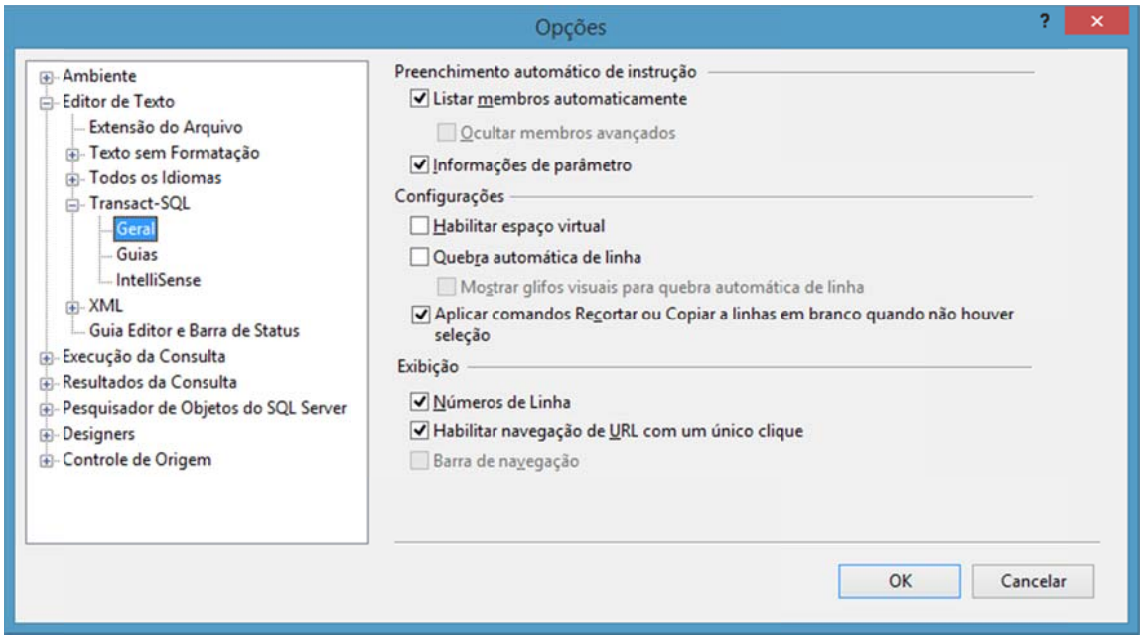
Para habilitar números de linhas no SQL MANAGEMENT STUDIO:

Ferramentas ➔ Opções ➔ Editor de texto ➔ Transact SQL ➔ Geral

Marcar a caixa Exibição ➔ Números de Linha