

SND

Instrução aos Emissores



Versão: 03/07/2008

MANUAL DE OPERAÇÕES

Índice

Introdução	3
Familiarizando-se com as funções	4
Menu de Funções (Menu 00)	4
Menu de Negociação (Menu 10)	5
Registro de Negócio de Participante (SND 11)	6
Operações Disponíveis na Função SND 11 - Registro de Negócio/Caução	8
Caução (Operação 013)	10
Compra/Venda Definitiva (Operação 052)	11
Registro de Operações Compromissadas	16
Retenção de Imposto de Renda (Operação 064)	17
Cancelamento de Registro (Função SND12)	19
Correção de Lançamento (Função SND 15)	21
Registros Confirmados (Função SND 1A)	23
Registros Pendentes (Função SND 1B)	24
Ativos em caução (Função SND 1G)	25
Previa de Emissores (Função SND 1I)	26
Menu Posição de Ativo (Menu 20)	28
Depósito sem Financeiro (SND 21)	29
Depósito / Retirada / Conversão / Permuta (Função SND 21)	29
Posição de Ativo (Função SND 2A)	34
Movimentação de Participante (Função SND 2C)	35
Menu de funções (Menu 40)	36
Relação de Emissores (Função SND 41)	37
Características do Emissor (Função SND 42)	38
Características do Ativo (Função SND 43)	39
PU de Eventos (Função SND 44)	40
PU da Curva (Função SND 45)	41
Agenda de Eventos (Função SND 46)	42
Relação de Participantes (Função SND 48)	43
Flutuações de Taxas (Função SND 49)	44
Negócios do Ativo (Função SND 4A)	45
Negócios na Data (Função SND 4B)	46
Relação de Ativos/ISIN (Função SND 4C)	47
Diário (Função SND 4D)	48
Menu de Comandos do Emissor de Debêntures (Menu 60)	49
Lançamento de PU de Eventos (SND 68)	50
Financeiro de Eventos (SND 6F)	54

Introdução

Este manual tem como objetivo colocar diretamente à disposição do Emissor de Debêntures ou através do seu Banco Mandatário, informações referentes às operações próprias admitidas no SND - Módulo Nacional de Debêntures.

O lançamento de PU's e operações de venda/compra definitivas são algumas das operações que o emissor de debêntures pode fazer diretamente no SND.

Observação: O presente manual tem o objetivo de orientar os participantes sobre todas as funcionalidades e operações acima descritas.

Familiarizando-se com as funções

Menu de Funções (Menu 00)

Menu que relaciona os grupos de funções disponíveis aos emissores.

```
*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SMD
MENU DE FUNCOES
-----
00 - Menu de funcoes
10 - Negociacao                                60 - Comandos do Emissor
20 - Posicao de ativo                          90 - Transferencia de Arquivos
40 - Consultas
99 - Encerrar
-----
Indique o codigo da opcao desejada ▶ ◀
SND00B ATIVO ▶ ◀ DATA/N.OPER.▶ ◀ M.M. ▶ ◀ xmit▶ ◀
53 21 Pg=1 FORM RCV LTAI
```

Observação: No menu 90 estão disponíveis somente as funções de consulta. As funções SND92 e SND93, assim como os *layouts* e procedimentos, encontram-se detalhadas no Manual de Transferência de Arquivos – opção Enviar Arquivos, disponível no site www.cetip.com.br, na seção Documentação.

Menu de Negociação (Menu 10)

Relaciona o grupo de funções de registro e consultas de negócios.

```
08.03.2004          *** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          ↕SND↔
                                MENU DE NEGOCIACAO
-----
Operacoes                00 - Menu de funcoes                Consultas
-----                -----
10 - Menu de negociacao                1A - Registros confirmados
11 - Registro de negocio                1B - Registros pendentes
12 - Cancelamento de registro          1C - Op. comprom. Pre fixadas
15 - Correcao de Lancamento            1D - Op. comprom. Pos fixadas
17 - Operacoes comp. pendentes do dia   1G - Ativos em caucao
                                           1H - Credito de eventos
                                           1I - Previa de emissores
                                           1L - Credito eventos (CENTRAL)
                                           1M - Erros de Mensageria
                                           1S - Oper. em Reserva Tecnica
                                           99 - Encerrar
-----
Indique o codigo da opcao desejada ▶ ◀
SRN10B ATIVO ▶ ◀ DATA/N. OPER. ▶ ◀ M.M. ▶ ◀ xmit▶ ◀
```

Registro de Negócio de Participante (SND 11)

Após selecionar a função SND11 no Menu de Negociação, são visualizados os tipos de operações disponíveis.

Ao assinalar o código da operação desejada, é aberta nova tela SND11 contendo todos os campos que devem ser preenchidos conforme o tipo de operação.

```

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SND11
07.05.2008
REGISTRO DE NEGOCIO DO PARTICIPANTE

Codigo da Operacao      )  <

003 - Retorno de Caucao          075 - Transf. Titulos ( Bolsa )
013 - Caucao                    077 - Transf. Titulos entre Clientes
023 - Vinculacao de Reserva Tecnica  352 - Compra/Venda Definitiva Retro.
035 - Antec. de Desvinc. Reserva Tecnica  354 - Compromissada Prefixada Retro.
052 - Compra/Venda Definitiva        355 - Antecip. e Compromisso Retro.
053 - Transf. Especial (Cta MV)       357 - Compromissada Pos fixada Retro.
054 - Compromissada Prefixada        554 - Doc. Transf. Registro Titulos
055 - Antecipacao de Compromisso
057 - Compromissada Pos fixada
064 - Retencao de I.R.
071 - Transf. Especial ( Conta Margem )

SND11                                           xmit
  
```

```

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SND11
07.05.2008
REGISTRO DE NEGOCIO DO PARTICIPANTE - 99999005

CONTRAPARTE:  )  <
Codigo da Operacao  )013<
Numero da Operacao  )  < /0 - Repasse
Tipo da Operacao    )  < --< 1 - Venda
                   )  < \2 - Compra

Ativo              )  <
Quantidade/Qty a Antecipar  )  < PU )  <
Numero da Operacao Original  )  < Data da Operacao Original )  <
Direitos p/ Caucionante     )  < S-Sim Data do Compromisso )  <
                             )  < N-Nao

PU do Comp./Ida          )  <
Modalidade de Liquidacao )  < 1 - CETIP
                             )  < 2 - Bruto

Banco Liquidante        )  < Data de Agendamento )  <
                             )  < Data de Liquidacao )  <

Numero de associacao     )  <

SRN11A                                           Voltar )  < xmit )  <
  
```

Para o registro de cada tipo de operação devem ser obedecidas as regras em relação à modalidade de liquidação permitida e aos horários definidos.

Os lançamentos incorretos criticados ou incompatibilizados quando efetuado o duplo comando são visualizados na função SND15, onde devem ser corrigidos.

As operações ainda pendentes são visualizadas na função SND1B e aquelas atualizadas, com status finais, na SND1A.

Operações Disponíveis na Função SND 11 - Registro de Negócio/Caução

Para as operações referentes a Função SND 11 é apresentada a tela abaixo.

```

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          ↕SND↕11↕
07.05.2008
REGISTRO DE NEGOCIO DO PARTICIPANTE - ▶99999005↕
-----
CONTRAPARTE: ▶ ◀
Codigo da Operacao ▶ ◀
Numero da Operacao ▶ ◀ /0 - Repasse
Tipo da Operacao ▶ ◀ --◀ 1 - Venda
                    \2 - Compra

Ativo ▶ ◀
Quantidade/Qtd a Antecipar ▶ ◀ PU ▶ ◀
Numero da Operacao Original ▶ ◀ Data da Operacao Original ▶ ◀
Direitos p/ Caucionante ▶ ◀ S-Sim Data do Compromisso ▶ ◀
                        N-Nao
PU do Comp./Ida ▶ ◀
Modalidade de Liquidacao ▶ ◀ 1 - CETIP
                        2 - Bruto

Banco Liquidante ▶ ◀ Data de Agendamento ▶ ◀
Data de Liquidacao ▶ ◀
Numero de associacao ▶ ◀

SRN11A Volt ▶ ◀ xmit▶ ◀

```

Os campos dessa tela devem ser preenchidos de acordo com os dados referentes a operação escolhida.

Descrição dos campos da Tela SND11

Campo	Descrição
Participante	Código CETIP do Participante.
Contraparte	Código CETIP da contraparte com quem foi efetuada a operação.
Cod. Operação	Código que identifica a operação
Nº Operação	Número atribuído à operação. Ver observação abaixo.
Tipo Operação	0 – Repasse; 1 – Venda de posição própria; 2 – Compra;
Ativo	Código identificador do ativo.
Quantidade	Quantidade / Qtd. a antecipar do ativo.
PU	Preço unitário do ativo com até 10 (dez) números inteiros e 6 (seis) casas decimais.
Nº Operação Orig.	Número atribuído à operação original.
Data Opera. Orig.	Data da operação original. Formato: DDMMAAAA.
Direitos p/ Caucionante	S (sim), caucionante tem direito ao crédito de eventos que não acarretem alteração do principal. N (não), caucionante não tem direito ao crédito de eventos. Somente preencher quando código de operação for 013.
Data Compromisso	Data do vencimento da operação. Formato: DDMMAAAA.
PU Compromisso	Preço unitário do ativo na data do compromisso com até 10 (dez) números inteiros e 6 (seis) casas decimais.
Modalidade de Liquidação	Modalidade na qual a operação é liquidada financeiramente. 1 – Cetip; 2 – Bruta;
Banco Liquidante	Banco liquidante do Participante.
Data de Agendamento	Data do agendamento. Formato: DDMMAAAA.
Data de Liquidação	Data de liquidação. Formato: DDMMAAAA.
Número de Associação	Número de operação utilizado exclusivamente nas operações de intermediação . Somente deve ser informado pelo Participante intermediador, identificado pelo tipo de conta 69.

Observação:

A faixa de Valores entre 8.000 a 8.999 é utilizada para representar operações geradas automaticamente pela Plataforma de Negociação CETIPNET, e a faixa de valores entre 9.000 a 9.999, destinados às operações geradas no MMG (**Módulo de Manutenção de Garantias**) devido a isso, esses valores não podem ser atribuídos, pelo Participante, ao campo **Número da operação**.

Caução (Operação 013)

A caução de ativos é efetuada por duplo comando entre o caucionário (conta 60) e o caucionante. Quando do lançamento da operação, as partes devem indicar a quem são atribuídos os créditos referentes aos títulos dados em caução na ocorrência de eventos, que não acarretem em alteração do principal, tais como juros.

Os eventos de resgate, bem como os que acarretem em alteração do principal, tais como atualização monetária e amortização, têm seus créditos efetuados **necessariamente** na conta do caucionário (conta 60).

Não é permitida a retirada, pelo caucionário (conta 60), de títulos de sua posição própria, recebidos em caução.

Compra/Venda Definitiva (Operação 052)

Função onde o Participante comanda a operação de compra ou venda definitiva, de acordo com as condições específicas do ativo.

Nas operações de compra e venda definitivas e compromissadas, inclusive nas retroativas onde uma das partes seja um cliente 1, o preenchimento do campo PU também é obrigatório.

Operação de Intermediação no Mercado Secundário

A intermediação praticada no âmbito da CETIP é a atividade em que um Participante atua entre as partes de uma negociação, de modo a auferir resultado financeiro positivo ou nulo, sem a assunção, relativamente às obrigações inerentes à operação, de qualquer tipo de risco de crédito, de mercado ou de liquidez.

Caracteriza-se como intermediação a associação de uma operação de compra definitiva com uma de venda definitiva de títulos efetuada pelo Participante Intermediador, identificado pela conta XXXXX.69-X, com liquidação financeira pela modalidade Bruta no STR.

Participante Intermediador:

- Banco Múltiplo com carteira comercial e /ou de Investimento;
- Banco Comercial;
- Banco de Investimento;
- Sociedade Corretora de Títulos e Valores Mobiliários;
- Sociedade Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários;

Cada intermediação admite até dois Participantes intermediadores e cada cadeia de intermediação deve observar as seguintes condições:

- Mesmo ativo e quantidade;
- Preço de venda pelo intermediador deve ser maior ou igual ao da compra;
- O Banco Liquidante do intermediador deve ser o mesmo.

A conta de intermediação nunca apresenta posição de custódia e saldo financeiro devedor.

Lançamento com 1 (um) intermediador:

PONTA LANÇADORA		CAMPO NA TELA 11		
		OPERAÇÃO	CONTRAPARTE	NUM. ASSOCIAÇÃO
Operação de COMPRA	<i>Vendedor original</i>	052	Conta 69 do Participante Intermediador	Não preencher
	Participante Intermediador na ponta compradora, utilizando-se da sua conta 69.	052	Conta do Vendedor	Preencher com o mesmo número de Associação informado na Operação de Venda
Operação de VENDA	Participante Intermediador na ponta vendedora, utilizando-se da sua conta 69.	052	Conta do Comprador Final	Preencher com o mesmo número de Associação informado na Operação de compra
	<i>Comprador Final</i>	052	Conta 69 do Participante Intermediador	Não preencher

Lançamento com 2 (dois) Intermediadores:

PONTA LANÇADORA		CAMPO NA TELA 11		
		OPERAÇÃO	CONTRAPARTE	NUM. ASSOCIAÇÃO
Operação de COMPRA	<i>Vendedor original</i>	052	Conta 69 do Participante Intermediador 1	Não preencher
	Participante Intermediador 1 na ponta compradora, utilizando-se da sua conta 69.	052	Conta do Vendedor	Preencher com o mesmo número de Associação informado na Operação de Venda para o Intermediador 2

(Continua)

PONTA LANÇADORA		CAMPO NA TELA 11		
		OPERAÇÃO	CONTRAPARTE	NUM. ASSOCIAÇÃO

Operação entre Intermediários	Participante Intermediador 1 na ponta vendedora, utilizando-se da sua conta 69.	052	Conta 69 do Participante Intermediador 2	Preencher com o mesmo número de Associação informado na Operação de COMPRA do Vendedor Original
	Participante Intermediador 2 na ponta compradora, utilizando-se da sua conta 69.	052	Conta 69 do Participante Intermediador 1	Preencher com o mesmo número de Associação informado na Operação de VENDA para o Comprador Final
Operação de VENDA	Participante Intermediador 2 na ponta vendedora, utilizando-se da sua conta 69.	052	Conta do Comprador Final	Preencher com o mesmo número de Associação informado na Operação de Compra do Intermediador 1
	<i>Comprador Final</i>	052	Conta 69 do Participante Intermediador 2	Não preencher

Cada intermediação é identificada por um número de associação. Desta forma, o intermediador não pode usar o mesmo número de associação para intermediações distintas. Na cadeia de intermediação composta por dois Participantes Intermediadores, cada um deles deve indicar um número de associação, nas suas operações de compra e de venda, não sendo obrigatório que referidos números sejam iguais para os dois Intermediadores.

Ex:

Partes	Vendedor	Intermediador 1
Num. Operação	10	10
Num. Associação	n/a	1

Partes	Intermediador 1	Intermediador 2
Num. Operação	20	20
Num. Associação	1	2

Partes	Intermediador 2	Comprador
Num. Operação	30	30
Num. Associação	2	n/a

As partes que compõem uma cadeia de Intermediação devem ser, necessariamente, Participantes diferentes.

Não é exigida a ordem no lançamento das operações. Assim, a primeira operação a ser confirmada por duplo comando assume o status "PENDENTE DE ASSOCIAÇÃO", sendo possível a sua visualização na tela SND1B, aguardando a confirmação das demais operações. Apenas quando da confirmação de todas as operações da cadeia, é efetuada as críticas pertinentes à intermediação.

Caso uma destas críticas não seja observada, todas as operações são consideradas incompatíveis, sendo disponibilizadas para acerto, por todas as partes envolvidas, na tela SND15. Neste momento, não mais são visualizadas na tela SND1B.

Uma vez cumpridas as críticas, o ativo é bloqueado na posição do vendedor original e o status de todas as operações é alterado para "PENDENTE DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA".

Na hipótese do vendedor original não possuir em custódia o montante requerido de títulos, a operação de compra com Intermediação é cancelada por falta de saldo, assumindo o status "REJ AUTOMAT: SEM SALDO". As demais operações permanecem com o status "PENDENTE DE ASSOCIAÇÃO", aguardando nova operação de compra.

É permitido o estorno por duplo comando, enquanto a operação encontrar-se com status "PENDENTE DE ASSOCIAÇÃO".

É permitido o estorno por duplo comando, enquanto a operação encontrar-se com status "PENDENTE DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA". Neste caso, quando uma das operações da cadeia de intermediação for estornada, as demais operações são automaticamente estornadas, assumindo o status conforme abaixo:

Cancelamento de Operação 052 cujo vendedor é o Intermediador do ativo:

A operação de estorno (152), após o duplo comando, assume o status "AGUARDANDO CONF ESTORNO".

- Se não aceita, por já ter sido liquidada financeiramente ou por ter encerrado o horário para lançamento na modalidade Bruta, a operação assume o status "OPERAÇÃO NÃO PERMITIDA".
- Se aceito o cancelamento, a operação de estorno (152) assume o status "FINALIZADA". A operação efetivamente cancelada (052) assume o status "EST: COMANDADA", porém sem movimentação de custódia. A(s) outra(s) operação(ões) da cadeia (052) têm o status alterado para "EST: CADEIA CANCELADA", sendo efetuado o desbloqueio do ativo na posição do vendedor original.

Cancelamento da Operação 052 cujo vendedor é o detentor do ativo:

A operação de estorno (152), após o duplo comando, assume o status "AGUARDANDO CONF ESTORNO".

- Se não aceita, por já ter sido liquidada financeiramente ou por já ter encerrado o horário para lançamento na modalidade Bruta, a operação assume o status "OPERAÇÃO NÃO PERMITIDA".
- Se aceito o cancelamento, operação de estorno (152) assume o status "FINALIZADA". A operação efetivamente cancelada (052) assume o status "EST: COMANDADA", sendo efetuado o desbloqueio do ativo. A(s) outra(s) operação(ões) da cadeia (052) tem o status alterado para "EST: CADEIA CANCELADA", porém sem movimentação de custódia.

Ao final do dia, as operações com status "PENDENTE DE ASSOCIAÇÃO" são rejeitadas, assumindo o status "REJ: TIMEOUT LANÇAMENTO ASSOC".

O processo de Liquidação Financeira segue as etapas abaixo:

- A CETIP envia ao Banco Liquidante do Comprador Final a mensagem LTR0001 com o valor financeiro total da compra;
- O Banco Liquidante do comprador final pode confirmar ou divergir deste pagamento através da mensagem LTR0002 ou de tela específica no NoMe. Em caso afirmativo, deve enviar ao STR o pagamento através da mensagem LTR0004;
- Quando do recebimento da mensagem LTR0004R2, confirmando o depósito por parte do Banco Liquidante, a CETIP envia mensagens LTR0005 ao STR: uma, creditando o Banco Liquidante do Vendedor Original pelo valor financeiro total da venda e outra(s), creditando o Banco Liquidante do(s) Intermediador(es) com o resultado financeiro apurado pela diferença entre a Operação de Venda e a de Compra. Nesta(s) última(s), no campo *NumOpLTR* esta indicado o número da associação; e
- Caso a posição financeira do(s) Participante(s) Intermediador(es) seja zero, a CETIP não envia a mensagem LTR0005 ao Banco Liquidante.

Ainda que o Banco Liquidante seja o mesmo para todos os Participantes envolvidos, a liquidação financeira necessariamente se dá através da Conta de Liquidação da CETIP no STR.

Quando a Cetip receber a mensagem LTR0004R2, o ativo é transferido da posição bloqueada do Vendedor Original para a posição livre do Comprador Final, sem trânsito pela custódia da conta do(s) Intermediador(es). As operações são visualizadas na tela SND1A, com o status "FINALIZADA".

No caso em que o Banco Liquidante do Comprador Final divergir ou não efetuar o pagamento, todas as operações que compõem a cadeia de intermediação são estornadas, automaticamente, assumindo os status "EST: NÃO CONF BL" e "EST: TIMEOUT LIQ BL", respectivamente.

Registro de Operações Compromissadas

Tipo de Operação Compromissada Disponibilizada pela CETIP

A CETIP disponibiliza, para as instituições habilitadas junto ao Banco Central a realizar operações compromissadas, a operação de venda com compromisso de recompra para liquidação em data preestabelecida, observado que tal data está limitada ao dia útil anterior à data de vencimento do título ou do valor mobiliário objeto do compromisso.

Crédito dos Eventos Relativos ao Título ou Valor Mobiliário Objeto de Operação de Venda com Compromisso de Recompra.

Os eventos relativos ao título ou ao valor mobiliário objeto da operação compromissada são automaticamente creditados, nas datas dos respectivos pagamentos, ao Participante que tenha efetuado a primeira venda com compromisso de recompra, sendo responsabilidade exclusiva das partes contratantes verificar a adequação do volume do lastro, na hipótese de ocorrerem amortizações de principal ao longo da vigência da operação.

Lançamentos de Confirmação ou de Preço Unitário de Operação de Venda com Compromisso de Recompra.

Na data de vencimento de operação compromissada remunerada:

- à taxa prefixada, o Participante que assumiu o compromisso de recompra deve efetuar lançamento confirmando a correspondente liquidação financeira; e
- à taxa posfixada, ambos os Participantes envolvidos na operação devem lançar o preço unitário do valor a ser liquidado.

O Participante que deixar de efetuar o lançamento de confirmação ou de preço unitário, acima mencionados, incide em Inadimplência Regulamentar, ficando sujeito às penalidades previstas no Regulamento, na forma determinada pelo Diretor Geral.

Procedimento Adotado pela CETIP, na Data de Vencimento de Operação Compromissada, se o Participante que Assumiu o Compromisso de Recompra, ou que tenha Cliente que Assumiu tal Compromisso, não Efetuar o Lançamento de Confirmação ou do Preço Unitário, ou Efetuar tal Lançamento mas não Liquidar Financeiramente a Recompra.

1) se o título ou o valor mobiliário envolvido na operação compromissada tiver sido objeto de uma única venda com compromisso de recompra

O objeto do compromisso será transferido da posição de Repasse da Conta Própria do Participante revendedor ou, conforme o caso, da posição de Repasse da Conta de Cliente do Participante que tenha Cliente revendedor, para a posição Própria Livre da Conta Própria deste Participante, ou para a posição Própria Livre da Conta de Cliente deste Participante.

2) Se o título ou valor mobiliário envolvido na operação compromissada tiver sido objeto de mais de uma venda com compromisso de recompra, formando uma "cadeia" de operações

A situação será avaliada pelo Diretor Geral, na forma do disposto no inciso XI do artigo 13 do Regulamento da CETIP para Acesso de Participante, para Admissão de Ativo, para Negociação, para Registro de Operação, para Custódia Eletrônica e para Liquidação, de 27 de janeiro de 2009.

Procedimento Adotado pela CETIP na Eventualidade de, no Curso da Operação Compromissada, o Participante que Assumiu o Compromisso de Recompra Entrar em Regime de Liquidação Extrajudicial

Na eventualidade acima mencionada, a CETIP adotará os procedimentos que forem determinados pelo correspondente órgão regulador.

Retenção de Imposto de Renda (Operação 064)

Função de transferência de valores, referentes ao IR, cujo cálculo, retenção e recolhimento são de responsabilidade do emissor.

Evento gerador da retenção: eventos automáticos na modalidade Janela Multilateral CETIP.

A operação é comandada unilateralmente pelo emissor, exclusivamente no dia da liquidação financeira do evento gerador da retenção, quando eventos pagos a Participantes pessoas jurídicas não financeiras.

Nessa operação o Banco Liquidante do emissor e do Participante pessoa jurídica não financeira é sempre o principal.

A operação somente pode ser liquidada financeiramente através da modalidade Janela Multilateral CETIP, a mesma modalidade do evento gerador da retenção do imposto.

No registro da operação de IR, o emissor deve preencher o campo "Número da operação original" com o número da operação do evento sobre o qual incide a retenção do imposto.

É admitida apenas um lançamento de IR para cada evento (fator gerador). Caso ocorra erro, o emissor deve estornar o lançamento e efetuar um novo.

A operação de estorno de IR, identificado pelo código de operação 164, pode ocorrer no próprio dia do registro da operação 064, obedecida à grade de horário de registro de operações na modalidade Multilateral Janela CETIP. Somente é possível estornar uma operação de resgate antecipado (operação 014) à qual exista vinculada uma operação de retenção de IR (Operação 064), após o estorno desta última.

O evento pode ser identificado pelo emissor na tela de eventos 11, no próprio dia do evento.

O evento também pode ser identificado na consulta de operações, no NoMe CETIP, no próprio dia do evento ou no dia da liquidação financeira, bastando informar no filtro da consulta, a data de origem dos eventos que se deseja consultar.

No caso dos eventos com liquidação financeira no dia seguinte, o número da operação do evento pode ser obtido também no relatório "Mapa de Movimentação para Simples Conferência – RMAPAMOV".

Obs.: São permitidos apenas lançamentos de operação de "retenção de imposto de renda" quando o Participante for Pessoa Jurídica não Financeira.

Cancelamento de Registro (Função SND12)

Nesta tela o Participante efetua o cancelamento/estorno de todos os tipos de operação, registradas na função SND11, desde que no próprio dia do registro da operação original. O critério de registro por único ou duplo comando é o mesmo adotado na operação original.

Não é possível o estorno de operações já liquidadas financeiramente.

Estorno unilateral pela parte credora de operações a serem liquidadas pela modalidade de liquidação LBTR .

É admitido à parte credora, o direito de estornar unilateralmente uma determinada operação que não tenha sido liquidada financeiramente pelo Banco Liquidante do devedor, decorridos 30 minutos da operação ter assumido o status de "PENDENTE DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA" .

Uma vez efetuado o estorno pela parte credora , a operação assume o status: "EST VEND: SEM LIQ BL".

Tais regras são válidas tanto para as operações registradas pelas partes diretamente nos sistemas de custódia, bem como para as operações provenientes de ofertas fechadas no ambiente do CETIPNET.

```
*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          ↕SND↔12↔
                                     CANCELAMENTO DE REGISTRO DO PARTICIPANTE ▶32121414↔
-----
Comprador                ▶77770004↔
Vendedor                 ▶32121414↔
Ativo                    ▶GGGG11  ↔
Numero da operacao original ▶0013↔
Numero da operacao       ▶0014↔
Data agendamento op. original ▶      ↔
-----
SRN12                                                            xmit▶↔
-----
54 17 Pg=1 FORM LOC LTAI
```

Descrição dos campos

Campo	Descrição
Participante	Código CETIP do Participante.
Comprador	Código do Participante comprador.
Vendedor	Código do Participante vendedor.
Ativo	Código identificador do ativo com até 6(seis) caracteres, sendo que os 4(quatro) primeiros identificam o emissor e os 2(dois) últimos, a série e a emissão.
Número da Operação Original	Número da operação original que está sendo cancelada.
Número da Operação	Número da operação do cancelamento.
Data agendamento op. original	Data de agendamento da operação que está sendo cancelada. Formato: DDMMAAAA

Correção de Lançamento (Função SND 15)

Nesta função são visualizados os lançamentos incorretos, registrados na função SND11, criticados ou incompatibilizados quando efetuado o duplo comando.

A correção ou a exclusão do erro somente pode ser efetuada pelo usuário que registrou o lançamento ou pelo usuário supervisor da instituição.

```

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SND15
08.05.2008
CORRECOES DE LANCAMENTOS DO PARTICIPANTE 00126609 Lanc 99999005 ULYSSE
                                                12:08:43
-----
CONTRAPARTE
Codigo da Operacao      003
Numero da Operacao
Tipo Op. (0,1,2)
Ativo
Quantidade/Qtd a Antecipar
P.U.
Numero da Operacao Original
Data da Operacao Original
Direitos p/ Cauçionante
Data do Compromisso
PU do Comp./Ida
Modalidade de Liquidacao
Banco Liquidante
Data de Agendamento
Data de Liquidacao
Numero de Associacao
-----
SRN15                                     Alt Exc Salto xmit
  
```

Descrição dos campos

Campo	Descrição
Participante	Código CETIP do Participante.
Contraparte	Código CETIP da contraparte com quem foi efetuada a operação.
Cod. Operação	Código que identifica a operação
Nº Operação	Número atribuído à operação.
Tipo Operação	0 – Repasse; 1 – Venda de posição própria; 2 – Compra;
Ativo	Código identificador do ativo.
Quantidade	Quantidade / Qtd. a antecipar do ativo.
PU	Preço unitário do ativo com até 10 (dez) números inteiros e 6 (seis) casas decimais.
Nº Operação Orig.	Número atribuído à operação original.
Data Opera. Orig.	Data da operação original. Formato: DDMMAAAA.
Direitos p/ Caucionantes	Campo de uso exclusivo para operação de caução. Preencher com S (Sim) ou N (Não).
Data Compromisso	Data do vencimento da operação. Formato: DDMMAAAA.
PU Compromisso	Preço unitário do ativo na data do compromisso com até 10 (dez) números inteiros e 6 (seis) casas decimais.
Modalidade de Liquidação	Código da modalidade de liquidação.
Banco Liquidante	Banco liquidante do Participante.
Data de Agendamento	Data do agendamento. Formato: DDMMAAAA.
Data de Liquidação	Data de liquidação. Formato: DDMMAAAA.
Número de Associação	Número que permite associar operações que devem ser "avaliadas" em conjunto, isto é, somente se todas forem aceitas.

Registros Confirmados (Função SND 1A)

A função permite que o Participante consulte suas operações registradas na função SND11 já atualizadas, com status finais.

Na tela principal são visualizados os principais campos das operações e ao assinalar com [X] o campo "Det", é exibida tela de detalhe, com todos os campos editados da operação selecionada.

O campo "Liq" indica se a liquidação financeira ocorre em D0 ou em D1.

```

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SND1A
REGISTROS CONFIRMADOS DO PARTICIPANTE 74440603

Det Contrap. Ativo Oper. Mod Data Reg. Liq. Quantid. No.oper. T0p
No.Assoc Status
▶◀ 68702106 GGGG11 052 0 23/08/2002 D0 50 0010 VTP
EST.COMANDADA
▶◀ 68702106 GGGG18 052 0 23/08/2002 D0 25 0015 VTP
FINALIZADA
▶◀ 68702106 GGGG22 052 0 23/08/2002 D0 45 0022 VTP
FINALIZADA
▶◀ 68702106 GGGG25 052 2 29/08/2002 D0 67 0024 VTP
FINALIZADA
▶◀ 74440005 GGGG32 052 2 29/08/2002 D0 54 0001 VTP
FINALIZADA
▶X◀ 74440005 GGGG36 052 2 03/09/2002 D0 45 0005 VTP
FINALIZADA
▶◀ 74440005 GGGG44 052 2 03/09/2002 D0 82 0013 VTP
FINALIZADA

SRN1AB ATIVO ▶ DATA/N. OPER. ▶ M.M. ▶ P/paginar
xmit ▶
4 18 Pg=1 NORM LOC LTAI
  
```

```

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SND1A
23.08.2002
REGISTROS CONFIRMADOS DO PARTICIPANTE 68702003

CONTRAPARTE: 74440005 - BANCO PARTICIPANTE B S/A
Codigo da Operacao: 057 - COMPRA/VENDA COMPROMISSADA SEM PU
Numero da Operacao: 0005
Tipo da Operacao : 1 - VENDA

Ativo: GGGG11 Data de Registro: 23/08/2002
Quantidade/Qty a Antecipar : 50 PU: 123,321000
Valor da operacao: 6.166,05

Numero da Operacao Original: Data da Operacao Original:
Direitos p/ Caucionante :
Data do Compromisso : 27/08/2002
PU do Compromisso / Ida :

Modalidade de Liquidacao: 2 - BRUTA
Banco Liquidante : 73330006 Data de Agendamento :
Data de Liquidacao : 23/08/2002 Numero de Associacao:
Status desde 17:38:07:50: 43 - FINALIZADA

SRN1AD xmit ▶
  
```

Registros Pendentes (Função SND 1B)

A função permite que o Participante consulte suas operações registradas na função SND11 ainda pendentes.

Na tela principal são visualizados os principais campos das operações e ao assinalar com [X] o campo "Det", é exibida tela de detalhe, com todos os campos editados da operação selecionada.

O campo "Liq" indica se a liquidação financeira ocorre em D0 ou em D1.

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***										
REGISTROS PENDENTES DO PARTICIPANTE 74440603										
Det	Contrap.	Ativo	Oper.	Mod	Data	Reg.	Liq.	Quantid.	No.oper.	T0p
▶◀	68702106	GGGG11	052	0	23/08/2002	D0		50	0010	VTP
										PENDENTE LIQ FINANCEIRA
▶◀	68702106	GGGG18	052	0	23/08/2002	D0		25	0015	VTP
										PENDENTE LIQ FINANCEIRA
▶◀	68702106	GGGG22	052	2	23/08/2002	D0		45	0022	VTP
										PENDENTE LIQ FINANCEIRA
▶◀	68702106	GGGG25	052	2	29/08/2002	D0		67	0024	VTP
										PENDENTE LIQ FINANCEIRA
▶◀	74440005	GGGG32	052	2	29/08/2002	D0		54	0001	VTP
										PENDENTE LIQ FINANCEIRA
▶X◀	74440005	GGGG36	052	2	03/09/2002	D0		45	0005	VTP
										PENDENTE LIQ FINANCEIRA
▶◀	74440005	GGGG44	052	2	03/09/2002	D0		82	0013	VTP
										PENDENTE LIQ FINANCEIRA

SRN1AB ATIVO ▶ ◀ DATA/N.OPER. ▶ ◀ M.M. ▶ ◀ P/paginar xmit ▶ ◀

66 20 Pg=1 NORM LOC LTAI

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***	
23.08.2002	
REGISTROS PENDENTES DO PARTICIPANTE 68702003	
CONTRAPARTE: 88269007 - SEGURADORA PARTICIPANTE J LTDA Codigo da Operacao: 052 - COMPRA/VENDA DE ATIVOS Numero da Operacao: 0003 Tipo da Operacao : 2 - COMPRA	
Ativo: GGGG11	Data de Registro: 23/08/2002
Quantidade/Qtd a Antecipar : 50	PU: 123,321000
Valor da operacao: 6.166,05	
Numero da Operacao Original:	Data da Operacao Original:
Direitos p/ Caucionante :	
Data do Compromisso :	
PU do Compromisso / Ida :	
Modalidade de Liquidacao: 2 - BRUTA	
Banco Liquidante : 73330006	Data de Agendamento :
Data de Liquidacao : 23/08/2002	Numero de Associacao:
Status desde 11:46:04:79: 23 - PENDENTE LIQ FINANCEIRA	
SRN1AD	xmit ▶ ◀

Ativos em caução (Função SND 1G)

Nesta função, o Participante caucionante e o caucionário (titular da conta 60) podem consultar todas as operações de caução registradas.

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***						
ATIVOS EM CAUCAO DO PARTICIPANTE 74440603						
Ativos	Dir	N.op	Contrap.	-----Original-----	Data	Qtde.
GGGG11	N	0039	68702003		23/08/2002	20

SRN1G	ATIVO ▶	◀ DATA/N.OPER. ▶	◀ M.M. ▶	P/paginar xmit▶◀
37 12 Pg=1 NORM LOC LTAI				

Previa de Emissores (Função SND 11)

A função permite ao emissor consultar os débitos referentes ao pagamento de eventos de ativos de sua emissão, gerados automaticamente para o próprio dia. O campo "Liq" indica se a liquidação financeira ocorre em D0 ou em D1.

A tela principal apresenta os eventos e a condição em que se encontram. Desta forma o emissor pode programar o valor financeiro de sua responsabilidade:

Pago Sistema – mostra a quantidade do ativo e o respectivo valor financeiro que é liquidado financeiramente;

Tes./Incorp – mostra a quantidade do ativo em tesouraria ou do evento de incorporação.

Ret.Sistema – mostra a quantidade do ativo retirado do sistema e o respectivo valor financeiro que não é liquidado financeiramente.

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***							◆SND◆11◆
EVENTOS GERADOS NO DIA PARA O EMISSOR 88249412							
Tipo Ativo	Evento	-Pago Sistema	Tes/Incorp	Ret. Sistema-	Qtde	Qtde	
Sel.	Liq	Valor Financ.	Qtde	Valor Financ.			
▶◀ PARG11	JUROS	1.000	0	0			
	D0	1.123.456,00		0,00			
▶◀ PARG11	TOTAL :	1.000	0	0			
		1.123.456,00		0,00			

SRN11	ATIVO ▶	◀ DATA/N.OPER. ▶	◀ M.M. ▶	◀ P/paginar xmit ▶
20 17 Pg=1 NORM LOC LTAI				

Para visualizar as operações geradas para os Participantes e o status em que se encontram, o emissor deve informar no campo "Tipo Sel.", a condição que deseja consultar, conforme legenda na última linha da tela.

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***							◆SND◆I ◀
EVENTOS GERADOS NO DIA PARA O EMISSOR 88249412							
Tipo Ativo	Evento	-Pago Sistema	Tes/Incorp	Ret. Sistema-			
Sel.	Liq	Qtde	Qtde	Qtde			
		Valor Financ.		Valor Financ.			
▶P◀ PARG11	JUROS	1.000	0	0			
	D0	1.123.456,00		0,00			
▶◀ PARG11	TOTAL :	1.000	0	0			
		1.123.456,00		0,00			

SRN1I	ATIVO ▶	◀ DATA/N.OPER.▶	◀ M.M. ▶	◀ P/paginar xmit▶▶					
					8	8	Pg=1	NORM	LOC LTAI

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***							◆SND◆I ◀
EVENTOS GERADOS NO DIA PARA O EMISSOR 88249412 - PARG11							D0
Partic.	Cod.	Descricao	P.U.	Qtde	Valor Financ		
		Status		N.op			
88239006	060	JUROS	1.123,456000	1000	1.123.456,00		
		PENDENTE LIQ FINANCEIRA		7420			

SRN1IA	ATIVO ▶	◀ DATA/N.OPER.▶	◀ M.M. ▶	◀ Volta xmit▶▶					
					80	9	Pg=1	NORM	LOC LTAI

Menu Posição de Ativo (Menu 20)

Relaciona o grupo de funções disponíveis. Através deste menu são feitas as operações de depósito e retirada.

```
*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SND
                                     MENU DE POSICAO DE ATIVO
-----
                00 - Menu de funcoes
Operacoes          Consultas
-----          -----
20 - Menu de posicao de ativo          2A - Posicao de ativo
21 - Deposito/retirada/conversao/permuta  2C - Movimentacao do participante
25 - Correcao de lancamentos          2E - Display de erros
28 - Transferencia de titulos entre clientes
-----
                99 - Encerrar
-----
Indique o codigo da opcao desejada ▶ ◀
SND20A  ATIVO ▶          ◀ DATA/N.OPER.▶          ◀ M.M. ▶          ◀ xmit▶◀
                                     53 22 Pg=1 FORM RCV LTAI
```

Depósito sem Financeiro (SND 21)

Depósito / Retirada / Conversão / Permuta (Função SND 21)

Nesta função o Participante pode solicitar o depósito, retirada, conversão e a permuta, bem como seus cancelamentos/estornos.

Não é permitido o registro de operações no dia do vencimento do ativo.

Depósito: o Participante solicita o depósito, no mercado secundário e o mandatário confirma através da função SND27. Nesta operação não é necessária a informação dos dados cadastrais do cliente.

```

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          ◆SND◆21◆
17.02.2006      CRI
                DEPOSITO,RETIRADA,CONVERSAO E PERMUTA EM ACOES
-----
                Codigo de atualizacao (I,E)          ▶I◀
                Dep/ret/conv/perm (D,R,C,P)         ▶D◀
                Participante                         ▶88239006◀
                Ativo                                ▶PAG11 ◀
                Quantidade                            ▶2500 ◀
                Numero da operacao                    ▶4444◀
                Numero da operacao original           ▶ ◀

== Dados do cliente ==
Nome: ▶                                           ◀ CPF/CNPJ ▶ ◀ ◀ ◀
Rua: ▶                                           ◀ Numero: ▶ ◀ Compl.: ▶ ◀
Cep: ▶                                           ◀ Cidade: ▶ ◀ UF: ▶ ◀
Pais: ▶ ◀ Bairro: ▶                               ◀ Tel.: ▶ ◀ ◀ ◀
Ident: ▶ ◀ Emis.: ▶ ◀ Sexo: ▶ ◀ Nac.: ▶ ◀ EC: ▶ ◀ CC: ▶ ◀
Prof.: ▶ ◀ Naso.: ▶                               ◀
Inst.: ▶ ◀ N.Inst.: ▶ ◀
Contato: ▶ ◀ N.Cliente: ▶ ◀
Banco: ▶ ◀ Ag.: ▶ ◀ Conta: ▶ ◀

SND21                                           xmit▶ ◀
Window SRN/1 at CETIPHOM
                56 12 Pg=1 FORM LOC LTAI
    
```

É possível a exclusão do depósito mesmo que já esteja confirmado pelo mandatário. Da mesma forma que a inclusão, o Participante solicita a exclusão na função SND21 e o mandatário confirma na SND27. É gerada a operação de estorno de depósito, identificada pelo código 2101, com o status de "FINALIZADA" e a operação de depósito passa ao status "EST:COMANDA".

Descrição dos campos

<i>Campo</i>	<i>Descrição</i>
Código de Atualização (I,E)	I = Inclusão, E = estorno
Dep/ret/conv/perm (D,R,C,P)	Identifica o tipo de operação. D = Depósito, R = Retirada, C = Conversão e P = Permuta
Participante	Código CETIP do Participante.
Ativo	Código identificador do ativo.
Quantidade	Quantidade / Qtd. a antecipar do ativo.
Número da Operação	Número atribuído à operação atual. Ver observação abaixo.
Número da Operação Original	Número atribuído à operação original.
Dados do Cliente	
Nome	Nome do cliente
CPF/CNPJ	CPF para pessoa física; CNPJ para pessoa jurídica.
Rua	Dados do endereço.
Numero	
Compl.	
CEP	
Bairro	
Cidade	
UF	
Pais	
Tel.	Informar no primeiro campo o código DDD
	Informar no segundo campo o número do telefone
	Informar no terceiro campo o ramal
Ident.	Número da identidade.
Emis.	Órgão Emissor.
Sexo	
Nacionalidade	
E C	C-casado S- solteiro V- viúvo D- Desquitado. O – outros.
CC	F- Física J- Jurídica
Prof.	Profissão do cliente.
Nasc.	Data de nascimento (DDMMAAAA)
Inst.	No caso de Conversão, nome da Instituição que o representa na Bolsa
N.Inst.	Número da Instituição na Bolsa
Contato	Nome do contato.
N.Cliente	Número do Cliente na Instituição que o representa na Bolsa
Banco	Código de compensação do Banco onde o cliente mantém conta
Ag.	Código da agência
Conta	Número da conta

Observação:

A faixa de Valores entre 8.000 a 8.999 é utilizada para representar operações geradas automaticamente pela Plataforma de Negociação CETIPNET, e a faixa de valores entre 9.000 a 9.999, destinados às operações geradas no MMG (**Módulo de Manutenção de Garantias**) devido a isso, esses valores não podem ser atribuídos, pelo Participante, ao campo **Número da operação**.

Retirada: o Participante solicita a retirada e o mandatário confirma através da função SND27. Nesta operação é necessária a informação dos dados cadastrais do cliente, pois uma vez retirado o mandatário necessita efetuar o cadastramento deste cliente como proprietário do ativo em seus sistemas de controle.

Após a solicitação de retirada, a quantidade é transferida da posição própria livre do Participante para a posição de bloqueio, na função SND2A.

É possível a exclusão de solicitação de retirada, desde que ainda não confirmada. Neste caso, a operação de retirada, pendente de confirmação, pelo mandatário, identificada com o código 2011, na função SND2C passa ao status "EST: COMANDADA" e a operação de estorno, identificada como 2111, ao status de "FINALIZADA". A custódia da posição de bloqueio é transferida para a própria livre do Participante.

```

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SND21
14.06.2006
DEPOSITO,RETIRADA,CONVERSAO E PERMUTA EM ACOES

Codigo de atualizacao (I,E)          I
Dep/ret/conv/perm (D,R,C,P)        R
Participante                          77785004
Ativo                                GGGG11
Quantidade                            10
Numero da operacao                    1234
Numero da operacao original          1234

== Dados do cliente ==
Nome:  SEGURADORA PARTICIPANTE J LTDA      CPF/CNPJ:330163382000271
Rua:   AV. REP. DO CHILE                   Numero: 230  Compl.: 8 ANDAR
Cep:   20011170 Bairro: CENTRO             Cidade: RIO DE JANEIRO UF: RJ
Pais:  BRASIL                             Tel.: 002122226655666
Ident:                                     Emis.:  Sexo:  Nac.:  EC:  CC:
Prof.:                                     Nasc.:
Inst.:  SEGURADORA PARTICIPANTE J LTDA     N.Inst.: 12345
Contato:PAULO SERGIO                       N.Cliente:123456789
Banco: 4444 Ag.: 1111 Conta: 111111111111

SND21                                     xmit
    
```

Conversão e Permuta: O Participante pode solicitar a conversão ou permuta desde que o período já tenha sido definido pelo emissor e devidamente cadastrado. O referido período pode ser visualizado na função SND43.

O Participante solicita a conversão ou permuta e o mandatário confirma através da função SND27. Nesta operação é necessária a informação dos dados cadastrais do cliente.

Após a solicitação de conversão ou de permuta, a quantidade é transferida da posição própria livre do Participante para a posição de bloqueio, na função SND2A.

O número da operação é gerado automaticamente e pode ser visualizado pelo Participante na função SND2C e pelo mandatário na SND2F.

É possível a exclusão de solicitação de conversão e de permuta, desde que ainda não confirmada. Neste caso, a operação de conversão ou de permuta, pendente de confirmação, pelo mandatário, identificada com o código 2017, na função SND2C passa ao status "EST: COMANDADA" e a operação de estorno, identificada como 2117, ao status de "FINALIZADA". É Transferida a custódia da posição de bloqueio para a própria livre do Participante.

```

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          ◆SND◆21◆
17.02.2006      CRI
                DEPOSITO,RETIRADA,CONVERSAO E PERMUTA EM ACOES
-----
                Codigo de atualizacao (I,E)          ▶I◀
                Dep/ret/conv/perm (D,R,C,P)         ▶C◀
                Participante                         ▶8823907◀
                Ativo                                ▶GGGG11 ◀
                Quantidade                            ▶10 ◀
                Numero da operacao                   ▶4474◀
                Numero da operacao original          ▶ ◀
== Dados do cliente ==
Nome: ▶SEGUADORA PARTICIPANTE J LTDA ◀ CPF/CNPJ▶330163382◀▶0002◀▶71◀
Rua: ▶AV. REP. DO CHILE ◀ Numero: ▶230 ◀ Compl.: ▶8 ANDAR◀
Cep: ▶20011170◀ Bairro: ▶CENTRO ◀ Cidade: ▶RIO DE JANEIRO ◀ UF: ▶RJ◀
Pais: ▶BRASIL ◀ Tel.: ▶0021◀▶2226655◀▶666 ◀
Ident: ▶ ◀ Emis.: ▶ ◀ Sexo: ▶ ◀ Nac.: ▶ ◀ EC: ▶ ◀ CC: ▶ ◀
Prof.: ▶ ◀ Nasc.: ▶ ◀
Inst.: ▶SEGUADORA PARTICIPANTE J LTDA ◀ N.Inst.: ▶12345◀
Contato:▶PAULO SERGIO ◀ N.Cliente:▶123456789◀
Banco: ▶4444◀ Ag.: ▶1111◀ Conta: ▶1111111111◀
-----
SND21                                                    xmit▶ ◀
                Window SRN/1 at CETIPHOM
                79 24 Pg=1 FORM LOC LTAI
    
```

Correção de Lançamentos (Função SND 25)

Nesta função são visualizados os lançamentos incorretos, registrados na função SND21 e SND22, criticados ou incompatibilizados quando efetuado o duplo comando.

A correção ou a exclusão do erro somente pode ser efetuada pelo usuário que registrou o lançamento ou pelo usuário supervisor da instituição.

Posição de Ativo (Função SND 2A)

A função permite ao Participante consultar a sua posição de custódia. Pode ser efetuada a partir do filtro “ativo” informado no rodapé da página, quando da solicitação da tela. É visualizada a posição de custódia a partir do ativo informado, inclusive.

Própria livre – quantidade de ativo, oriunda de operações já finalizadas.

Própria bloqueada – posição do Participante vendedor enquanto a operação de venda definitiva ainda não foi finalizada, ou seja, ainda está pendente de liquidação financeira.

Própria N.R/O.V – posição de bloqueio do Participante referente a Não Repactuação ou Opção de Venda a serem realizadas em data futura.

Repassé livre - quantidade de ativo, oriunda de operações compromissadas já finalizadas, onde o Participante tenha assumido compromisso de revenda.

Repassé bloqueado - posição do Participante vendedor enquanto a operação de venda compromissada ainda não foi finalizada, ou seja, ainda está pendente de liquidação financeira.

Recompra – quantidade de ativo vinculada a operações de recompra, oriunda de operações de venda com compromisso de recompra.

D.R.C – Derivativos Recebíveis de Crédito - a ser disponível em breve

Bloqueio - quantidade de ativo bloqueada para movimentação.

CETIPNET - posição de bloqueio, quando o Participante lança uma oferta de venda de negociação CETIPNET. Se a oferta for fechada, a posição migra para a própria bloqueada do vendedor. Se a oferta for cancelada, a quantidade de ativos retorna para a posição própria livre do vendedor.

R.Tecnic – Ativos que compõem a reserva técnica de sociedade seguradora, sociedade de capitalização, entidade aberta de previdência privada e sociedade seguradora especializada em saúde.

Movimentação de Participante (Função SND 2C)

A função permite que o Participante consulte suas operações registradas nas funções SND 21 e 22 pendentes ou atualizadas, com status finais.

Os detalhes das operações de retirada / permuta / conversão podem ser visualizados na função SND2H.

Menu de funções (Menu 40)

Menu que relaciona o grupo de funções disponíveis para consulta.

```
*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          ↕SND↔
                                     MENU DE CONSULTAS
-----
                                00 - Menu de funcoes
40 - Menu de consultas                    4A - Negocios do ativo (DATA)
41 - Relacao de emissores (EMPRESA)      4B - Negocios na data (DATA)
42 - Caracteristicas do emissor (EMPRESA) 4C - Rel. de ATIVOS/ISIN (EMPRESA)
43 - Caracteristicas do ativo (ATIVO)     4D - Diario (ATIVO)
44 - PU de Pagamento (ATIVO)
45 - PU da Curva (ATIVO)
46 - Agenda de eventos(ATIVO)
48 - Relacao de participantes
49 - Flutuacao de taxas (ATIVO)

                                99 - Encerrar
-----
Indique o codigo da opcao desejada ▶ ◀
SND40 Emissor/Ativo ▶          ◀ Data/N.Oper ▶          ◀ M.M. ▶          ◀ xmit▶◀
                                     53 22 Pg=1 FORM RCV LTAI
```

Relação de Emissores (Função SND 41)

Exibe relação de todos os emissores cadastrados e seus respectivos códigos, em ordem alfabética pela razão social da empresa.

Observação: Para agilizar a consulta, pode-se digitar no campo "ATIVO" do rodapé, o primeiro caractere ou os dois primeiros e assim sucessivamente, da razão social do emissor que se deseja consultar. É exibido todos os emissores que se iniciam com o(s) caractere (s) informado(s).


Ex.: Digitar CIA

Conforme exemplo da tela, o primeiro emissor a ser visualizado é o Cia Participante H Ltda. e em seguida Participante G Ltda. Participante G, etc.

Características do Emissor (Função SND 42)

Exibe os dados cadastrais do emissor e a relação das debêntures de sua emissão registradas no módulo.

Observações:

1. Caso o emissor esteja inadimplente, o campo "Emissor" estará tarjado e é visualizada a mensagem "Emissor inadimplente".
2. Se o número de séries e/ou emissões forem em número maior do que a tela suporta, é possível paginar. Para tanto, o Participante deve posicionar o cursor em "Xmit" e a tecla  deve ser pressionada. Na última página é exibida a informação "Última página".
3. Banco Mandatário – Instituição que possui conta "Reservas Bancárias" no Banco Central do Brasil indicado pelo emissor para prestação de serviços de liquidação financeira e de custódia. As responsabilidades do Banco Mandatário encontram-se descritas no Regulamento de Operações do SND.

Características do Ativo (Função SND 43)

Exibe as condições sob as quais a debênture foi emitida, além de especificar os pagamentos de juros, amortizações, etc.

Observações:

1. Para exibição das demais características, tela 2/2, o Participante deve posicionar o cursor em "Xmit" e a tecla **Enter** deve ser pressionada.
2. Quando o emissor estiver inadimplente, a razão social da empresa estará tarjada e é visualizada a mensagem "Emissor Inadimplente", que estará sobreposta à informação "DATA REG = DD/MM/AAAA DATA ULT ALT = DD/MM/AAAA"
3. Quando o ativo estiver bloqueado, o código do título estará tarjado.

PU de Eventos (Função SND 44)

Esta função pode ser visualizada a partir da abertura do módulo, no próprio dia do evento.

PU de eventos é o preço unitário de um determinado evento do ativo, calculado ou informado pelo emissor, que pode ser efetivamente pago, incorporado, no caso de juros ou prêmio ou não pago.

Eventos não pagos são visualizados nesta tela com o campo PU de vento preenchido com 0,000000 (eventos excluídos pela CETIP).

Esta consulta exibe o histórico dos eventos, em ordem decrescente por data do evento, ou seja, da data mais atual para a mais antiga.

PU da Curva (Função SND 45)

O PU da curva é preço unitário do ativo, em uma determinada data, composto de seu valor nominal atualizado, se couber, acrescido de juros e/ou prêmios, se houver.

No dia em que estiverem programados eventos, desde a abertura do módulo, o PU é visualizado com o valor remanescente, ou seja, já levando em consideração os valores dos eventos. Por exemplo: se evento de juros e de amortização, o campo de juros está preenchido com 0,000000 e o valor nominal já é o remanescente, descontada a parcela de amortização.

Como os valores dos eventos podem ser calculados ou informados pelo emissor, a data fica marcada com o caracter **\$** e é visualizada a mensagem "**Valores passíveis de alteração pelo emissor**". Se o emissor informar o valor do evento, esta data fica marcada com o caracter **E** e aparece a mensagem "**Valor informado pelo emissor**", significando que os cálculos foram efetuados com base no respectivo valor.

Caso o valor nominal seja informado pelo emissor em data diferente de data de evento, no dia seguinte desta intervenção, tal data é visualizada com o caracter **#**, que significa que os cálculos foram efetuados com base em informações do emissor.

Quando o índice utilizado para o cálculo não tiver sido divulgado ou não estiver disponível por qualquer motivo, é utilizado o último índice conhecido para o cálculo. Esta situação está configurada com a marcação *****. Para a data seguinte, se os índices já estiverem disponíveis, o cálculo é efetuado baseado em tais índices, não sendo atualizados os valores para as datas já divulgadas anteriormente.

A consulta é exibida em ordem decrescente de data, ou seja, da mais atual para a mais antiga. A mais antiga data é aquela correspondente ao **último** valor nominal registrado no módulo (seja o de emissão, o remanescente após eventos ou informado pelo emissor. Valor constante da tela SND53, de uso exclusivo da CETIP) quando da implantação desta função, em 23/04/2001. Nesta data, somente é visualizado o Valor nominal. Se este ativo tiver previsão de juros e/ou prêmio, os respectivos campos estão preenchidos com 0,000000.

Observações:

1. Se a debênture não tiver previsão de juros e/ou prêmio, os respectivos campos são preenchidos com (-----);
2. Quando os juros e/ou prêmio não forem calculados pelo módulo, no caso de debêntures com critério de cálculo antigo, é apresentada a mensagem "Não calculável".

Agenda de Eventos (Função SND 46)

A consulta a agenda de eventos pode ser realizada de várias formas, conforme descrito abaixo:

1. Consulta de todos os eventos do ativo "PARG11":
Preencher no campo ativo -> "PARG11"
Campo data/n.oper → em branco

É exibida a tela com todos os eventos programados deste ativo, a partir da data do módulo, em ordem crescente de data, com suas datas originais, mesmo que não sejam em dia útil. Quando do fim das informações é exibida mensagem "ultima pagina".

2. Consulta de todos os eventos do ativo "PARG11" na data "dd/mm/aaaa"
Preencher no campo ativo -> "PARG11"
Campo data/n. oper --> "dd/mm/aaaa". Esta data deve ser igual ou maior a data do módulo.

É exibida tela com os eventos programados deste ativo, a partir da data informada, inclusive, em ordem crescente de data, com suas datas originais, mesmo que não sejam em dia útil. Quando do fim das informações é exibida mensagem "ultima pagina".

3. Consulta de todos os eventos do dia "dd/mm/aaaa"
Campo ativo → em branco
Preencher campo data/n.oper -> "dd/mm/aaaa". Esta data deve ser igual ou maior a data do módulo.

Se a data informada não for dia útil, é exibido somente eventos de correção do Valor Nominal que porventura estejam programados para esta data. Caso contrário, ou seja, se não estiver programado nenhum evento deste tipo para a data informada, é exibida tela com a próxima data útil, data em que efetivamente são realizados os eventos programados a partir da data solicitada.

A tela é apresentada em ordem alfabética pelo código do ativo.

Quando do fim das informações, é exibida mensagem "ultima página. Tecla [ENTER] para próxima data". É exibida tela com a próxima data em que existirem eventos programados.

4. Consulta apenas indicando opção desejada : 46

É exibida tela com a próxima data que contenha eventos programados, podendo ser a própria data do módulo.

Se a referida data não for dia útil, é exibida somente eventos de correção do Valor Nominal que porventura estejam programados para esta data.

A tela é apresentada em ordem alfabética pelo código do ativo.

Quando do fim das informações, é exibida mensagem "Última pagina. Tecla [ENTER] para próxima data". É exibida tela com a próxima data em que existirem eventos programados.

Relação de Participantes (Função SND 48)

A consulta pode ser realizada por palavra chave ou por código da conta do Participante.

A função exibe palavra chave, a razão social, contato e os códigos das contas do Participante credenciado no SND.

Caso os campos de pesquisa não sejam informados, são visualizados todos os Participantes, em ordem alfabética de palavra chave (que representa o grupo econômico do Participante), credenciados no SND.

Flutuações de Taxas (Função SND 49)

Esta função só se aplica para debêntures com índice ANBID como integrante de juros e com critério de cálculo antigo.

Exibe a taxa de remuneração flutuante periódica, base de cálculo dos juros, visualizados na função SND 45.

A consulta as flutuações de taxas é realizada com a seleção desta função no Menu 40 informando o código do ativo no rodapé da tela.

Negócios do Ativo (Função SND 4A)

Exibe os negócios efetuados com um determinado ativo, por data, em ordem decrescente.

Ao fim das informações, é exibida mensagem "última página".

Negócios na Data (Função SND 4B)

Exibe todos os ativos que foram negociados na data solicitada, em ordem alfabética do código do ativo.

Ao fim as informações, é exibida mensagem "última página".

Relação de Ativos/ISIN (Função SND 4C)

Exibe a relação dos códigos do Internacional Security Identification Number, dos ativos cadastrados e seus respectivos emissores.

A função é apresentada em ordem alfabética pela razão social do emissor.

Observação: Caso o Participante queira efetuar consulta específica, pode ser digitado no campo "EMISSOR/ATIVO" a Razão Social do emissor ou parte desta e é exibida a consulta a partir desta informação.

Diário (Função SND 4D)

Esta consulta traz a consolidação de todas as ocorrências com a debênture durante o seu prazo de vigência, tais como: deliberações de assembleias, mudanças das características, alteração de prazos, incorporações de eventos, etc.

Em cada página é visualizada uma data, bastando teclar para visualizar novas datas. A ordenação de telas é da data mais atual para a mais antiga.

Ao final da consulta, é exibida mensagem "Fim das datas cadastradas".

Menu de Comandos do Emissor de Debêntures (Menu 60)

Relaciona o grupo de funções disponíveis.

```
22.03.2002          *** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SND
MENU DE COMANDOS DO EMISSOR DE DEBENTURES

00 - Menu principal
68 - Lancamento de PU de eventos
6F - Financeiro de Eventos

99 - Encerrar

Indique o codigo da opcao desejada ▶ ◀
SRN60M ATIVO ▶ ◀ DATA/N.OPER. ▶ ◀ M.M. ▶ ◀ xmit ▶ ◀
Window SRN/1 at CETIPPRE          58 22 Pg=1 FORM RCV LTAI
```

Observações:

1. Para debêntures emitidas a partir de 01/10/2001, os eventos têm data de liquidação em D+0, o PU na tela SND68 deve ser informado até D-1.
2. Para debêntures emitidas antes de 01/10/2001, os eventos têm data de liquidação em D+1 e o PU deve ser informado na tela SND68 até D+1.
3. Nos dois casos devem ser respeitados os horários fixados e divulgados pela CETIP.

Lançamento de PU de Eventos (SND 68)

Função onde o emissor, mandatário nomeado pelo emissor ou ainda comprador informam os PU's (preços unitários) dos eventos pré-agendados.

Para eventos com liquidação financeira no próprio dia, o PU deve ser registrado até às 21:00h da véspera.

Para eventos com liquidação financeira no próprio dia, o PU deve ser registrado até às 20:00 h da véspera.

Os eventos que tiverem a liquidação financeira em D+1 podem ter os PUs cadastrados até às 20:00 h do próprio dia do evento. Se ocorrer erro no registro do PU, podem ser digitados novos, até o horário limite.

A função SND68 pode ser solicitada por ativo e/ou data, a partir do menu 60:

Por ativo – mostra todos os eventos do ativo informado, a partir da data atual, inclusive.
 Por data – a partir da data informada, inclusive, em ordem alfabética do código do ativo.
 Por ativo e data – todos os eventos do ativo a partir da data informada, inclusive.

Na primeira tela são visualizados os eventos de acordo com a seleção efetuada.

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***							
08.12.2003							
Lancamento de PU de eventos							
EMISSOR : 88249412 - CIA PARTICIPANTE G LTDA							
Se1	Data	Ativo	Evento	CCAL	I/P	P.U.	Sit.
▶X	08/12/2003	PARG41	JUROS	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG41	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG42	ATUALIZACAO	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG42	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG43	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG44	PREMIO	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG44	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG45	PREMIO DE PERMANENCIA	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG45	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG46	PARTICIPACAO	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG46	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG12	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARG13	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶◀	08/12/2003	PARGON	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO

SRN68	ATIVO ▶	◀ DATA/N.OPER. ▶	◀ M.M. ▶	◀ xmit ▶
-------	---------	------------------	----------	----------

As debêntures com critério de cálculo novo, identificadas pelo caractere [N] no campo "CCAL", são mostradas com o PU preenchido, uma vez que o módulo o calcula. Basta o mandatário, confirmá-lo ou não.

As debêntures com critério de cálculo antigo, identificadas pelo caractere [A] no campo "CCAL", estão com o PU em branco.

O campo "I/P", informa se o evento é de incorporação ou de pagamento.

O campo "Sit" informa a situação em que se encontra a informação do PU:
 SIM - quando o PU já foi informado.

NÃO - quando o PU ainda não foi informado.

RET – quando o evento foi retirado do módulo, por solicitação do emissor.

Para o lançamento do PU, marcar com [X] o campo “Sel”. É exibida tela com os dados do evento, sendo necessário apenas o preenchimento do campo P.U. Ao teclar **Enter**, é solicitada a confirmação do valor, conforme visualizado no rodapé da página. Após a confirmação, a situação do evento na primeira página é SIM.

Para os eventos que afetem o Valor nominal, Incorporação de juros, Excedente de TJLP, Amortização e Atualização monetária, é necessária a informação do valor remanescente no campo “Valor..em...”, com 06 casas decimais. Este valor deve ser aquele remanescente após todos os eventos do dia.

Sel	Data	Ativo	Evento	CCAL	I/P	P.U.	Sit.
▶X	02/01/2004	PARG41	JUROS	N	P		NAO
▶	02/01/2004	PARG41	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶	02/01/2004	PARG42	ATUALIZACAO	N	P		NAO
▶	02/01/2004	PARG42	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶	02/01/2004	PARG43	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶	02/01/2004	PARG44	PREMIO	N	P		NAO
▶	02/01/2004	PARG44	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶	02/01/2004	PARG45	PREMIO DE PERMANENCIA	N	P		NAO
▶	02/01/2004	PARG45	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶	02/01/2004	PARG46	PARTICIPACAO	N	P		NAO
▶	02/01/2004	PARG46	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶	12/04/2004	PARG12	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶	07/07/2004	PARG13	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO
▶	12/07/2004	PARGON	VENCIMENTO (RESGATE)	N	P		NAO

SRN68 ATIVO ▶ ◀ DATA/N.OPER. ▶ ◀ M.M. ▶ ◀ xmit ▶ ◀

Descrição de preenchimento dos campos (SND 68)

Campo	Descrição
Sel	“X” para selecionar em detalhes o evento.
Data	Data do evento (fixo).
Ativo	Código identificador do ativo. Mostrado de acordo a seleção no rodapé
Evento	Resgate, juros, repactuação, etc.
CCAL	Critério de cálculo: N – Novo e A – Antigo.
I/P	Incorpora ou paga o evento.
PU	Valor unitário.
Sit.	“Não” indica que PU ainda não foi lançado e “Sim” a confirmação do lançamento.
Valor (Tela Detalhes)	Valor nominal após pagamento de evento que altere o principal.

Os campos Data, Ativo e Evento são preenchidos automaticamente pelo módulo.

```
08.12.2003          *** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SND68
                    Lançamento de PU de eventos
-----
Data .....: 08/12/2003
Ativo .. ...: PARG41
Evento .. ...: JUROS                                     (Liq. em D0)
P.U. .... : ▶250012100          ◀ (com 6 casas decimais)
Participante....: ▶          ◀
Alt. PU Evento? ▶◀ (S/N)
V.N.: ◄          ◀ em
                                           Voltar ▶◀
-----
SRN68C                                                    xmit▶◀
```

O campo PU deve ser preenchido obrigatoriamente com 6 decimais e, então, transmitido.

Para eventos abaixo que alterem o Valor Nominal, é obrigatório o preenchimento do campo "Valor Em" (com 6 decimais):

- Amortização
- Incorporação
- Atualização Monetária
- Não Repactuação

Obs.: O campo "Valor Em" só está disponível caso o evento que esteja sendo incluído altere o Valor Nominal Unitário na data do evento

A tela editada com o valor informado anteriormente deve ser confirmada com (S).

```

08.12.2003          *** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***          SND68
                    Lançamento de PU de eventos
-----
Data .....: 08/12/2003
Ativo .. ...: PARG41
Evento ... ..: JUROS                                     (Liq. em D0)
P.U. .... ...: ▶                ◀                250,012100
Participante....: ▶                ◀
Alt. PU Evento? ▶ ◀ (S/N)
V.N.: ♦                ◀ em
                                                    Voltar ▶ ◀
-----
Confirma (S/N) : ▶S◀
SRN68C                                                    xmit▶ ◀
    
```

Confirmado o lançamento, é exibida a tela com a relação de todos os eventos onde podem ser selecionados novos lançamentos, marcando um X no campo "Sel". Caso este campo não seja preenchido, ou preenchido com (N), a tela continua a ser exibida até ser acionado o campo "xmit", quando retorna automaticamente para a tela anterior.

Sendo o lançamento do PU confirmado, a descrição do campo "Sit", na tela com a relação de eventos, muda de Não para Sim, editando o valor ora confirmado.

Observações:

Até os horários fixados e divulgados pela CETIP, podem ser feitos vários lançamentos, sendo assumido o último. Isto, se o ativo foi emitido antes de 01/10/2002, senão somente podem ser feitos lançamentos até D-1.

Financeiro de Eventos (SND 6F)

Função onde o mandatário pode consultar os preços dos eventos já informados por ele e a quantidade para a qual é efetuado o pagamento. A quantidade pode ser alterada em função de depósitos e retiradas comandadas pelo Participante ou retiradas por solicitação do emissor.

A função esta disponível para consulta a partir da informação do PU dos eventos, efetuada através da função SND68, que pode ocorrer até a véspera, quando a liquidação financeira for em D0 ou até o final do dia efetivo do evento, quando a liquidação for em D1.

As informações nesta tela somente estão disponíveis até o fechamento do dia da liquidação financeira do evento.

Para o acesso a tela, o mandatário deve informar, no menu 60, opção desejada 6F e no rodapé da página, nos campos "ativo" e "data/N.oper":

- Se evento no dia – apenas o código do ativo.
- Se o evento em D+n da data atual: código do ativo e a data efetiva do evento.

*** SISTEMA NACIONAL DE DEBENTURES ***						
11.03.2002						
FINANCEIRO DE EVENTOS						
DATA	ATIVO	OP.	PREÇO/TOTAL	QUANTIDADE	VALOR	
11/03/2002	PNGL10	060	167,480000	1.426	238.826,48	
			238.826,48	0	0,00	
11/03/2002	PNGL10	069	29,150000	1.426	41.567,90	
			280.394,38	0	0,00	

SND6F ATIVO DATA/N.OPER. M.M. xmit

Window SRN/1 at CETIPDES

16 24 Pg=1 FORM RCV LTAI

Descrição dos campos (SND 6F)

Códigos de Eventos	
012 = Resgate Total Antecipado	060 = Juros
012 = Vencimento	069 = Prêmio
014 = Resgate Antec. Programado	072 = Atualização
015 = Opção de Venda	073 = Participação
016 = Não Repactuação	074 = Amortização
	079 = Prêmio de Permanência