

MANUAL DE
NORMAS ATUAÇÃO
DA CETIP COMO
AGENTE DE
CÁLCULO MANUAL
DE NORMAS
ATUAÇÃO DA B3
COMO AGENTE DE
CÁLCULO

MANUAL DE NORMAS

ATUAÇÃO DA [CETIP-B3](#) COMO AGENTE DE CÁLCULO

ÍNDICE

CAPÍTULO I – DO OBJETIVO	3
CAPÍTULO II – DAS DEFINIÇÕES	3
CAPÍTULO III – DAS METODOLOGIAS DE CÁLCULO, DOS MODELOS DE CÁLCULO E DAS FONTES DE DADOS UTILIZADOS PELA B3 NA MARCAÇÃO A MERCADO	4
CAPÍTULO IV – DA INDICAÇÃO, DA SUBSTITUIÇÃO, DA DESTITUIÇÃO E DA RENÚNCIA DA B3 COMO AGENTE DE CÁLCULO	4
Seção I – Da Indicação da B3 como Agente de Cálculo	4
Seção II – Da Substituição e da Destituição da B3 como Agente de Cálculo	54
Seção III – Da Renúncia da B3 da Função de Agente de Cálculo	5
CAPÍTULO V – DO REGISTRO DO PREÇO OU DO VALOR APURADO NA MARCAÇÃO A MERCADO NO MID	5
CAPÍTULO VI – DAS TAXAS E DOS DEMAIS CUSTOS DEVIDOS POR PARTICIPANTE VINCULADO QUE INDIQUE A B3 COMO AGENTE DE CÁLCULO	5
CAPÍTULO VII – DAS DISPOSIÇÕES GERAIS.....	65

MANUAL DE NORMAS

ATUAÇÃO DA [CETIP-B3](#) COMO AGENTE DE CÁLCULO

CAPÍTULO I – DO OBJETIVO

Artigo 1º

O presente Manual de Normas é instituído pela [CETIP S.A. – BALCÃO ORGANIZADO DE ATIVOS E DERIVATIVOS \(“CETIP”\)B3 – S.A. BRASIL, BOLSA, BALCÃO](#), com o objetivo de descrever as regras e os aspectos específicos pertinentes à sua atuação como Agente de Cálculo.

§1º – Na função de Agente de Cálculo, a [CETIP-B3](#) efetua a Marcação a Mercado de swap, termo ou opção registrado em Sistema (“Operação ~~de~~ [com](#) Derivativo”), bem como do(s) respectivo(s) Ativo(s) Garantidor(es).

§2º – Os tipos de Operação de Derivativo e de Ativo Garantidor para os quais a [CETIP B3](#) pode ser indicada para atuar como Agente de Cálculo são divulgados em Manual de Operações e/ou em Comunicados.

CAPÍTULO II – DAS DEFINIÇÕES

Artigo 2º

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

- I - Alienação/Cessão Fiduciária – a alienação fiduciária e a cessão fiduciária, reguladas pelo Artigo 66-B da Lei nº 4.728/1965, incluído pela Lei nº 10.931/2004, e pelo Decreto-Lei nº 911/1969, sucessivamente complementados pelo disposto nos artigos 1.361 e seguintes do Código Civil Brasileiro.
- II - Ativo Garantidor – o valor mobiliário, título ou outro direito de crédito alienado ou cedido fiduciariamente em garantia de Operação de Derivativo.
- III - ~~Diretor Geral~~[Presidente](#) – o ~~Diretor Geral da CETIP~~[Presidente da B3](#).
- IV - Marcação a Mercado – a atividade que tem como principal objetivo identificar o valor de uma Operação de Derivativo e do(s) respectivo(s) Ativo(s) Garantidor(es) em uma determinada data, utilizando-se modelos matemáticos para esse fim.
- V - MID – Módulo de Informação de Derivativos, integrante do Sistema de Registro.

- VI - Normas ~~da CETIP~~ do Balcão B3 – Regulamento, Manual de Normas, Manual de Operações, Código de Conduta, Comunicado ou ~~Carta~~ Ofício-Circular ~~do Balcão B3~~ expedidos pelo Diretor Geral.
- VII - Operação ~~de com~~ Derivativo – qualquer modalidade de operação com derivativo nos termos da legislação e regulamentação em vigor e swap, a opção ou o termo registrado em Sistema.
- VIII - Participante – o detentor de Direito(s) de Acesso.
- IX - Participante Vinculado – o Participante que seja parte da Operação de Derivativo ou o Participante cujo Cliente seja parte da operação.
- X - Regulamento – o Regulamento da ~~CETIP~~ B3 para Acesso de Participante, para Admissão de Ativo, para Negociação, para Registro de Operação, para ~~Custódia Eletrônica~~ Registro Eletrônico e para Liquidação.
- XI - Sistema do Balcão B3 – o sistema que compreende o Subsistema de Registro, o Subsistema de Depósito Centralizado, o Subsistema de Compensação e Liquidação, os subsistemas integrantes da Plataforma de Negociação do Balcão B3, o serviço computacional para ativos não submetidos a Registro ou a Depósito Centralizado e o Módulo de Distribuição de Ativos - MDA ~~Sistema de Registro, ou o Sistema de Compensação e Liquidação, ou o Sistema de Custódia Eletrônica~~.

CAPÍTULO III – DAS METODOLOGIAS DE CÁLCULO, DOS MODELOS DE CÁLCULO E DAS FONTES DE DADOS UTILIZADOS PELA CETIP-B3 NA MARCAÇÃO A MERCADO

Artigo 3º

As metodologias de cálculo, os modelos de cálculo e as fontes de dados utilizados pela CETIP-B3 na Marcação a Mercado constam do documento “Metodologia CETIP de Marcação a Mercado”.

CAPÍTULO IV – DA INDICAÇÃO, DA SUSSTITUIÇÃO, DA DESTITUIÇÃO E DA RENÚNCIA DA CETIP-B3 COMO AGENTE DE CÁLCULO

Seção I – Da ~~i~~Indicação da CETIP-B3 como Agente de Cálculo

Artigo 4º

O registro de indicação da CETIP-B3 como Agente de Cálculo no MID é permitido para o(s) Participante(s) Vinculado(s) que tenha(m) previamente firmado o Termo de Compromisso e Adesão a este Manual de Normas.

Parágrafo único – As regras e os procedimentos relativos ao registro de indicação da [CETIP-B3](#) como Agente de Cálculo constam do Manual de Normas de Agente de Cálculo e Acelerador e do correspondente Manual de Operações.

Seção II – Da [s](#)Substituição e da [d](#)Destituição da [CETIP-B3](#) como Agente de Cálculo

Artigo 5º

Os procedimentos e as regras pertinentes à substituição e à destituição da [CETIP-B3](#) como Agente de Cálculo constam do Manual de Normas de Agente de Cálculo e Acelerador e do correspondente Manual de Operações.

Seção III – Da [r](#)Renúncia da [CETIP-B3](#) da [f](#)Função de Agente de Cálculo

Artigo 6º

É facultado à [CETIPB3](#), mediante informação ao(s) Participante(s) Vinculado(s) que a tenha(m) indicado como Agente de Cálculo, interromper a prestação desse serviço, a qualquer tempo, para uma ou mais Operações de Derivativos e seu(s) Ativo(s) Garantidor(es).

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

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

Artigo 7º

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

CAPÍTULO VI – DAS TAXAS E DOS DEMAIS CUSTOS DEVIDOS POR PARTICIPANTE VINCULADO QUE INDIQUE A [CETIP-B3](#) COMO AGENTE DE CÁLCULO

Artigo 8º

O(s) Participante(s) Vinculado(s) arcam com as taxas e os demais custos pertinentes à indicação da [CETIP-B3](#) como Agente de Cálculo, conforme tabela de preços, divulgada na página da [CETIP-B3](#) na rede mundial de computadores (www.cetipb3.com.br).

Artigo 9º

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

CAPÍTULO VII – DAS DISPOSIÇÕES GERAIS

Artigo 10

~~O Diretor Geral~~A Diretoria Colegiada é competente para dirimir eventuais ~~dúvidas ou emissões deste instrumento, através de Norma da CETIP,~~ decorrentes do disposto neste Manual de Normas ou de casos omissos, por meio de Ofício Circular ou outros instrumentos cujo conteúdo, para todos os efeitos, complementando complementará o disposto neste Manual de Normas.

Artigo 11

O presente Manual de Normas cancela e substitui o Manual de Normas Atuação Cetip como Agente de Cálculo em vigor desde 21 de junho de 2010.

~~Artigo 11~~Artigo 12

Este Manual de Normas entra em vigor na data de ~~21-31~~ de ~~junho-julho~~ de ~~2010~~2023.