

	<i>Manual de Serviços</i>	MSS
		Cód Manual
		Página 1

**MANUAL DE SERVIÇOS DA
CITIBANK DTVM S/A
PARA
CUSTÓDIA E CONTROLADORIA
DE CARTEIRAS**

	Manual de Serviços	MSS
		Cód Manual
		Página 2

Índice

Introdução.....	3
1. Escopo dos Serviços.....	4
2. Implementação do serviço	4
2.1. Cadastramento no Portal Corporativo Citibank e envio de documentos	4
3. Liquidação física e financeira de ativos	5
3.1.1. <i>Transmissão de Instruções</i>	5
3.1.2. <i>Dados Obrigatórios</i>	5
3.1.3. <i>Pre-matching</i>	5
4. Serviços de Controladoria de Carteiras.....	6
5. <i>Horários limites para envio de instruções</i>	7

 Manual de Serviços	MSS
	Cód Manual
	Página 3

Introdução

O objetivo deste manual é servir de referência básica para explicar o funcionamento dos serviços de Custódia e/ou Controladoria de Carteiras prestada pela Citibank DTVM (“Serviços”).

Os Serviços são prestados aos investidores do mercado financeiro brasileiro tais como Fundos de Pensão, Seguradoras, Gestores e/ou Administradores de Fundos de Investimento, Investidores Estrangeiros, Pessoas Físicas e Pessoas Jurídicas. Para efeito deste manual, tais investidores serão denominados “Clientes”.

 Manual de Serviços	MSS
	Cód Manual
	Página 4

1. Escopo dos Serviços

Os Serviços compreendem a liquidação física e financeira de ativos financeiros, sua guarda, bem como a administração e informação de eventos associados a esses ativos. Compreendem também a liquidação financeira de derivativos, contratos de permutas de fluxos financeiros – swap e operações a termo, bem como o pagamento das taxas relativas ao Serviço prestado, tais como, mas não limitadas a, taxa de movimentação e registro dos depositários e câmaras e sistemas de liquidação.

2. Implementação do serviço

Após as assinaturas dos contratos que regem a prestação dos Serviços faz-se necessária a abertura das contas dos Clientes nas Câmaras Depositárias (e.g. CETIP, SELIC, CBLC) e que o cliente efetue o seu cadastro no Portal Coporativo da Citibank, o que torna possível o envio de instruções à Citibank.

2.1. Cadastramento no Portal Corporativo Citibank e envio de documentos

Adicionalmente aos requerimentos acima, o cliente deve se cadastrar no Portal Corporativo do Citigroup (www.citibank.com.br no link Corporate & Investment Banking), que será o portal de acesso para os sistemas de Custódia.

 Manual de Serviços	MSS
	Cód Manual
	Página 5

3. Liquidação física e financeira de ativos

3.1.1. Transmissão de Instruções

As instruções dos Clientes para a Citibank como prestadora dos Serviços são efetuadas através do sistema eletrônico de boletas (MI – Módulo de instruções). Em situação de contingência quando a transmissão das instruções via MI não for possível as instruções podem ser enviadas via fax.

No que se refere ao recebimento de instruções fora dos prazos estabelecidos no capítulo 5 deste manual, a Citibank não pode garantir o seu processamento. Qualquer processo eventualmente executado fora do horário deverá ser entendido como exceção e a Citibank trabalhará no regime de melhores esforços para que as transações sejam liquidadas nas câmaras de liquidação.

3.1.2. Dados Obrigatórios

Os dados obrigatórios das instruções estão detalhados no *Guia Rápido – Módulo de Instruções*. As instruções, que não forem enviadas pelo Gestor com os dados obrigatórios, não poderão ser processadas.

3.1.3. Pre-matching

Com base na instrução enviada pelos Clientes, a Citibank realizará o procedimento de pre-matching, que consiste na validação dos termos da operação com a contraparte.

Ao serem constatadas divergências nos termos da operação, o gestor é comunicado pelo Front End da Citibank, cabendo ao cliente enviar uma nova instrução acertando os termos da operação.

 Manual de Serviços	MSS
	Cód Manual
	Página 6

Caso haja divergências que impeçam a liquidação das operações, as partes envolvidas serão informadas pela Citibank, não sendo este responsável pela regularização, assim como pelos casos de falhas isentando-se de quaisquer penalidades ou pedidos de ressarcimento.

4. Serviços de Controladoria de Carteiras

Além da Custódia, a Citibank pode oferecer serviços de Controladoria, que consistem nas seguintes atividades: Apreçamento de ativos, cálculo do patrimônio líquido, cálculo do valor da cota e verificação de enquadramento das carteiras controladas.

	Manual de Serviços	MSS
		Cód Manual
		Página 7

5. Horários limites para envio de instruções

Em função da mudança dos horários de liquidação das diferentes Câmaras de Compensação e dos sistemas de liquidação, os seguintes horários-limites vigoram para o envio de instruções à Citibank:

Operações	Horários Limite
Ações (BM&FBOVESPA)	
Compra e Venda	D0 - até 1 hora após o encerramento do pregão
BTC (BM&FBOVESPA)	
Doador	D0 - 18:00h
Renovação Doador	D0 - 14:00h
Tomador	D0 - 18:00h
Renovação Tomador	D0 - 18:00h
Liquidação antecipada pelo Doador	D0 - 16:00h
Devolução antecipada pelo Tomador	D0 - 16:00h
Margens de Garantia - Títulos Públicos	D0 - 16:00h
Margens de Garantia - Ações	D0 - 18:00h
Margens de Garantia - Euroclear	D-1 - 13:00h
Margens de Garantia - DTCC	D-1 - 16:00h
Renda Fixa e SWAPs	
Títulos Privados	D0 - 16:00h
Títulos Privados - CETIP Multilateral	D0 - 10:00h
Compromissadas	D0 - 16:00h
Títulos Públicos	D0 - 16:00h
Títulos Públicos - BMA	D0 - 12:30h
Títulos Públicos - Termos com registro	D-1 - 16:00h
SWAPS - CETIP	D0 - 16:00h
SWAPS e NDF - Preços na CETIP	D0 - 10:00h
Derivativos	
Opções	D0 - até 1 hora após o encerramento do pregão
Índices	D0 - até 1 hora após o encerramento do pregão
Outros derivativos	D0 - até 1 hora após o encerramento do pregão
SWAPs - BM&FBOVESPA	D0 - 17:00h
Margens de Garantia em Dinheiro	D0 - 11:00h
Margens de Garantia em Ativos	D0 - 11:00h
Depository Receipts	
ADR Emissões	D0 - 10:00h
ADR Cancelamentos	D0 - 15:00h
BDR Emissões	D0 - 10:00h
BDR Cancelamentos	D0 - 15:00h
Cotistas	
Aplicações	Previsto no regulamento do fundo
Resgates	Previsto no regulamento do fundo
Outflow	
DTC	D0 - 12:00h
Euroclear	D-1 - 17:00h