

17 de outubro de 2023
055/2023-VPC

COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Balcão B3

Ref.: **Plataforma NoMe – Curva Calculada Term SOFR**

Acompanhando a evolução das discussões referentes ao fallback da Libor e buscando atender às necessidades do mercado sobre esse assunto, a B3 disponibilizará na versão de dezembro de 2023, prevista para **04/12/2023**, a Curva Calculada de Term SOFR.

Essa metodologia de cálculo vem complementar a relação de curvas calculadas disponíveis para o Swap Fluxo de Caixa não Constante e está sendo construída em parceria com os clientes para replicar as necessidades do derivativo.

Segmento	Módulo	Descrição	Documentação Suporte
Derivativos	Swap	Disponibilização, para o Swap Fluxo de Caixa não Constante, da Curva Calculada de Term SOFR. <u>Funções em tela</u> <ul style="list-style-type: none">Swap > Lançamentos > Registro de Contrato - Fluxo Não ConstanteSwap > Consultas > Características de Contrato de Swap	<u>Manual de Operações</u> www.b3.com.br/pt_br/regulacao/estrutura-normativa/manuais-de-operacoes/manuais-operacionais/ Swap. www.b3.com.br/pt_br/regulacao/estrutura-normativa/manuais-de-operacoes/manuais-operacionais/ Enviar Arquivos. www.b3.com.br/pt_br/regulacao/estrutura-normativa/manuais-de-operacoes/manuais-operacionais/ Receber Arquivos.

		<u>Enviar Arquivos</u> <ul style="list-style-type: none"> Registro de Contrato Fluxo Não Constante <u>Receber Arquivos</u> <ul style="list-style-type: none"> DPOSIÇÃO – Swap (Registro disponível por tela e arquivo) 	<u>Layout em Implementação</u> https://www.b3.com.br/pt_br/regulacao/estrutura-normativa/manuais-de-operacoes/layouts-de-implementacao/ Swap sem CCP Dezembro
--	--	---	--

O período de certificação será de **20/11/23 até 01/12/2023**, de acordo com o layout em implementação. A equipe de Produtos - Derivativos Balcão está à disposição para esclarecer dúvidas sobre o cálculo ou demais validações.

Vale reforçar que a Curva Calculada de Daily SOFR (SOFR Overnight) já está disponível em produção, **desde novembro de 2021**, também para o Swap Fluxo de Caixa não Constante.

Por fim, a exclusivo critério das partes do contrato de derivativo, a B3 poderá auxiliar no processo de migração de contratos VCPs de ambas as curvas para o tipo calculado via procedimento operacional.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Depositária e Operações de Balcão, Central de Atendimento de Derivativos, pelo telefone (11) 2565-5044 ou e-mail op.derivativosbalcao@b3.com.br; e/ou com a Diretoria de Produtos Balcão, pelo telefone (11) 2565-5950 ou e-mail derivativos@b3.com.br.

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e Clientes