

26 de setembro de 2023
159/2023-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Alterações no Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3
– Temas Diversos – Liquidação**

Informamos que, em **02/10/2023**, entrará em vigor nova versão do Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3 (Manual), com alterações que consistem em:

- i. adequar o processo de vínculo entre contas do tipo por conta e ordem, com a exclusão da possibilidade de estabelecer esse vínculo utilizando conta máster;
- ii. destacar que, no caso de contratação de empréstimo com indicação de participante carrying, no cenário de aceitação automática da indicação, a carteira ou finalidade atribuída pelo sistema é a de livre movimentação;
- iii. adequar os horários-limites para alocação, repasse de operações e transferência de posição de opções sobre ativos de renda variável com possibilidade de exercício automático na data de vencimento;

- iv.** incluir tratamento, para posições de opção sobre ativos de renda variável, no cenário de evento corporativo em recurso financeiro onde o valor do provento é maior do que o preço de exercício da opção;
- v.** incluir tratamento para posição em contrato a termo de renda variável no cenário de evento corporativo em ativos com alteração do ativo-objeto que estabeleça pagamento de parcela financeira;
- vi.** incluir tratamento para frações de ações provisionadas em contratos de empréstimo no cenário de decretação de falência ou liquidação extrajudicial do emissor das ações objeto dos contratos;
- vii.** atualizar a referência ao Manual de Precificação de Eventos Corporativos;
- viii.** incluir, na seção do Manual sobre oferta pública de distribuição de ativos, detalhamento do tratamento de direito de prioridade em ofertas subsequentes.

Em razão do item viii acima, revoga-se o Ofício Circular 087/2014-DP de 28/11/2014.

No Anexo II deste Ofício Circular, consta a nova versão do termo de habilitação de agentes de custódia para ofertas com direito de prioridade. Os termos de adesão já assinados junto à Central de Cadastro da B3 continuarão válidos, não sendo necessário o envio da nova versão pelos participantes que já encaminharam o termo anteriormente.

A nova versão do Manual estará disponível, a partir de **02/10/2023**, em www.b3.com.br, Regulação, Estrutura normativa, Regulamentos e manuais,



159/2023-PRE

Compensação, liquidação e gerenciamento de riscos, Acessar documentos, Câmara B3.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Atendimento - Listados, pelo telefone (11) 2565-5013 ou e-mail liquidacao.posicoes@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

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

Anexo I do OFÍCIO CIRCULAR 159/2023-PRE

Descrição das Alterações no Manual de Procedimentos Operacionais da Câmara B3

I. Alterações relativas a vínculo por conta e ordem

CAPÍTULO 2 – CONTAS, VÍNCULOS E CARTEIRAS

Seção 2.2 – Vínculos entre contas

Subseção 2.2.1 – Tipos de vínculo

Correção no texto referente ao vínculo entre contas do tipo por conta e ordem, com a exclusão da possibilidade de realizar este tipo de vínculo utilizando conta máster.

II. Alterações relativas à indicação automática de carteira na contratação de empréstimo

CAPÍTULO 5 – CONTRATAÇÃO DE OPERAÇÕES NA CÂMARA

Seção 5.1 – Contratação de empréstimo de ativos

Subseção 5.1.1 – Registro de empréstimo de ativos de renda variável

Subseção 5.1.1.3 – Indicação de participante carrying

Subseção 5.1.2.5 – Indicação de participante doador carrying

Subseção 5.1.5 – Registro de empréstimo de cotas de ETF de renda fixa

Subseção 5.1.5.3 – Indicação de participante carrying

A alteração determina que, em caso de aceitação automática da indicação de participante carrying, a carteira indicada como comportamento padrão é a carteira livre (2101-6).

Subseção 5.1.4 – Registro de empréstimo de ativos de renda fixa pública**Subseção 5.1.4.3 – Indicação de participante carrying****Seção 5.2 – Contratação de operação compromissada específica****Subseção 5.2.3 – Indicação de participante carrying**

A alteração determina que, em caso de aceitação automática de repasse pelo participante carrying, a finalidade indicada como comportamento padrão é a de depósito de ativos de renda fixa pública (21).

III. Alterações relativas à adequação do horário de alocação, repasse e transferência de opções no exercício**CAPÍTULO 6 – CAPTURA, ALOCAÇÃO E REPASSE DE OPERAÇÕES****Seção 6.2 – Alocação de operações****Subseção 6.2.6 – Grade de horários para alocação de comitentes**

Ajuste no horário-limite para alocação de operações de opção sobre ativos negociados no mercado de renda variável, na data de vencimento da opção, que passa a ser 1 (uma) hora após o encerramento da sessão de negociação da opção.

Seção 6.3 – Repasse de operações**Subseção 6.3.3 – Grade de horários para repasse e confirmação ou rejeição de repasse**

Ajuste no prazo-limite para repasse de operações de opção sobre ativos negociados no mercado de renda variável, na data de vencimento da opção, que passa a ser 20 (vinte) minutos após o encerramento da sessão de negociação da opção.

CAPÍTULO 7 – CONTROLE DE POSIÇÕES

Seção 7.3 – Transferência de posições

Subseção 7.3.1 – Procedimentos de Transferência de Posições

Ajuste no horário-limite para transferência de posição de opção sobre ativos negociados no mercado de renda variável, na data de vencimento da opção, que passa a ser 1 (uma) hora após o encerramento da sessão de negociação da opção.

IV. Alterações relativas à adequação de referência ao manual de precificação e ajuste nos tratamentos de posições de opções e termo em caso de evento corporativo

Seção 7.9 – Tratamento de eventos corporativos e eventos de renda fixa pública

Para proporcionar maior clareza à redação, foi realizada indicação de que os demais eventos corporativos não descritos no Manual poderão ter tratamento informado por meio de Ofício Circular.

Subseção 7.9.1 – Tratamento de eventos corporativos para opções sobre ativos do mercado à vista

Item 1 – Eventos corporativos em recurso financeiro

Inclusão de tratamento para posições de opção no cenário de evento corporativo em recurso financeiro com valor líquido maior ou igual ao seu preço de exercício, que era anteriormente divulgado por meio de Ofício Circular.

Subseção 7.9.2 – Tratamento de eventos corporativos para contrato a termo de ativos

Item 3 – Evento corporativo em ativos com alteração do ativo-objeto

Inclusão de tratamento para posição de termo de renda variável no cenário de evento corporativo em ativos com alteração do ativo-objeto que estabeleça pagamento de parcela financeira.

Subseção 7.9.1 – Tratamento de eventos corporativos para opções sobre ativos do mercado à vista**Subseção 7.9.3 – Tratamento de eventos corporativos para posições de empréstimo de ativos de renda variável****Seção 7.10 – Tratamento de posições em aberto em caso de leilão de ativo com a negociação suspensa por decretação de falência ou liquidação extrajudicial do emissor**

- Ajustes nas referências ao Manual de Precificação de Eventos Corporativos.
- Inclusão de tratamento financeiro para fração de ações objeto de contratos de empréstimo no cenário de decretação de falência ou liquidação extrajudicial do emissor.

VI. Alterações relativas à inclusão do tratamento de direito de prioridade**CAPÍTULO 12 – OFERTAS DE DISTRIBUIÇÃO E DE AQUISIÇÃO DE ATIVOS****Seção 12.1 – Ofertas públicas de distribuição de ativos****Subseção 12.1.1 – Consórcio de distribuição**

Inclusão da descrição do tratamento dado para formação do consórcio de distribuição nas ofertas com concessão de direito de prioridade pelo emissor.

Subseção 12.1.2 – Intenções de investimento (reservas)

Inclusão da responsabilidade do emissor em informar na documentação da oferta os procedimentos relativos ao exercício do direito de prioridade, e a inclusão da responsabilidade dos agentes de custódia em assegurar que o registro de intenções de investimento seja realizado para comitentes que estejam aderentes ao público-alvo da oferta.

Subseção 12.1.4 – Liquidação da oferta

Subseção 12.1.4.3 – Procedimento para depósito de garantias

- Correção do horário para depósito de garantias.
- Inclusão do procedimento operacional para utilização dos valores depositados em garantia para atendimento da liquidação financeira da oferta.

Anexo II do OFÍCIO CIRCULAR 159/2023-PRE

TERMO DE HABILITAÇÃO DE AGENTE DE CUSTÓDIA PARA OFERTAS PÚBLICAS DE DISTRIBUIÇÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS

Aos cuidados da Superintendência de Cadastro de Participantes e Investidores,
CONSIDERANDO QUE:

- (i) a Resolução CVM 160/2022 (RCVM 160), de 13 de julho de 2022, determina a concessão de direito de prioridade aos atuais detentores dos valores mobiliários quando a oferta pública de distribuição de valores mobiliários restringir o público-alvo de modo que implique risco de diluição para atuais detentores do valor mobiliário objeto da oferta;
- (ii) no âmbito de tais ofertas, a B3 S. A. – Brasil, Bolsa, Balcão (B3) presta serviços aos participantes do mercado utilizando sua infraestrutura de liquidação de ofertas públicas de distribuição para auxiliá-los na concessão do referido direito de prioridade, conforme os procedimentos estabelecidos nos normativos da B3,

Nome da Instituição, pessoa jurídica com sede na (endereço da instituição), cidade [REDACTED], Estado [REDACTED], inscrita no CNPJ/MF sob nº [REDACTED], neste ato representada por nome/endereço/CPF do representante legal (Agente de Custódia), pelo presente instrumento particular e na melhor forma de direito, na qualidade de Agente de Custódia, conforme definido no Glossário da B3, solicita habilitação para acesso ao Sistema de Distribuição de Ativos (DDA) da B3 para fins de encaminhamento de pedidos de reserva referentes ao exercício de direitos

de prioridade no âmbito de ofertas públicas primárias que conceda prioridade aos atuais detentores dos valores mobiliários ofertados, nos termos da RCVM 160, conforme alterada, e declara, para os devidos fins, que está ciente de todos os termos, procedimentos e condições previstos nos Normativos da B3, além da regulamentação aplicável, aderindo assim, em caráter irrevogável e irretratável, a seu integral teor e obrigando-se a cumprir todas as obrigações ali previstas, reconhecendo e declarando, neste ato, que:

- (i) as ofertas públicas de distribuições de valores mobiliários, nos termos da RCVM 160, configuram operações realizadas no mercado de balcão não organizado, regidas por regramento específico, não configurando responsabilidade de contraparte central por parte da B3 em relação à sua liquidação;
- (ii) os procedimentos relativos ao envio de pedidos de reserva e sua confirmação por meio do depósito dos respectivos valores deverão observar exclusivamente o previsto nos Normativos da B3; e
- (iii) o Agente de Custódia é responsável perante seus clientes em relação à efetivação do exercício do direito de prioridade no âmbito das ofertas públicas primárias, em estrita observância das condições divulgadas pela companhia nos termos da RCVM 160 e dos Normativos da B3.

O Agente de Custódia autoriza expressamente, neste ato, de maneira irrevogável e irretratável, que a B3 execute as garantias depositadas nos termos dos Normativos B3 na hipótese de o Agente de Custódia não realizar tempestivamente o depósito dos recursos necessários à liquidação dos ativos a ele alocados, declarando, neste ato, que as autorizações necessárias junto aos

159/2023-PRE

acionistas sob sua responsabilidade, caso aplicável, foram obtidas, de modo a viabilizar a execução de garantias aqui prevista, isentando a B3 de quaisquer responsabilidades nesse sentido.

Ao firmar o presente, o(s) representante(s) da instituição atesta(m) perante a B3, para todos os fins e efeitos, ter(em) os poderes necessários e suficientes para validamente vinculá-la, nos termos da adesão dada neste documento, conforme disposto nos instrumentos constitutivos e na documentação societária pertinente da instituição.

O presente termo é firmado em 2 (duas) vias de igual teor e forma para que produza os devidos efeitos de fato e de direito.

(cidade), de de de .

Nome e assinatura dos representantes legais da instituição

Testemunhas

Nome:

RG:

CPF:

Nome:

RG:

CPF: