

ANEXO I – TRATAMENTO DE SITUAÇÕES ESPECIAIS, SUSPENSÃO E EXCLUSÃO

O quadro a seguir detalha o tratamento dado pelo Sistema CLIQ para as situações em que os Participantes CLIQ são enquadrados em Situação Especial, Suspensão e Exclusão em função do momento no ciclo de Liquidação em que tal enquadramento ocorre.

Considere a legenda:

AL – Agente de Liquidação

IL – Instituição Liquidante

ILS – Instituição Liquidante Secundária

LBTR – Módulo de Liquidação Bruta do Sistema CLIQ

LDL – Módulo de Liquidação Líquida do Sistema CLIQ

Intervalo Temporal (T):

T1: entre Validação e Aceitação

T2: entre Aceitação e STR confirmar crédito na Conta de Liquidação CLIQ, Certeza de Liquidação.

Módulo de Liquidação	Participante CLIQ	Intervalo Temporal	Tratamento Sistema CLIQ
LBTR	AL devedor em ativos (credor em fundos)	T1	Sistema CLIQ não aceita Transação (parte na Transação é decretada como em Situação Especial, suspensa ou excluída)
		T2	Sistema CERC não poderá transferir Ativos para AL credor em Ativos Sistema CLIQ: - Informa AL contraparte e IL correspondente; - Informa BCB sobre situação do AL; - Cancela a Transação (LTR0012); e - Informa Sistema CERC.
	AL devedor em fundos (credor em Ativos)	T1	Sistema CLIQ não aceita Transação (parte na Transação é decretada em Situação Especial, suspensa ou excluída)
		T2	Sistema CERC não poderá transferir Ativos para AL credor em Ativos Sistema CLIQ: - Informa AL contraparte e IL correspondente; - Informa BCB sobre situação do AL; - Cancela a Transação (LTR0012); e - Informa Sistema CERC.

	IL devedor	T1	Sistema CLIQ não aceita Transação (IL em Situação Especial, Suspenso ou Excluído)
		T2	Sistema CLIQ: - Informa AL contraparte e IL correspondente; - Informa BCB sobre situação do IL; - Cancela Transação (LTR0012); e - Informa Sistema CERC (devolução dos Ativos). Caso haja IL Secundária cadastrada, Sistema CERC poderá enviar nova Transação após consultar AL afetado.
	IL credor	T1	Sistema CLIQ não aceita Transação (descumprimento dos requisitos necessários estabelecidos no Regulamento CLIQ, com a IL em Situação Especial, Suspenso ou Excluído).
		T2	Sistema CLIQ: - Informa AL contraparte e IL correspondente; - Informa BCB sobre situação do IL; - Cancela a Transação (LTR0012); e - Informa Sistema CERC. Caso haja IL Secundária cadastrada, Sistema CERC poderá enviar nova Transação após consultar AL afetado

Módulo de Liquidação	Participante CLIQ	Intervalo Temporal	Tratamento Sistema CLIQ
LDL	AL devedor em Eventos (credor em fundos)	T1	Sistema CLIQ não aceita Evento
		T2	Sistema CLIQ: - Informa ILs e ALs afetados; - Informa o BCB sobre a situação do AL; - Informa Sistema CERC; - Extrai os Eventos do AL em Situação Especial, Suspenso ou Excluído da Compensação Multilateral; - Efetua novo cálculo de Compensação Multilateral, sem os Eventos extraídos; - Informa ALs e ILs afetados os novos Resultados Financeiros Definitivos, iniciando um segundo Período de Confirmação; - Havendo confirmação dos Resultados Financeiros Definitivos reprocessados, procede com a Liquidação conforme previsto nas etapas V a VIII do Artigo 51.
	AL devedor em fundos (credor em eventos)	T1	Sistema CLIQ não aceita Evento.
		T2	Sistema CLIQ: - Informa ILs e ALs afetados; - Informa o BCB sobre a situação do AL; - Informa Sistema CERC; - Extrai os Eventos do AL em Situação Especial, Suspenso ou Excluído da Compensação Multilateral; - Efetua novo cálculo de Compensação Multilateral, sem os Eventos extraídos; - Informa ALs e ILs afetados os novos Resultados Financeiros Definitivos, iniciando um segundo Período de Confirmação; - Havendo confirmação dos Resultados Financeiros Definitivos reprocessados, procede com a Liquidação conforme previsto nas etapas V a VIII do Artigo 51.
	IL devedor	T1	Sistema CLIQ não aceita Evento (IL em descumprimento dos requisitos necessários estabelecidos no Regulamento CLIQ, por estar em Situação Especial, suspenso ou excluído).

	IL credor	T2	Sistema CLIQ: - Informa ILs e ALs afetados; - Informa o BCB sobre a situação do IL; - Informa Sistema CERC; - Extrai os Eventos do IL em Situação Especial, Suspenso ou Excluído (e ALs sob sua responsabilidade) da Compensação Multilateral; - Efetua novo cálculo de Compensação Multilateral, sem os Eventos extraídos; - Informa ALs e ILs afetados os novos Resultados Financeiros Definitivos, iniciando um segundo Período de Confirmação; - Havendo confirmação dos Resultados Financeiros Definitivos reprocessados, procede com a Liquidação conforme previsto nas etapas V a VIII do Artigo 51.
		T1	Sistema CLIQ não aceita Evento (IL em descumprimento dos requisitos necessários estabelecidos no Regulamento CLIQ, por estar em Situação Especial, suspenso ou excluído).
		T2	Sistema CLIQ: - Informa ILs e ALs afetados; - Informa o BCB sobre a situação do IL; - Informa Sistema CERC; - Extrai os Eventos do IL em Situação Especial, suspenso ou excluído (e ALs sob sua responsabilidade) da Compensação Multilateral; - Efetua novo cálculo de Compensação Multilateral, sem os Eventos extraídos; - Informa ALs e ILs afetados os novos Resultados Financeiros Definitivos, iniciando um segundo Período de Confirmação; - Havendo confirmação dos Resultados Financeiros Definitivos reprocessados, procede com a Liquidação conforme previsto nas etapas V a VIII do Artigo 51.