

17 de novembro de 2022
152/2022-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Este Ofício Circular foi revogado pelo Ofício Circular 155-2022-PRE

Participantes do Listado B3

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

Informamos que, em **28/11/2022**, entrará em vigor nova versão do Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3 (Manual).

As alterações promovidas no Manual têm como objetivo instituir procedimentos de controle sistêmico para monitorar, avaliar e validar as violações das regras de repasse de operações, de forma a melhorar as práticas operacionais da Câmara B3 e dos participantes.

As alterações estão descritas detalhadamente no Anexo deste Ofício Circular.

A nova versão do Manual estará disponível a partir de 28/11/2022 em www.b3.com.br, Regulação, Estrutura normativa, Regulamentos e manuais, Compensação, liquidação e gerenciamento de riscos, Acessar documentos.

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 152/2022-PRE

Descrição das Alterações no Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3

CAPÍTULO 5 – CAPTURA, ALOCAÇÃO E REPASSE DE OPERAÇÕES

Seção 5.2 – Alocação de Operações

Subseção 5.2.1 – Procedimentos relativos à alocação de operações

Subseção 5.2.3 – Cancelamento de alocação de operação

Subseção 5.2.4 – Alteração de alocação de operação

Atualização das referências às subseções 5.2.5 e 5.2.2, substituindo-as, respectivamente, por referências às subseções 5.2.6 – Grade de horários para alocação de comitentes e 5.2.3 – Cancelamento de alocação de operação, em razão da inclusão da nova subseção 5.2.2 – Procedimentos relativos à alocação de operações de swap cambial com origem em leilão do BCB. Consequentemente, as subseções subsequentes foram renumeradas.

Subseção 5.2.1 – Procedimentos relativos à alocação de operações

Inclusão de parágrafo para determinar a possibilidade de aceitação da alocação de operação de venda coberta no mercado a vista em conta na situação “suspensa parcialmente”.

Subseção 5.2.2 – Procedimentos relativos à alocação de operações de swap cambial com origem em leilão do BCB

Inclusão da subseção para estabelecer os procedimentos adotados pela câmara no processo de alocação de operações de swap cambial com origem em leilão do BCB.

Subseção 5.2.5 – Procedimentos adotados para operações alocadas em contas transitórias no encerramento do prazo limite de alocação

Exclusão de texto que faz menção aos resultados da conta erro, uma vez que à câmara e à BSM é atribuído apenas o controle das movimentações da conta erro.

Subseção 5.2.6 – Grade de horários para alocação de comitentes

Inclusão de texto para possibilitar a antecipação ou a postergação do encerramento das grades e horários-limites mediante necessidade técnica ou operacional, com o objetivo de manter a integridade técnica do sistema.

Seção 5.3 – Repasse de Operações

Inclusão de texto com o objetivo de esclarecer que a possibilidade de repasse parcial da operação está condicionada ao instrumento objeto da operação.

Subseção 5.3.2 – Procedimentos de repasse

Correção da referência à subseção 5.2.6, substituindo-a por referência à subseção 5.3.3 – Grade de horários para repasse e confirmação ou rejeição de repasse.

Subseção 5.3.3 – Grade de horários para repasse e confirmação ou rejeição de repasse

Exclusão da menção à tabela 8, de forma a corrigir as tabelas mencionadas na subseção.

Subseção 5.3.4 – Tratamento de violação de regras de repasse

- A alteração do título da subseção visa adequá-lo às alterações propostas.
- As alterações visam:
 - instituir e caracterizar os eventos considerados violação de regras de repasse de operações;

- determinar os procedimentos relacionados **(i)** ao processo de indicação pelo participante quanto à violação da regra de repasse e respectiva deliberação pela câmara e **(ii)** ao envio de carta, pelo participante à câmara, contendo as informações das operações envolvidas e assinada pelo Diretor de Controles Internos ou o Diretor de Relações com o Mercado do participante;
- estabelecer o procedimento de envio diário, da câmara ao participante, de arquivo eletrônico com a relação das violações das regras de repasse verificadas no dia anterior, bem como envio mensal ao Diretor de Relações com o Mercado do participante da relação das violações das regras de repasse verificadas no mês anterior; e
- determinar que a câmara notificará o participante sobre as situações em desacordo com as regras de repasse e indicar que a notificação também será encaminhada à BSM a fim de exercer supervisão direta no participante.