

15 de dezembro de 2022
178/2022-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Alterações no Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3**

Informamos que, em **19/12/2022**, entrará em vigor nova versão do Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3 (Manual), com alterações relativas a:

- (i) critérios de ordenação das ofertas elegíveis ao tratamento de falhas de entrega realizado pela Câmara B3;
- (ii) tratamento para extensão ou postergação das grades horárias de limite de controle de posição;
- (iii) inclusão de atividades sociais na destinação de valores oriundos de multas ou de diferenças entre valor debitado e creditado não utilizado pela Câmara B3; e
- (iv) adequação de termos utilizados na seção 9.1.5.2.1.4.2 – Falhas de natureza operacional.

As alterações estão descritas detalhadamente no Anexo deste Ofício Circular.

A nova versão do Manual estará disponível, a partir de **19/12/2022**, em www.b3.com.br, Regulação, Estrutura normativa, Regulamentos e manuais, Compensação, liquidação e gerenciamento de riscos, Acessar documentos.



178/2022-PRE

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Suporte aos Processos e Serviços de Liquidação, pelo telefone (11) 2565-5014 ou e-mail liquidacao@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

Mario Palhares
Vice-Presidente de Operações –
Negociação Eletrônica e CCP

Anexo do OFÍCIO CIRCULAR 178/2022-PRE

Descrição das Alterações no Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3

1. Alterações relativas aos critérios de ordenação das ofertas elegíveis ao tratamento de falhas de entrega

CAPÍTULO 5 – CONTRATAÇÃO DE OPERAÇÕES NA CÂMARA

Seção 5.1 – Contratação de empréstimo de ativos

Subseção 5.1.2 – Negociação eletrônica de empréstimo de ativos de renda variável

Subseção 5.1.2.4 – Características específicas de oferta doadora para o tratamento de falhas de entrega de ativos

Inclusão de texto para especificar os critérios de ordenação das ofertas elegíveis ao tratamento de falhas realizado pela Câmara B3.

2. Alterações relativas ao tratamento para extensão ou postergação das grades de limite de controle de posição

CAPÍTULO 7 – CONTROLE DE POSIÇÕES

Seção 7.1 – Consulta de posição

Subseção 7.1.3 – Horários-limites para consulta de posição

Inclusão de texto com o objetivo de prever que a Câmara B3 pode, por razões prudenciais ou operacionais, antecipar ou postergar o encerramento do horário-limite para consulta de posição, bem como dispor sobre a comunicação aos participantes.

Seção 7.3 – Transferência de posições

Subseção 7.3.3 – Horários-limites para transferência de posições

Inclusão de texto com o objetivo de prever que a Câmara B3 pode, por razões prudenciais ou operacionais, antecipar ou postergar o encerramento do horário-limite para transferência de posição, bem como dispor sobre a comunicação aos participantes em caso de ocorrência.

Seção 7.4 – Liquidação antecipada de contrato a termo

Subseção 7.4.1 – Liquidação antecipada

Subseção 7.4.1.4 – Horário-limite para liquidação antecipada

Inclusão de texto com o objetivo de prever que a Câmara B3 pode, por razões prudenciais ou operacionais, antecipar ou postergar o encerramento do horário-limite para liquidação antecipada, bem como dispor sobre a comunicação aos participantes em caso de ocorrência.

Subseção 7.4.2 – Direcionamento de custódia para a liquidação no vencimento do contrato a termo de ativos do mercado à vista

Subseção 7.4.2.2 – Horário-limite para direcionamento de custódia em contrato a termo de ativos do mercado à vista

Inclusão de texto com o objetivo de prever que a Câmara B3 pode, por razões prudenciais ou operacionais, antecipar ou postergar o encerramento do horário-limite para direcionamento de custódia em contrato a termo de ativos do mercado à vista, bem como dispor sobre a comunicação aos participantes em caso de ocorrência.

Seção 7.5 – Cobertura**Subseção 7.5.13 – Horário-limite para manutenção de cobertura de posições**

Inclusão de texto com o objetivo de prever que a Câmara B3 pode, por razões prudenciais ou operacionais, antecipar ou postergar o encerramento do horário-limite para manutenção de cobertura, bem como dispor sobre a comunicação aos participantes em caso de ocorrência.

Seção 7.6 – Manutenção das posições de empréstimo**Subseção 7.6.7 – Manutenção de operações oriundas de intermediação de empréstimo de ativos de renda variável****Subseção 7.6.7.6 – Assunção das operações oriundas de intermediação de empréstimo de ativos**

Inclusão de texto com o objetivo de prever que a Câmara B3 pode, por razões prudenciais ou operacionais, antecipar ou postergar o encerramento do horário-limite para manutenção de posições de empréstimo, bem como dispor sobre a comunicação aos participantes em caso de ocorrência.

Seção 7.9 – Tratamento de eventos corporativos e eventos de renda fixa pública**Subseção 7.9.3 – Tratamento de eventos corporativos para posições de empréstimo de ativos de renda variável****Item 4 – Eventos corporativos com geração automática de direitos na central depositária da B3 – direitos de subscrição**

Inclusão de texto com o objetivo de prever que a Câmara B3 pode, por razões prudenciais ou operacionais, antecipar ou postergar o encerramento do horário-limite para tratamento de subscrição no empréstimo, bem como dispor sobre a comunicação aos participantes em caso de ocorrência.

Item 5 – Eventos corporativos voluntários**(ii) Oferta prioritária de distribuição de ativos**

Inclusão de texto com o objetivo de prever que a Câmara B3 pode, por razões prudenciais ou operacionais, antecipar ou postergar o encerramento do horário-limite para tratamento de oferta prioritária no empréstimo, bem como dispor sobre a comunicação aos participantes em caso de ocorrência.

3. Alterações relativas à inclusão de atividades sociais na destinação de valores oriundos de multas ou de diferenças entre valor debitado e creditado não utilizado pela Câmara B3**CAPÍTULO 9 – LIQUIDAÇÃO PELO SALDO LÍQUIDO MULTILATERAL****Seção 9.1 – Procedimentos de liquidação multilateral****Subseção 9.1.5 – Tratamento de falha****Subseção 9.1.5.1 – Falha de pagamento do saldo líquido multilateral**

Inclusão de atividades sociais na destinação de multas por atraso de pagamento.

Subseção 9.1.5.2 – Falha de entrega de ativos**Subseção 9.1.5.2.1 – Falha de entrega de ativos no mercado de renda variável****Subseção 9.1.5.2.1.1 – Execução de ordem de recompra****Subseção 9.1.5.2.1.3 – Reversão da recompra**

Inclusão de atividades sociais na destinação de eventual diferença entre o valor debitado e o valor creditado que não for utilizado pela Câmara B3.

Subseção 9.1.5.2.1.5 – Multas por falha de entrega de ativos

Inclusão de atividades sociais na destinação de multas por falhas de entrega de ativos.

Subseção 9.1.5.2.2 – Falha de entrega de ouro e de ativos negociados no mercado de renda fixa privada**Subseção 9.1.5.2.2.2 – Execução de ordem de recompra****Subseção 9.1.5.2.2.4 – Reversão de recompra**

Inclusão de atividades sociais na destinação de eventual diferença entre o valor debitado e o valor creditado que não for utilizado pela Câmara B3.

4. Alterações relativas à adequação de termos**CAPÍTULO 9 – LIQUIDAÇÃO PELO SALDO LÍQUIDO MULTILATERAL****Seção 9.1 – Procedimentos de liquidação multilateral****Subseção 9.1.5 – Tratamento de falha****Subseção 9.1.5.2 – Falha de entrega de ativos****Subseção 9.1.5.2.1 – Falha de entrega de ativos no mercado de renda variável****Subseção 9.1.5.2.1.4 – Caracterização das falhas de entrega****Subseção 9.1.5.2.1.4.2 – Falhas de natureza operacional**

- Substituição do termo “ações” pelo termo “ativos” para adequar o texto à definição mais ampla.
- Complementação de texto para contemplar conta que comprovadamente esteja vinculada à atividade de formador de mercado em caso de falhas de entrega decorrentes de operações de formadores de mercado.
- Substituição do termo “à vista” por “de venda” para adequar o texto à definição mais ampla, dado que, além de ações, outros ativos também estão cobertos.