



CSD_{BR}
registradora

MANUAL DE MOVIMENTAÇÕES DO MÓDULO DE INFORMATIVOS

[PUBLICO]



SUMÁRIO

| | |
|---|-----------|
| CONTROLE DE VERSÃO | 3 |
| 1. OBJETIVO | 4 |
| 2. ENVIO DE INFORMAÇÕES..... | 4 |
| 3. INFORMES | 4 |
| 4. MOVIMENTAÇÕES | 5 |
| 4.1. ALTERAÇÃO | 5 |
| 4.2. EXCLUSÃO | 5 |
| 5. INFORMAÇÕES SOLICITADAS PELA PLATAFORMA..... | 5 |
| 5.1. DERIVATIVO CONTRATADO NO EXTERIOR (“DCE”) | 6 |
| 5.1.1. INFORME | 6 |
| 5.1.2. ALTERAÇÃO | 8 |
| 5.1.3. EXCLUSÃO | 10 |
| 6. CONTROLE DO DOCUMENTO..... | 10 |
| 6.1. VIGÊNCIA E DIVULGAÇÃO | 10 |
| 6.2. REVISÃO | 11 |
| 6.3. DIREITOS AUTORAIS E DISTRIBUIÇÃO | 11 |



CONTROLE DE VERSÃO

| Data da Versão | Autores | Número da Versão | Descrição |
|----------------|--|------------------|---------------------------------|
| 24/01/2022 | Departamento de Pesquisa e Desenvolvimento | 1.0 | Elaboração inicial do documento |



1. OBJETIVO

O objetivo deste documento é apresentar os processos operacionais do Módulo de Informativos da Plataforma da CSD CENTRAL DE SERVIÇOS DE REGISTRO E DEPÓSITO AOS MERCADOS FINANCEIRO E DE CAPITAIS S.A. (“CSD BR” ou “Companhia”).

Os termos e expressões aqui iniciados em maiúscula, tanto no singular quanto no plural, têm o significado a eles atribuído no Glossário da CSD BR disponível em www.csdb.com.

O Módulo de Informativos permite armazenar e prestar informações sobre Derivativos Contratados no Exterior (“DCE”), destinados ou não à proteção (hedge), seguindo a Resolução CMN nº 3.824, de 2009 (“Resolução 3.824/09”), conforme alterada.

2. ENVIO DE INFORMAÇÕES

A CSD BR disponibiliza as seguintes formas de envio das informações: (i) por meio de API, que permite uma maior interação entre a CSD BR e seus Participantes; (ii) por meio de Transferência de Arquivos (upload via Interface Gráfica e por *Secure File Transfer Protocol* (“SFTP”)); e (iii) por meio de Interface Gráfica.

A interface da CSD BR é composta por APIs REST baseadas no protocolo HTTPS, utilizadas para incluir os informes de DCE e suas Movimentações.

3. INFORMES

O informe de DCE deve ser realizado por um Usuário do Participante em até 2 (dois) Dias Úteis após a sua contratação, no Módulo de Informativos da Plataforma.

O Usuário do Participante informará os dados do DCE na Plataforma, que validará as informações preenchidas. Caso haja algum erro no preenchimento dos dados obrigatórios ou opcionais, o processo é rejeitado e o código do DCE não é gerado.

Ao concluir o processo de informe com sucesso, a Plataforma gera um ID Informativo para identificar o DCE, que é único e exclusivo, com 32 (trinta e dois) dígitos hexadecimais, em caixa baixa, exibidos em cinco grupos separados por hifens para um total de 36 (trinta e seis) caracteres (32 caracteres alfanuméricos e 4 hifens). Além disso, a Plataforma atribui o status “Informado” para esse ID Informativo.



4. MOVIMENTAÇÕES

A Plataforma permite que o Usuário do Participante realize as seguintes Movimentações para os Informativos:

- Alteração (aditamento e retificação), e
- Exclusão.

Após a conclusão de cada Movimentação, a Plataforma retornará o ID Movimentação. O ID Movimentação é um código no formato UUID, composto por 32 (trinta e dois) dígitos hexadecimais em caixa baixa, exibidos em cinco grupos separados por hifens para um total de 36 (trinta e seis) caracteres (32 caracteres alfanuméricos e 4 hifens).

4.1. ALTERAÇÃO

A Movimentação de Alteração permite ao Participante alterar qualquer característica do DCE. A alteração do DCE pode acontecer por 2 (dois) motivos diferentes: (i) retificação, que é considerada a correção de um erro operacional no registro, ou (ii) aditamento, que é o informe de novas características do DCE negociadas entre os Titulares.

Para a efetivação da alteração, o Usuário informará os campos a serem alterados, e ratificará a confirmação de todos os dados já informados no cadastro. Após a confirmação da alteração, todos os dados do DCE serão sobrescritos.

4.2. EXCLUSÃO

A Exclusão é uma Movimentação que possibilita ao Usuário excluir o informe de DCE da Plataforma. A exclusão do informe pode acontecer a qualquer momento, desde que seu status seja “Informado”.

Para realizar a exclusão do DCE, deve ser informado o ID Informativo. Após a finalização da exclusão, o status do informe será alterado para “Excluído”, garantindo assim que a Movimentação de exclusão foi finalizada com sucesso.

5. INFORMAÇÕES SOLICITADAS PELA PLATAFORMA

Esta seção contempla as informações solicitadas pela Plataforma para o informe, alteração e exclusão de DCE.



5.1. DERIVATIVO CONTRATADO NO EXTERIOR (“DCE”)

5.1.1. INFORME

Para efetivação do informe, faz-se necessário a informação pelo Participantes dos seguintes dados:

| Campo | Descrição | Obrigatoriedade |
|-------------------------------|--|------------------------|
| Tipo | Tipo do Contrato. | Obrigatório |
| Hedge | Informa se o DCE segue a resolução 3.824/2009 ou se o DCE possui o Hedge seguindo a resolução 3.312/2005, conforme alterada. | Obrigatório |
| Tipo de Mercado | Tipo de Mercado em que foi negociado. | Obrigatório |
| Tipo de Derivativo | Tipo de Contrato de derivativo que está sendo negociado no Contrato. | Obrigatório |
| Descrição | Descrição do Tipo de Derivativo. | Obrigatório |
| Data Início | Data em que as partes firmaram o Contrato. | Obrigatório |
| Data Vencimento | Data da apuração do resultado. Livremente pactuada entre Comprador e Vendedor. | Obrigatório |
| Código Contrato | Código do registro do Contrato no exterior. | Obrigatório |
| Código Participante | Código do interno do participante e deve ser único na Plataforma. | Obrigatório |
| Documento Comprador | Documento do Comprador. | Obrigatório |
| Natureza Comprador | Tipo do documento do Comprador: CPF, CNPJ ou NA (documento estrangeiro). | Obrigatório |
| Razão Social Comprador | Razão Social do Comprador. | Obrigatório |
| Pais Origem Comprador | País de Origem do Comprador. | Obrigatório |
| Documento Vendedor | Documento do Vendedor. | Obrigatório |
| Natureza Vendedor | Tipo do documento do Vendedor: CPF, CNPJ ou NA (documento estrangeiro). | Obrigatório |
| Razão Social Vendedor | Razão Social do Vendedor. | Obrigatório |



MANUAL DE MOVIMENTAÇÕES DO MÓDULO DE INFORMATIVOS

| | | |
|----------------------------------|---|-------------|
| Pais Origem Vendedor | País de Origem do Vendedor. | Obrigatório |
| Bolsa Negociada | Nome da Bolsa em que foi negociado o Contrato. | Obrigatório |
| Pais Origem | País de Origem da Bolsa onde o Contrato foi negociado. | Obrigatório |
| Valor Base | Valor Ncional do Contrato. | Obrigatório |
| Quantidade | Quantidade Ncional do Contrato. | Obrigatório |
| Classe Ativo | Categoria do Ativo do Contrato. | Obrigatório |
| Ativo Subjacente | Nome do Ativo do Contrato. | Obrigatório |
| Moeda Cotada | Moeda base negociada. | Obrigatório |
| Moeda Liquidação | Moeda que será liquidada o Contrato. | Obrigatório |
| Mês Ano Referência | Mês e Ano de Referência de Vencimento do Contrato da Commodity. | Opcional |
| Entrega Física | Verifica se o Contrato possui Entrega Física. | Obrigatório |
| Garantia | Verifica se o Contrato possui Garantia. | Obrigatório |
| Liquidação CCP | Verifica se o Contrato possui Liquidação em CCP. | Obrigatório |
| Multiplicador | Caso o Contrato possua multiplicador. | Opcional |
| Limitador | Caso o Contrato possua Limitador. | Opcional |
| Acelerador | Caso o Contrato possua Acelerador. | Opcional |
| Descrição Adicional | Descrição Adicional. | Opcional |
| Classe Ativo Vendedor | Categoria do Ativo do Vendedor do Contrato. | Obrigatório |
| Ativo Subjacente Vendedor | Nome do Ativo do Contrato. | Obrigatório |
| Tipo Swap | Tipo de pagamento do Contrato. | Obrigatório |
| Swap Asiático | Verifica se o Contrato possui Termo Asiático. | Obrigatório |
| Número Fluxos | Caso possua Fluxos de Pagamento. | Opcional |
| Termo Asiático | Verifica se o Contrato possui Termo Asiático. | Obrigatório |
| Taxa a Termo | Valor da taxa contratada entre Comprador e Vendedor. | Obrigatório |
| Tipo Opção | Tipo de Opção do Contrato. | Obrigatório |
| Tipo Verificação | Tipo de Verificação do Contrato. | Obrigatório |
| Opção Asiática | Verifica se o Contrato possui Opção Asiática. | Obrigatório |
| Strike | Valor contratado entre Comprador e Vendedor. | Obrigatório |



| | | |
|--------------------|---|-------------|
| Tipo Origem | Tipo de Origem do Contrato de CDS. | Obrigatório |
| Origem | Se refere ao país de Origem do Contrato de CDS. | Obrigatório |
| Preço | Valor contratado entre Comprador e Vendedor. | Obrigatório |

5.1.2. ALTERAÇÃO

Para alteração do informe, faz-se necessário a informação pelo Participantes dos seguintes dados:

| Campo | Descrição | Obrigatoriedade |
|-------------------------------|---|------------------------|
| Tipo | Tipo do Contrato. | Obrigatório |
| Tipo Alteração | Retificação: é considerada uma correção operacional no cadastro do Contrato. Aditamento: informa novas características e atualizações do Contrato. | Obrigatório |
| ID Informativo | Código de identificação do Informativo. O ID Informativo é gerado na Plataforma CSD BR na efetuação do Informe. | Obrigatório |
| Justificativa | Campo obrigatório para o Participante justificar a alteração. | Obrigatório |
| Hedge | Informa se o DCE segue a resolução 3.824/2009 ou se o DCE possui o Hedge seguindo a resolução 3.312/2005. | Obrigatório |
| Tipo de Mercado | Tipo de Mercado em que foi negociado. | Obrigatório |
| Tipo de Derivativo | Tipo de Contrato de derivativo que está sendo negociado no Contrato. | Obrigatório |
| Descrição | Descrição do Tipo de Derivativo. | Obrigatório |
| Data Início | Data em que as partes firmaram o Contrato. | Obrigatório |
| Data Vencimento | Data da apuração do resultado. Livremente pactuada entre Comprador e Vendedor. | Obrigatório |
| Código Contrato | Código do registro do Contrato no exterior. | Obrigatório |
| Código Participante | Código do interno do participante e deve ser único na Plataforma. | Obrigatório |
| Documento Comprador | Documento do Comprador. | Obrigatório |
| Natureza Comprador | Tipo do documento do Comprador: CPF, CNPJ ou NA (documento estrangeiro). | Obrigatório |
| Razão Social Comprador | Razão Social do Comprador | Obrigatório |
| País Origem Comprador | País de Origem do Comprador | Obrigatório |
| Documento Vendedor | Documento do Vendedor. | Obrigatório |



MANUAL DE MOVIMENTAÇÕES DO MÓDULO DE INFORMATIVOS

| | | |
|----------------------------------|---|-------------|
| Natureza Vendedor | Tipo do documento do Vendedor: CPF, CNPJ ou NA (documento estrangeiro). | Obrigatório |
| Razão Social Vendedor | Razão Social do Vendedor | Obrigatório |
| País Origem Vendedor | País de Origem do Vendedor | Obrigatório |
| Bolsa Negociada | Nome da Bolsa em que foi negociado o Contrato. | Obrigatório |
| País Origem | País de Origem da Bolsa onde o Contrato foi negociado. | Obrigatório |
| Valor Base | Valor Nominal do Contrato. | Obrigatório |
| Quantidade | Quantidade Nominal do Contrato. | Obrigatório |
| Classe Ativo | Categoria do Ativo do Contrato. | Obrigatório |
| Ativo Subjacente | Nome do Ativo do Contrato. | Obrigatório |
| Moeda Cotada | Moeda base negociada. | Obrigatório |
| Moeda Liquidação | Moeda que será liquidada o Contrato. | Obrigatório |
| Mês Ano Referência | Mês e Ano de Referência de Vencimento do Contrato da Commodity. | Opcional |
| Entrega Física | Verifica se o Contrato possui Entrega Física. | Obrigatório |
| Garantia | Verifica se o Contrato possui Garantia. | Obrigatório |
| Liquidação CCP | Verifica se o Contrato possui Liquidação em CCP. | Obrigatório |
| Multiplicador | Caso o Contrato possua Multiplicador | Opcional |
| Limitador | Caso o Contrato possua Limitador. | Opcional |
| Acelerador | Caso o Contrato possua Acelerador. | Opcional |
| Descrição Adicional | Descrição Adicional | Opcional |
| Classe Ativo Vendedor | Categoria do Ativo do Vendedor do Contrato. | Obrigatório |
| Ativo Subjacente Vendedor | Nome do Ativo do Contrato. | Obrigatório |
| Tipo Swap | Tipo de pagamento do Contrato. | Obrigatório |
| Swap Asiático | Verifica se o Contrato possui Termo Asiático. | Obrigatório |
| Número Fluxos | Caso possua Fluxos de Pagamento. | Opcional |
| Termo Asiático | Verifica se o Contrato possui Termo Asiático. | Obrigatório |
| Taxa a Termo | Valor da taxa contratada entre Comprador e Vendedor. | Obrigatório |
| Tipo Opção | Tipo de Opção do Contrato. | Obrigatório |
| Tipo Verificação | Tipo de Verificação do Contrato. | Obrigatório |
| Opção Asiática | Verifica se o Contrato possui Opção Asiática. | Obrigatório |
| Strike | Valor contratado entre Comprador e Vendedor. | Obrigatório |



| | | |
|--------------------|---|-------------|
| Tipo Origem | Tipo de Origem do Contrato de CDS. | Obrigatório |
| Origem | Se refere ao país de Origem do Contrato de CDS. | Obrigatório |
| Preço | Valor contratado entre Comprador e Vendedor. | Obrigatório |

5.1.3. EXCLUSÃO

Para exclusão do informe, faz-se necessário a informação pelo Participantes dos seguintes dados:

| Campo | Descrição | Obrigatoriedade |
|----------------------------|---|------------------------|
| ID Informativo | Código de identificação do Informativo. O ID Informativo é gerado na Plataforma CSD BR na efetuação do Informe, conforme item 3 deste manual. | Obrigatório |
| Código Participante | Código do interno do participante e deve ser único na Plataforma. | Obrigatório |

6. CONTROLE DO DOCUMENTO

6.1. VIGÊNCIA E DIVULGAÇÃO

Este documento deverá ser divulgado no site da Companhia, entrando em vigor na data mais recente do quadro



CONTROLE DE VERSÃO, acima, cancelando e substituindo o documento vigente desde a data imediatamente anterior.

6.2. REVISÃO

Este documento não tem previsão de atualização recorrente, mas poderá ser atualizado a qualquer tempo para incorporar melhorias, corrigir erros ou atender normativos.

6.3. DIREITOS AUTORAIS E DISTRIBUIÇÃO

A Companhia possui sobre esse documento todos os direitos de elaboração, alteração, reprodução e distribuição. Este documento substitui todas as versões anteriores. A Companhia não se responsabiliza por versões desatualizadas, modificadas, ou por quaisquer versões provenientes de outras fontes que não a fonte oficial designada para fornecer este material.