

5 de março de 2018
005/2018-VPC

COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento Cetip UTMV

Ref.: Plataforma NoMe – Postergação das Implementações de Melhorias no Produto DRRC – Derivativo com Redutor de Risco de Crédito.

Informamos que as implementações de melhorias no produto DRRC – Derivativo com Redutor de Risco de Crédito detalhadas abaixo e divulgadas no Comunicado Externo 012/2017-DN, de 15/12/2017, serão postergadas para a versão de maio, em data a ser oportunamente comunicada.

Módulo	Descrição	Documentação atualizada
Informações de Derivativos (MID)	<p>Implementação de diversas melhorias no produto DRRC – Derivativo com Redutor de Risco de Crédito.</p> <p>Alterações de parâmetros do DRRC.</p> <ul style="list-style-type: none">– Possibilidade de alterar o parâmetro “Duplo Comando para Liquidação”.– Criação do layout “Manutenção de Parâmetros de Redutor de Risco de Crédito”, que possibilitará a alteração de parâmetros do DRRC via transferência de arquivos.– Adaptação do layout “Confirmação de Inclusão/ Alteração/ Exclusão de Agenda de Derivativo com Redutor de Risco de Crédito”, que possibilitará a confirmação de alteração de parâmetro do DRRC via transferência de arquivos. <p>Inclusão de datas futuras na agenda de DRRC.</p> <ul style="list-style-type: none">– Possibilidade de incluir datas futuras em agendas de DRRC ativas.– Criação do layout “Inclusão de Data de Agenda de Derivativo com Redutor do Risco de Crédito”, que possibilitará a inclusão de novas datas na agenda de DRRC via transferência de arquivos. <p>Novas opções de periodicidade na inclusão de agenda de DRRC.</p>	<p>Os layouts em implementação encontram-se disponíveis em www.cetip.com.br, Comunicados e Documentos, Manuais de Operações, Layout em Implementação, DRRC.</p>

Módulo	Descrição	Documentação atualizada
	<ul style="list-style-type: none"> – Possibilidade de inclusão de agendas de DRRC com periodicidade semanal ou mensal. – Inclusão de novos campos e domínios no layout “Inclusão de Agenda de Derivativo com Redutor de Risco de Crédito”, que possibilitará a criação de agendas com essas novas periodicidades. <p>Novos tipos de marcação a mercado.</p> <ul style="list-style-type: none"> – Com o objetivo de diferenciar as marcações a mercado realizadas pelos clientes, haverá a alteração nos tipos de marcação a mercado passando a acatar os domínios “DRRC”, utilizado para marcações que sensibilizam a agenda de redutor de risco de crédito; e “INFORMACIONAL” para aquelas marcações que não estão relacionadas à agenda de redutor de risco de crédito. Esse desenvolvimento impactará os layouts “Manutenção de Agente de Cálculo” e “Marcação a Mercado de IF”. <p>Flexibilização do fluxo de lançamento da inclusão de DRRC.</p> <ul style="list-style-type: none"> – Ajuste para que seja possível um cliente realizar o registro do contrato de derivativo, a indicação do agente de cálculo e a inclusão da agenda de DRRC, sem a necessidade de aguardar os lançamentos da contraparte. É importante destacar que as regras de duplo comando não serão alteradas. Dessa forma, as inclusões permanecem sendo efetivadas apenas no momento em que a(s) contraparte(s) confirmarem seus lançamentos. <p>Ajuste no fluxo de geração e liquidação das operações envolvendo contratos com DRRC.</p> <ul style="list-style-type: none"> – Adaptação na geração das operações de derivativos com DRRC que envolvem liquidação financeira, de forma a garantir a liquidação conjunta dos eventos do derivativo e dos ajustes de caixa do DRRC. <p>Tratamento para antecipações de derivativos com DRRC.</p> <ul style="list-style-type: none"> – Inclusão de mecanismo de geração automática de operação de ajuste de saldo de DRRC para derivativos que sofrerem antecipação parcial. – Adequação do sistema para que em todos os derivativos com DRRC que sofrerem antecipação, parcial ou total, as operações de ajuste e as consequentes liquidações sejam 	

Módulo	Descrição	Documentação atualizada
	<p>efetivadas em conjunto, mitigando o risco de falha no pagamento entre as partes.</p> <p>Novos status na agenda de DRRC.</p> <ul style="list-style-type: none">– Com o objetivo de descrever de forma detalhada a situação dos eventos na agenda de DRRC, serão criados novos status mais especificados. <p>Ajustes nos demais arquivos enviados para os participantes (Receber Arquivos).</p> <ul style="list-style-type: none">– Inclusão do campo “Duplo Comando para Liquidação” no arquivo DAGENDADRRC.– Inclusão da coluna “Tipo de Marcação” no arquivo DMIDMTM, indicando o tipo de marcação que foi realizada para o contrato.	

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Depositária e Operações de Balcão, pelo telefone 0300 111 1597.

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e Clientes