

15 de dezembro de 2017
012/2017-DN

COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento Cetip UTMV

Ref.: **Segmento Cetip UTMV – Implementações em Março de 2018.**

Informamos que estão previstas para março de 2018 as implementações listadas a seguir, cuja a data será oportunamente divulgada.

Módulo	Descrição	Documentação atualizada
Swap	Criação do arquivo DPARAMETROS DISPARORESET_SWAP, contendo os parâmetros de reset cadastrados (inclusive as datas de eventos futuros) para os contratos de swap que possuem essa funcionalidade.	O layout em implementação encontra-se disponível em www.cetip.com.br , Comunicados e Documentos, Manuais de Operações, Layout em Implementação, SWAP - DPARAMETROS DISPARORESET_SWAP.
	Ajustes na metodologia de cálculo da curva Libor. <ul style="list-style-type: none">– Flexibilização no preenchimento do campo “Percentual”, que permitirá a indicação de valores diferentes de 100% no registro e a alteração de contratos.– Alteração na metodologia de cálculo do fator de juros da curva Libor.– Alteração na metodologia de cálculo utilizando o campo “Alíquota IR”.– Adaptação do sistema para que o deslocamento da data fixing indicado no registro considere dias corridos (exceto sábado e domingo). Atualmente, esse deslocamento considera dias úteis do calendário brasileiro.	Os detalhes da nova metodologia de cálculo encontram-se disponíveis em www.cetip.com.br , Comunicados e Documentos, Manuais de Operações, Layout em Implementação, SWAP – Alterações na curva Libor.

Módulo	Descrição	Documentação atualizada
Títulos e Valores Mobiliários	<p>Disponibilização de alteração dos campos abaixo por tela e por arquivo, no Registro de Direitos Creditórios em Lote, quando o IF garantido for LCA ou CDCA.</p> <ul style="list-style-type: none"> – Moeda – Natureza do Emissor – Nome/Razão Social do Emissor – Código do Emissor – Razão Social do Credor – Código do Credor – Produto Agrícola – Safra – Forma de Liquidação – Taxa Referencial ou Indexador – Percentual do Indexador – Taxa Efetiva Anual – Número do Controle – Código Ref. Bacen – Finalidade – Garantia Especial – Forma de Pagamento – Periodicidade de Juros – Juros a Cada – Amortização a Cada – Tipo de Amortização 	<p>O layout em implementação encontra-se disponível em www.cetip.com.br, Comunicados e Documentos, Manuais de Operações, Layout em Implementação, Registro de Direitos Creditórios.</p>
	<p>Alteração no nome do arquivo DCESTAGARANTIAS para DGARANTIA. O arquivo também passará a exibir as informações de todos os ativos em garantia, mesmo aqueles que não estiverem vinculados em cestas de garantias. Serão acrescentados novos campos de informação: Tipo de Garantia e Direitos para Garantidor (sim ou não).</p>	<p>O layout em implementação encontra-se disponível em www.cetip.com.br, Comunicados e Documentos, Manuais de Operações, Layout em Implementação, DGARANTIAS.</p>
	<p>Disponibilização de alteração dos campos abaixo por tela e por arquivo, no Registro de Condições do Lastro de LCI.</p> <ul style="list-style-type: none"> – Código IF – Quantidade do IF – Tipo de Crédito – Valor Contratado – Data de Contratação da Operação – Natureza do Cliente – Taxa Referencial ou Indexador – Percentual do Indexador – Taxa Efetiva Anual 	<p>O layout em implementação encontra-se disponível em www.cetip.com.br, Comunicados e Documentos, Manuais de Operações, Layout em Implementação, Registro de Condições do Lastro.</p>

Módulo	Descrição	Documentação atualizada
	Habilitação da transferência sem financeiro com base na seleção dos ativos na posição de custódia Própria Livre, no nível de conta ou comitente, sem a necessidade de digitação do Código IF e Quantidade.	O Manual de Operações atualizado estará disponível na data da implementação em www.cetip.com.br , Comunicados e Documentos, Manuais de Operações, Títulos de Renda Fixa, Funções – Títulos e Valores Mobiliários. O layout em implementação encontra-se disponível em www.cetip.com.br , Comunicados e Documentos, Manuais de Operações, Layout em Implementação, Transferência de Custódia sem Financeiro.
Mensageria	<ul style="list-style-type: none"> – Inclusão de nova tag Destino da Colocação na CTP0052 e CTP5001. – Disponibilização da operação de compra e venda definitiva pela CTP0052 para os ativos CDB-V, LCI-V e COE. – Possibilidade de realizar o estorno das operações de Depósito, Compra e Venda Definitiva e Retirada de Custódia do mercado primário, pela CTP0100. 	O Manual de Mensageria atualizado estará disponível na data da implementação em www.cetip.com.br , Comunicados e Documentos, Orientação à Mensageria, Manual de Mensageria.

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/ 	Os layouts em implementação encontram-se disponíveis em www.cetip.com.br , Comunicados e Documentos, Manuais de Operações, Layout em Implementação, DRRC.

Módulo	Descrição	Documentação atualizada
	<p>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> <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> <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”. 	

Módulo	Descrição	Documentação atualizada
	<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 efetivadas em conjunto, mitigando o risco de falha no pagamento entre as partes. <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. 	

Módulo	Descrição	Documentação atualizada
	Ajustes nos demais arquivos enviados para os participantes (Receber Arquivos). <ul style="list-style-type: none">– Inclusão do campo “Duplo Comando para Liquidação” no arquivo DAGENDARRC.– 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 área de Operações e Depositária do Segmento Cetip UTMV, pelos telefones 0300 111 1597 e 0300 111 8040.

Atenciosamente,

José Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos e Clientes