |
|--------------|--------------|---|-----------------|------------|-----------------|------------|------------------|--------------|--------------|
| BRALLDBS040 | 000069215629 | BRL 1,65 ALL - AMERICA LATINA LOGISTICA S/A 1 | 15/04/2011 | 15/04/2016 | NR longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRAMARDBS022 | 000124753201 | BRL FLR MARIJA LOJAS 14-2019 | 09/05/2014 | 25/04/2019 | NR longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRAMRODBS072 | 000063861154 | BRL FLR ABN AMRO ARREND. (DEBENTURE) 06-2016 | 01/08/2006 | 01/08/2016 | NR longo prazo | BRL | Privado | BR - Brasil | Doméstico |
| BRAVIADBS014 | 000124752841 | BRL 8,00 AUTOVIAS 10-2017 | 15/03/2010 | 15/03/2017 | BB longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRAZLADB043 | 000124752850 | BRL FLR AZUL LINHAS AEREAS BRASILEIRAS 14-20 | 29/09/2014 | 19/09/2019 | NR longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRBDLSDBS008 | 000063861227 | BRL FLR BRADESCO LEASING SA 05-2025 | 01/02/2005 | 01/02/2025 | NR longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRBDLSDBS024 | 000063861235 | BRL FLR BRADESCO LEASING SA AM 05-2025 | 01/02/2005 | 01/02/2025 | NR longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRBDLSDBS032 | 000063861243 | BRL FLR BRADESCO LEASING SA AM 05-2025 | 01/02/2005 | 01/02/2025 | NR longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRBESADBS009 | 000063861286 | BRL FLR BAESA - ENERGETICA BARRA GRANDE S.A. | 08/07/2010 | 01/08/2016 | BB+ longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRBESADBS017 | 000063861294 | BRL FLR BAESA - ENERGETICA BARRA GRANDE S.A. | 08/07/2010 | 01/08/2016 | NR longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRBFLDBS025 | 000063861308 | BRL FLR BFB LEASING SA ARREND MERCANTIL 10-2 | 01/04/2010 | 01/04/2020 | NR longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRBFLDBS033 | 000063861316 | BRL FLR BFB LEASING SA ARREND MERCANTIL 07-2 | 02/07/2007 | 01/07/2027 | NR longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |
| BRBFLDRS041 | 000063861324 | BRL FLR BFB LEASING SA ARREND MERCANTIL 07-2 | 03/12/2007 | 01/12/2027 | NR longo prazo | BRL | Privado | | Doméstico |

Ao selecionar um título, é possível visualizar os detalhes do mesmo, através do botão “Abrir detalhes”. Também é possível ser redirecionado, através do botão “Ir para”, para as seguintes funcionalidades: “Conta Alocação” e “Quantidade de ativos em garantia”.

8.3 Seção 3: Emissores

8.3.1 Emissores

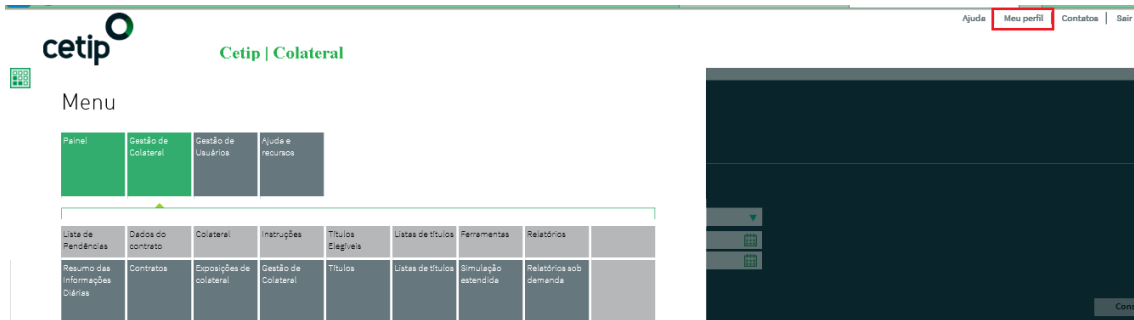
Esta funcionalidade permite que o usuário verifique os detalhes acerca dos emissores dos ativos. A lista de emissores é disponibilizada, sendo que cada emissor está conectado com os respectivos títulos (na funcionalidade “Títulos” o usuário consegue visualizar quem é o emissor do título selecionado).



A partir do botão “Ir para”, é possível ser redirecionado para a funcionalidade “Títulos”, onde o usuário poderá visualizar todos os títulos emitidos pelo emissor selecionado. Já o botão “Abrir detalhes” exibe todas as informações relevantes sobre o emissor selecionado.

8.3.2 Perfil do Usuário

O acesso à função do perfil do usuário é realizado através do link “Meu perfil” na parte superior esquerda do sistema. Nele é possível verificar os dados cadastrais do usuário, assim como as funcionalidades concedidas pelo administrador no processo de cadastro.



cetip Ajuda | Meu perfil

Meu perfil

▼ Detalhes

| | | | |
|-----------------------|---------------------|--------------------|-----------------|
| Primeiro nome | | ID Usuário | a01000260_00010 |
| Último nome | | ID usuário externo | |
| Nome do meio | | Tipo do usuário | Operação |
| Usuário representante | | Status do usuário | Ativo |
| Email | | Ação pendente | Nenhum |
| Número do telefone | | Un. Organização | CETIP Entity OU |
| Data de criação | 12/12/2014 10:48:53 | Número do celular | |
| Última atualização | 22/09/2015 11:04:06 | Número de fax | |

▼ Informações da credencial

| Credencial type | Status | Ação pendente | Data de expiração da credencial | Número serial do SSL | Número serial da assinatura | Última atualização | Última atualização do usuário |
|-------------------------|--------|---------------|---------------------------------|----------------------|-----------------------------|---------------------|-------------------------------|
| Certificado de Software | Ativo | Nenhum | 22/09/2017 15:18:48 | 1132152179 | 1132152180 | 21/11/2015 03:17:38 | a01000260_00010 |
| Senha | Ativo | Nenhum | 08/10/2016 10:18:20 | | | 08/07/2016 10:18:20 | a01000260_00010 |

▼ Escolher sumário

- ▶ Gestão de Colateral

▼ Minhas propriedades

| Nome do serviço | Nome da propriedade | Categoria | Atualizável por | Valor |
|---------------------|----------------------|-----------|--|-------|
| Gestão de Colateral | Mostrar moedas | Moeda | Todos os tipos de usuários administradores | BRL |
| Gestão de Colateral | Incluir moedas | Moeda | Todos os tipos de usuários administradores | BRL |
| Gestão de Colateral | Moeda de preferência | Moeda | Todos os tipos de usuários administradores | BRL |

9 TRATAMENTO PARA LIBERAÇÃO DE GARANTIAS

Importante: Os documentos citados neste capítulo estão disponíveis em: <https://www.cetip.com.br/ProdutosServicos/UnidadeTitulos/GestaoDeRisco-CetipColateral>

FORMULÁRIO “NOTIFICAÇÃO DE VENCIMENTO ANTECIPADO”

Em casos de envio de notificação de vencimento antecipado, independentemente da motivação que tenha lhe dado causa, a Cetip deverá ser notificada formalmente, por escrito, mediante envio do formulário “Notificação de Vencimento Antecipado” assinado pela parte solicitante e confirmado pela contraparte, quando aplicável.

É importante ressaltar que a Cetip não fará qualquer tipo de validação ou consistência do motivo pelo qual determinada parte da operação acionou o processo de liberação de garantias. Portanto, o envio do formulário assim como as informações nele contidas é de total e exclusiva responsabilidade do Participante que enviou o formulário “Notificação de Vencimento Antecipado” à Cetip.

ENVIO DO FORMULÁRIO

O acionamento do processo de liberação de garantias através do envio do formulário “Notificação de Vencimento Antecipado” deverá respeitar os seguintes aspectos:

- I. Destinatário:
Superintendência de Controle de Riscos e Garantias (GEGAR – Diretoria de Operações da Unidade de Títulos e Valores Mobiliários – UTVM)
- II. Endereço:
Alameda Xingu, 350 – 1º andar
Alphaville, Barueri / SP – CEP 06455-030
- III. Horário:
A Cetip poderá receber o documento das 8h30 às 13h00 para que a liberação das garantias seja feita na data da solicitação. Caso contrário, a liberação será feita no dia útil imediatamente posterior.
- IV. Modalidade:
Envio de formulário físico impresso com as devidas assinaturas e preenchimentos. É permitido, para fins de adiantamento dos procedimentos internos, o envio do formulário assinado por e-mail. Ainda assim, a efetivação da liberação das garantias só será concluída quando recebida a devida documentação física, dentro do horário especificado no item “III”.

NOTIFICADOR

O Participante elegível ao envio do formulário “Notificação de Vencimento Antecipado” – o Notificador* – deverá ser definido no formulário “Critérios de Elegibilidade”, conforme acordado entre as partes, dentre as seguintes opções:

- I. Garantido da operação, incluindo os casos em que um Participante o representa na Cetip; ou
- II. Garantido da operação, mediante confirmação do Garantidor da operação, incluindo os casos em que um ou mais Participantes os representam na Cetip.

* Para todos os fins, entende-se como Notificador o Acelerador, conforme constante do Manual de Normas de Gestão de Garantia e definido no Glossário.

Envio exclusivo pelo Garantido

Nos casos em que, independentemente da validação da Cetip, o Garantido enviar o formulário “Notificação de Vencimento Antecipado” à Cetip, nos termos do item 1.1 acima, será analisada a seguinte estrutura:

TABELA 1 – ESTRUTURA DE PARTICIPANTES PARA ENVIO DE NOTIFICAÇÃO

| Notificador | Natureza | Qualificação do Notificador |
|---------------------------------|----------------------------------|--|
| Garantido (ou seu Participante) | Participante (Conta Própria) | Participante, com envio em nome próprio. |
| | Cliente PF/PJ (Conta Cliente) | Participante que presta serviços para o Garantido, com envio em nome do Garantido. |

Nos casos em que um Participante Cetip representar seu cliente, a instituição financeira deverá ser responsável pelo envio do formulário “Notificação de Vencimento Antecipado”.

O formulário “Notificação de Vencimento Antecipado” deverá contemplar, necessariamente, a assinatura do Garantido, Participante Cetip, mesmo no caso em que ele representa seu cliente, com as devidas indicações de ativos e contas.

Recebida a notificação, a Cetip iniciará as etapas previstas para a liberação de garantias, conforme descrito na Seção 2 – Etapas do Processo de Liberação de Garantias.

Envio pelo Garantido, mediante confirmação do Garantidor

Nos casos em que, independentemente da validação da Cetip, o Garantido enviar o formulário “Notificação de Vencimento Antecipado” que conte, necessariamente, com a confirmação do Garantidor, será mantido o tratamento descrito na Seção 1.2.1 – Envio exclusivo pelo Garantido, e, adicionalmente, será analisada a seguinte estrutura:

TABELA 2 – ESTRUTURA DE PARTICIPANTES PARA CONFIRMAÇÃO DE NOTIFICAÇÃO

| Confirmação | Natureza | Qualificação do Notificador |
|----------------------------------|----------------------------------|--|
| Garantidor (ou seu Participante) | Participante (Conta Própria) | Participante, com confirmação em nome próprio. |
| | Cliente PF/PJ (Conta Cliente) | Participante que presta serviços para o Garantido, com envio em nome do Garantido. |

Nos casos em que um Participante Cetip representar seu cliente, a instituição financeira deverá ser responsável pela confirmação no formulário “*Notificação de Vencimento Antecipado*”.

O formulário de “*Notificação de Vencimento Antecipado*” deverá contemplar, necessariamente, assinaturas do Garantido e Garantidor, Participantes Cetip, mesmo no caso em que eles representarem seus respectivos clientes, assim como as devidas indicações de ativos e contas.

Recebida a notificação, a Cetip iniciará as etapas previstas para a liberação de garantias, conforme descrito na Seção 2 – Etapas do Processo de Liberação de Garantias.

ETAPAS DO PROCESSO DE LIBERAÇÃO DE GARANTIAS.

A Cetip realizará, respeitando as regras de horário de recebimento do formulário “*Notificação de Vencimento Antecipado*”, a liberação das garantias indicadas no referido documento, conforme Tabela 4.

TABELA 4 – FLUXO DE GARANTIAS ENTRE CONTAS

| Notificador | Conta Origem | Conta Destino |
|---------------------------------|----------------------------------|---|
| Garantido (ou seu Participante) | Conta Garantia (64) do Garantido | Deverá ser informada no formulário “ <i>Notificação de Vencimento Antecipado</i> ” a conta válida/ativa de sua titularidade em que os ativos serão transferidos |
| | Conta Garantia (64) do Garantido | Deverá ser informada no formulário “ <i>Notificação de Vencimento Antecipado</i> ” |

| | | |
|---|--|--|
| Garantido (ou seu Participante), mediante confirmação do Garantidor (ou seu Participante) | | a conta válida/ativa de sua titularidade em que os ativos serão transferidos |
|---|--|--|

A relação dos ativos a serem liberados deve constar no formulário “Notificação de Vencimento Antecipado” no campo específico para tal. Em caso de indicação de mais ativos, qualquer documento apartado poderá ser usado como complemento, desde que enviado juntamente com a referida notificação preenchida.

Na hipótese de excesso de garantia, o excedente será devolvido para o Garantidor da operação respeitando as definições de horário de recebimento do formulário “Notificação de Vencimento Antecipado”, em sua Conta 62 – Conta de Alocação e/ou análoga Conta 27 – Conta Cessão Fiduciária Alocação com Interveniente Cetip, conforme aplicabilidade.

RESUMO - ETAPAS DO PROCESSO DE LIBERAÇÃO DE GARANTIAS.

Em resumo, a Cetip realizará as seguintes atividades, mediante recebimento do formulário “Notificação de Vencimento Antecipado”:

- I. Identificação da parte solicitante;
- II. Identificação da contraparte informada no formulário “Notificação de Vencimento Antecipado”;
- III. Verificação da definição do Notificador, observado o disposto na Seção 1.2 – Notificador;
- IV. Verificação da representatividade do envio, se houver;
- V. Conferência do preenchimento completo do formulário “Notificação de Vencimento Antecipado”;
- VI. Conferência da assinatura do formulário “Notificação de Vencimento Antecipado”;
- VII. Comunicação às áreas da Cetip sobre o recebimento do formulário “Notificação de Vencimento Antecipado”;
- VIII. Comunicação imediata ao Garantidor – ou ao Participante que preste serviços ao Garantidor, quando aplicável – sobre o recebimento do formulário “Notificação de Vencimento Antecipado”, exceto nos casos em que houver confirmação do Garantidor;
- IX. Liberação das garantias pela Cetip, conforme solicitação feita pelo Notificador na “Notificação de Vencimento Antecipado”.