

21 de agosto de 2018

038/2018-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento Cetip UTMV

Ref.: **Oferta Pública de NTN-B – Leilões de Compra de Títulos pela STN – Módulo Leilão STN – Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTMV.**

Informamos que, em **22/08/2018**, serão realizados Leilões para a Secretaria do Tesouro Nacional (STN), no Módulo Leilão STN da Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTMV, referentes à oferta pública de NTN-B – Notas do Tesouro Nacional, Série B, conforme descrito a seguir.

Quadro I – Números e Data dos Leilões

Números dos Leilões	Data de Registro das Ofertas	Data de Liquidação Financeira
1218 – 1219 – 1220 – 1221	22/08/2018	23/08/2018

Quadro II – Prazo e Data de Vencimento da NTN-B

Número do Leilão	Prazo a partir da Emissão (dias)	Data de Vencimento
1218	1.726	15/05/2023
1219	3.645	15/08/2028
1220	6.109	15/05/2035
1221	13.414	15/05/2055

Os procedimentos relativos a esses Leilões são regidos pelas disposições contidas no presente Ofício Circular e em seus anexos, assim como nas normas nele citadas e nas demais regras referentes ao Segmento Cetip UTMV.

As instituições credenciadas a operar com a Codip/STN, nos termos da Decisão Conjunta 19, de 27/01/2015, do Banco Central do Brasil e da Secretaria do Tesouro Nacional, e da Portaria 90, de 07/02/2018, da Secretaria do Tesouro Nacional, poderão realizar operação especial, definida pelo art. 15, inciso III, da referida Portaria.

1. Base Regulamentar

1.1. A oferta de títulos pela Secretaria do Tesouro Nacional (STN) é regida pelas disposições e normas contidas neste Ofício Circular, incluindo:

- a) Portaria 578, de 20/08/2018, da STN, anexa a este Ofício Circular, contendo as condições específicas a serem observadas nesta oferta pública;
- b) Comunicado SIM 052/02, de 26/09/2002; e
- c) Manual de Operações de Funções – Títulos e Valores Mobiliários

1.2. Os documentos referentes ao Módulo Leilão STN (Leilão STN) estão disponíveis em www.b3.com.br em Regulação, Estrutura Normativa, Manuais de Operações, Plataforma Eletrônica, Leilão STN.

2. Data e Horário

2.1. Os Leilões serão realizados em 22/08/2018, das 12h às 13h, período em que o Módulo Leilão STN acatará os lançamentos dos Proponentes e, eventualmente, o cancelamento de suas ofertas.

3. Do Objeto

3.1 Para a aquisição das NTN-B, com os prazos e os vencimentos relacionados nos Quadros I e II, os Proponentes poderão registrar ofertas com os títulos de responsabilidade do Tesouro Nacional listados nos Anexos I, II, III e IV da Portaria 578, de 20/08/2018, da STN, anexa a este Ofício Circular.

4. Do Acesso ao Leilão STN

4.1. O acesso do Participante detentor de Direito de Acesso à Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTMV, ao Módulo Leilão STN, ocorrerá por meio da opção “Leilão STN”, disponível na barra de produtos do Cetip | NoMe, conforme previsto no item 5.2.

5. Das Partes e do Direito de Acesso à Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTMV

5.1. Das Partes

5.1.1. Os Leilões contarão com os seguintes Participantes:

- I. Administradora:** a B3 S.A. – Brasil, Bolsa Balcão, entidade administradora da Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTMV da qual o Módulo Leilão STN é integrante;
- II. Ofertante:** a STN; e
- III. Proponente:** o(s) Participante(s) habilitado(s), de acordo com a legislação e a regulação em vigor, com direito de acesso à Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTMV, conforme item 5.2, interessado(s) em adquirir as NTN-B.

5.2. Do Direito de Acesso à Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTMV

5.2.1. É indispensável que os Participantes interessados em tomar parte destes Leilões possuam Direito de Acesso à Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTMV.

5.2.2. As informações sobre os procedimentos necessários à obtenção do Direito de Acesso à Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTMV podem ser obtidas em www.b3.com.br, Produtos e Serviços, Participantes, Mercado de Balcão, Instituição Participante.

5.2.3. Além da outorga de Direito de Acesso mencionada no item 5.2.2, será requerido que o(s) operador(es) do Participante esteja(m) associado(s) ao perfil “Não Liquidante Leiloeiro Negociador” ou “Não Liquidante Negociador”.

6. Das Ofertas

6.1. Para efetuar o lançamento de ofertas no Módulo Leilão STN, o Proponente deve selecionar o leilão desejado e clicar na função “Acompanhar Leilão”.

6.2. O número de casas decimais a serem utilizadas no preenchimento de ofertas de venda, no campo “PU/Cotação”, deverá observar o seguinte critério:

- a) preço unitário de título depositado ou registrado na B3 – Segmento Cetip UTMV: 6 (seis) casas decimais; e
- b) cotação de título depositado no Selic (Sistema Especial de Liquidação e de Custódia): 4 (quatro) casas decimais.

6.3. Durante o período de realização dos Leilões, as ofertas poderão ser consultadas em tempo real pelos Participantes.

6.4. A participação nos Leilões implica o conhecimento e a aceitação, por parte dos Proponentes, das exigências e das condições estabelecidas neste Ofício Circular.

7. Da Apuração e do Resultado dos Leilões

7.1. Da Apuração

7.1.1 Após o término do horário de realização dos Leilões, conforme item 2.1, será iniciado o procedimento de apuração.

7.1.2 Enquanto os Leilões se encontrarem em processo de apuração, a mensagem “Em apuração” será mostrada no Módulo Leilão STN.

7.2. Do Resultado dos Leilões

7.2.1 O resultado dos Leilões estará disponível no Módulo Leilão STN a partir das 14h30, após o comando de finalização por parte da STN, e identificado pela mensagem “Apurado”.

7.2.2 As ofertas aceitas pela STN poderão ser visualizadas pelos Participantes, após o término da apuração, no Módulo Leilão STN, em “Relação de Lances”, na opção “Relatórios”.

8. Da Emissão da NTN-B e do Depósito de NTN-B no Selic

8.1. O Proponente vencedor deverá ser, obrigatoriamente, titular de conta individualizada no Selic, onde as NTN-B serão depositadas, sob pena de ter suas propostas excluídas do Leilão.

9. Da Liquidação Financeira

A liquidação financeira dos Leilões será realizada por meio de transferência de títulos de responsabilidade do Tesouro Nacional listados nos Anexos I, II, III e IV da Portaria 578, de 20/08/2018, da STN, observado o disposto a seguir.

9.1. Da liquidação financeira por meio da transferência de títulos depositados ou registrados na B3 – Segmento Cetip UTM

- 9.1.1 No dia da liquidação financeira, a conta do Proponente vencedor onde o título estiver depositado ou registrado deve apresentar saldo suficiente de títulos no horário previsto para lançamento de operações na modalidade de liquidação “Multilateral Cetip”.
- 9.1.2 As ofertas de venda de títulos depositados ou registrados na B3 – Segmento Cetip UTVM, serão liquidadas em 23/08/2018 no horário estabelecido para liquidação de operações na modalidade de liquidação “Multilateral Cetip”.
- 9.1.3 A liquidação financeira da venda de título depositado ou registrado no TVM – Módulo de Títulos e Valores Mobiliários, que tenha sido objeto de intermediação, por meio da Conta de Intermediação, será realizada conforme o estabelecido nos documentos relacionados na alínea “c” do item 1.1.
- 9.2. Da liquidação financeira por meio da transferência de títulos depositados no Selic
- 9.2.1 Para efeito da liquidação financeira de venda por meio da transferência de título depositado no Selic, o Participante deverá efetuar o registro do negócio, no referido sistema, no dia 23/08/2018.
- 9.2.2 No cálculo do valor financeiro relativo à venda do título, será considerado, conforme orientação da STN, o preço unitário de face, calculado na forma prevista na Portaria.
- 9.2.3 A liquidação de eventual diferença financeira a débito do Proponente vencedor será realizada na operação de compra de NTN-B.

10. Da Consulta dos Valores Financeiros

- 10.1. Os valores financeiros resultantes do Leilão STN podem ser consultados no Módulo Leilão STN por meio da função “Financeiro por Participante”, na opção “Relatórios”.

- 10.2. Os valores financeiros disponibilizados na função mencionada no item 10.1 são meramente informativos, refletindo, exclusivamente, o resultado financeiro do dia do Leilão.

11. Das Disposições Gerais e dos Emolumentos

- 11.1. A B3 atuará apenas como prestadora de serviços, disponibilizando o Módulo Leilão STN, integrante da Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTMV, para a realização deste Leilão. Dessa forma, a B3 não possui qualquer responsabilidade, direta ou indireta, inclusive quanto: (i) ao resultado do Leilão; (ii) à transferência das NTN-B; e (iii) à liquidação financeira do Leilão.
- 11.2. Será cobrado do Proponente vencedor do Leilão, a título de taxa de emolumentos, o valor equivalente a 0,001% (um milésimo ponto percentual) sobre o volume arrematado, sendo o valor mínimo R\$34,77 (trinta e quatro reais e setenta e sete centavos) e máximo R\$3.475,34 (três mil, quatrocentos e setenta e cinco reais e trinta e quatro centavos). A cobrança será efetuada pela B3 no 5º dia útil do mês subsequente à realização do Leilão.

Em caso de problemas ou dificuldades para registro de ofertas, bem como esclarecimentos adicionais, o Participante deverá entrar em contato com a Superintendência de Operações de Balcão – Segmento Cetip UTMV, pelo telefone 0300 111 1597 ou pelo e-mail operacaobalcao@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

Cícero Augusto Vieira Neto
Vice-Presidente de Operações, Clearing
e Depositária



MINISTÉRIO DA FAZENDA
SECRETARIA DO TESOURO NACIONAL
PORTARIA Nº 578, DE 20 DE AGOSTO DE 2018.

O Subsecretário da Dívida Pública da Secretaria do Tesouro Nacional, no uso das atribuições que lhe conferem a Portaria MF nº 183, de 31 de julho de 2003, e a Portaria STN nº 143, de 12 de março de 2004, e tendo em vista as condições gerais de oferta de títulos públicos previstas na Portaria STN nº 538, de 03 de agosto de 2011, resolve:

Art. 1º Tornar públicas as condições específicas a serem observadas na oferta pública de Notas do Tesouro Nacional, Série B – NTN-B, cujas características estão definidas no Decreto nº 9.292, de 23 de fevereiro de 2018:

§1º As instituições credenciadas a operar com a CODIP/STN, nos termos da Decisão Conjunta nº 19, de 27 de janeiro de 2015, e da Portaria nº 90, de 07 de fevereiro de 2018, poderão realizar operação especial, definida pelo art. 15, inciso III, da referida Portaria.

I – a oferta pública será realizada com liquidação financeira por meio de transferência de títulos de responsabilidade do Tesouro Nacional, listados nos Anexos. As quantidades ofertadas serão divididas entre dois grupo(s), Grupo I e Grupo II, listados no inciso XII;

II – data de acolhimento das propostas de compra: 22.08.2018;

III – horário para acolhimento das propostas: de 12h às 13h;

IV – divulgação, pelo Tesouro Nacional, do resultado do leilão: na data do leilão, a partir das 14h30;

V – data da emissão: 23.08.2018;

VI – data da liquidação financeira: 23.08.2018;

VII – critério de seleção das propostas: melhor preço para o Tesouro Nacional, quando se tratar do mesmo título. A critério do Tesouro Nacional, no caso de títulos distintos;

VIII – sistema eletrônico a ser utilizado: exclusivamente a Plataforma Eletrônica – Segmento Cetip UTVM, Módulo Leilão STN, nos termos do Regulamento do Segmento Cetip UTVM, B3 S. A. – Brasil, Bolsa, Balcão;

IX – data-base das NTN-B: 15.07.2000;

X – na formulação das propostas de venda deverá ser utilizada cotação percentual, com quatro casas decimais, e codificação própria, a ser divulgada pela B3, para a transferência dos títulos públicos custodiados no SELIC e preço unitário, com seis casas decimais, para transferência dos títulos públicos custodiados na B3;

XI – quantidade para o público: até 300.000 (trezentos e mil) títulos para o Grupo I e 300.000 (trezentos e mil) títulos para o Grupo II;

XII – características da emissão:

Grupo I:

Título	Código Selic	Data do vencimento	Prazo (dias)	Quantidade (mil)	VN na Data-base (em R\$)	Adquirente
NTN-B	760199	15.05.2023	1.726	Até 300	1.000,000000	Público
NTN-B	760199	15.08.2028	3.645	Até 300	1.000,000000	Público

Grupo II:

Título	Código Selic	Data do vencimento	Prazo (dias)	Quantidade (mil)	VN na Data-base (em R\$)	Adquirente
NTN-B	760199	15.05.2035	6.109	Até 300	1.000,000000	Público
NTN-B	760199	15.05.2055	13.414	Até 300	1.000,000000	Público

§1º Os cupons de juros das NTN-B poderão ser negociados separadamente do principal, mantidas as características da emissão;

§2º As cotações das NTN-B a serem ofertadas serão divulgadas por meio de Portaria da Secretaria do Tesouro Nacional no dia da realização do leilão.

§3º O proponente deverá ser, obrigatoriamente, titular de conta individualizada no SELIC, sob pena de ter suas propostas excluídas do leilão.

§4º Na data da liquidação financeira do leilão, as quantidades ofertadas de NTN-B na segunda etapa poderão ser ajustadas em decorrência de variações na atualização do valor nominal dos títulos públicos recebidos.

Art. 2º Para fins de liquidação financeira do leilão, o valor nominal das NTN-B, atualizado até a respectiva data de liquidação financeira, mencionada no Art. 1º, inciso VI, desta Portaria, será divulgado por meio de portaria da Secretaria do Tesouro Nacional no dia de realização do leilão.

Art. 3º Para fins de liquidação das operações decorrentes do leilão, tem-se que:

I – em relação à venda dos títulos públicos custodiados no SELIC ao Tesouro Nacional:

a) o preço unitário do título corresponde ao produto de seu valor nominal atualizado até a data de emissão, mencionada no art. 1o, inciso V, desta Portaria, pela cotação, convertida à forma unitária, informada na respectiva proposta vencedora; e

b) as liquidações das operações devem ser efetivadas no SELIC até às 14h.

II – em relação à venda dos títulos públicos custodiados na B3 ao Tesouro Nacional:

a) o preço unitário do título é o informado, com seis casas decimais, na respectiva proposta vencedora; e

b) a conta de custódia deve apresentar saldo suficiente de títulos no horário previsto para o registro das operações a serem liquidadas na "Janela Multilateral" do Segmento Cetip UTVM, da B3.

III – em relação à compra de NTN-B:

a) o preço unitário do título corresponde ao produto do seu valor nominal atualizado até a data de emissão, mencionada no art. 1º, inciso V, desta Portaria, pela cotação utilizada no leilão, divulgada em Portaria do Tesouro Nacional;

b) a quantidade de NTN-B relativa ao leilão corresponde ao quociente, arredondado para o número inteiro imediatamente superior, entre o valor financeiro das vendas referidas nos dois incisos anteriores e o preço unitário mencionado na alínea "a" deste inciso;

c) as NTN-B serão depositadas, obrigatoriamente, na conta individualizada do proponente vencedor; e

d) a parte contratante tem de ser o próprio proponente vencedor e as liquidações das operações devem ser efetivadas no SELIC até às 15h30.

Parágrafo único. Os comandos de que tratam os incisos I e III deste artigo são os previstos no item 6.3.6.5 do Regulamento do SELIC.

Art. 4º O não cumprimento do disposto no artigo anterior implicará a perda do direito às compras e às vendas de que trata esta portaria.

Art. 5º Esta Portaria entra em vigor na data de sua publicação.

JOSE FRANCO MEDEIROS DE MORAIS

Anexo I

Anexo à Portaria nº 578, de 20 de Agosto de 2018
(Para a liquidação financeira das NTN-B com prazo de 1.726 dias)

1. LETRAS FINANCEIRAS DO TESOIRO

LFT, com vencimento de 01/09/2018 até 01/09/2022

2. NOTAS DO TESOIRO NACIONAL

NTN-B, com vencimento de 15/05/2019 até 15/05/2023

NTN-C, com vencimento em 01/04/2021

Anexo II

Anexo à Portaria nº 578, de 20 de Agosto de 2018
(Para a liquidação financeira das NTN-B com prazo de 3.645 dias)

1. LETRAS FINANCEIRAS DO TESOIRO

LFT, com vencimento de 01/09/2018 até 01/09/2024

2. NOTAS DO TESOIRO NACIONAL

NTN-B, com vencimento de 15/05/2019 até 15/08/2028

NTN-C, com vencimento em 01/04/2021

Anexo III

Anexo à Portaria nº 578, de 20 de Agosto de 2018
(Para a liquidação financeira das NTN-B com prazo de 6.109 dias)

1. LETRAS FINANCEIRAS DO TESOIRO

LFT, com vencimento de 01/09/2018 até 01/09/2024

2. NOTAS DO TESOIRO NACIONAL

NTN-B, com vencimento de 15/05/2019 até 15/05/2035

NTN-C, com vencimento de 01/04/2021 até 01/01/2031

Anexo IV

Anexo à Portaria nº 578, de 20 de Agosto de 2018
(Para a liquidação financeira das NTN-B com prazo de 13.414 dias)

1. LETRAS FINANCEIRAS DO TESOURO

LFT, com vencimento de 01/09/2018 até 01/09/2024

2. NOTAS DO TESOURO NACIONAL

NTN-B, com vencimento de 15/05/2019 até 15/05/2055

NTN-C, com vencimento de 01/04/2021 até 01/01/2031