



CSD_{BR}
registradora

MANUAL DE MOVIMENTAÇÕES - MÓDULO DE INFORMATIVOS



SUMÁRIO

CONTROLE DE VERSÃO	3
1. OBJETIVO	4
2. REFERÊNCIAS REGULATÓRIAS E NORMATIVAS.....	4
3. ENVIO DE INFORMAÇÕES.....	4
4. INFORMES.....	4
5. MOVIMENTAÇÕES.....	5
5.1. ALTERAÇÃO	5
5.2. EXCLUSÃO	6
6. INFORMAÇÕES SOLICITADAS PELA PLATAFORMA.....	6
6.1. DERIVATIVO CONTRATADO NO EXTERIOR (“DCE”).....	6
7. CONTROLE DO DOCUMENTO	11
7.1. Vigência e Divulgação	11
7.2. Revisão.....	11
7.3. 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
02/12/2024	Departamento de Pesquisa e Desenvolvimento	2.0	Inclusão do capítulo de Referências Regulatórias e Normativas; Alteração na descrição do campo "Código Participante" disposto no capítulo de Informações Solicitadas pela Plataforma



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”).

O Módulo de Informativos permite armazenar e prestar informações sobre Derivativos Contratados no Exterior (“DCE”), destinados ou não à proteção (hedge), seguindo a legislação brasileira.

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

2. REFERÊNCIAS REGULATÓRIAS E NORMATIVAS

- Resolução CMN nº 3.824, de 16 de dezembro de 2009 (“Resolução CMN 3.824/09”);
- Resolução CMN nº 4.948, de 30 de setembro de 2021 (“Resolução CMN 4.948/21”).

Qualquer referência a qualquer lei ou normativo aplicável será considerado também como uma referência a todas as suas atualizações e regulamentações promulgadas ao abrigo dele, salvo disposição em contrário.

3. 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.

4. 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 5 (cinco) grupos separados por hifens para um total de 36 (trinta e seis) caracteres 32 (trinta e dois) caracteres alfanuméricos e 4 (quatro) hifens. Além disso, a Plataforma atribui o status “Informado” para esse ID Informativo.

5. 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 5 (cinco) grupos separados por hifens para um total de 36 (trinta e seis) caracteres 32 (trinta e dois) caracteres alfanuméricos e 4 (quatro) hifens.

5.1. 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.



5.2. 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.

6. INFORMAÇÕES SOLICITADAS PELA PLATAFORMA

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

6.1. DERIVATIVO CONTRATADO NO EXTERIOR (“DCE”)

6.1.1. 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 interno do participante e deve ser único por dia na Plataforma.	Obrigatório
Documento Comprador	Documento do Comprador.	Obrigatório



Campo	Descrição	Obrigatoriedade
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
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 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



Campo	Descrição	Obrigatoriedade
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

6.1.2. 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



Campo	Descrição	Obrigatoriedade
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 interno do participante e deve ser único por dia 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
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 Nocial do Contrato.	Obrigatório
Quantidade	Quantidade Nocial 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



Campo	Descrição	Obrigatoriedade
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

6.1.3. 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 Erro! Fonte de referência não encontrada. deste manual.	Obrigatório
Código Participante	Código interno do participante e deve ser único por dia na Plataforma.	Obrigatório



7. CONTROLE DO DOCUMENTO

7.1. 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.

7.2. Revisão

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

7.3. 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.