

13 de novembro de 2018  
106/2018-VOP

## COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

Ref.: **Datas de Implementação do Terceiro Conjunto de Melhorias dos Sistemas da Câmara BM&FBOVESPA.**

Conforme Comunicado Externo 081/2018-VOP, de 12/09/2018, e após entendimentos com os participantes do mercado, informamos que o terceiro conjunto de melhorias dos sistemas e processos da Câmara BM&FBOVESPA será implementado nas datas indicadas na Tabela 1.

**Tabela 1: data de implementação dos sistemas**

Sistema	Data de implementação
NGA – Novo Garantias	23/11/2018
RTC – Real Time Clearing	26/11/2018
BTB – Banco de Títulos BM&FBOVESPA	03/12/2018

Ressaltamos que as informações históricas superiores a 90 dias corridos (i) de ofertas não disponíveis, ou seja, ofertas já fechadas ou canceladas; e (ii) de pré-contratos passarão a ser acessadas apenas por meio do Serviço de Dados Históricos (SDH).

As alterações descritas na Tabela 2 serão ativadas em data posterior, a ser informada após a aprovação dos órgãos reguladores.

**Tabela 2: melhorias dos processos e sistemas**

Sistema	Processo	Descrição
RTC – Real Time Clearing	Administração de risco	Alteração no cálculo de risco de operações não alocadas (CORE1): o cálculo do risco de operações estruturadas passa a ser feito considerando-se a alocação dos negócios resultantes de uma mesma estrutura para um mesmo comitente.
RTC – Real Time Clearing	Administração de risco	Alteração do cálculo de risco de operações não alocadas (CORE1) considerando inadimplência simultânea de N maiores contas máster, com objetivo de aperfeiçoar o cálculo do saldo operacional dos PNPs/PLs.

Ressaltamos que as alterações do catálogo de mensagens dos fluxos de administração de riscos decorrentes das alterações da Tabela 2 serão implementadas com o RTC no dia 26/11/2018. Tais alterações estão listadas na Tabela 3.

**Tabela 3: alterações do catálogo de mensagens em 26/11/2018**

<b>Sistema</b>	<b>Processo</b>	<b>Descrição</b>
RTC – Real Time Clearing	Mensagem de resposta bvmf.086.02 (Consulta do risco intradiário)	Inclusão do campo “Consolidated NonAllocated N Largest Master Account”, decorrente da alteração no modelo do cálculo de risco não alocado que passa a mostrar N maiores contas máster
RTC – Real Time Clearing	Mensagem de envio bvmf.208.01 (Simulação de risco não alocado)	Inclusão do campo “Account Identification” nos blocos “Regular Positions”, “Cash Market Positions”, “Equities Forward Positions” e “Equities Options Positions”, com o objetivo de criar posições para determinada conta máster.
RTC – Real Time Clearing	Mensagem de envio bvmf.219.01 – bvb.100.01 (Simulação de risco não alocado)	Inclusão do campo “Account Identification” nos blocos “Regular Positions”, “Cash Market Positions”, “Equities Forward Positions” e “Equities Options Positions”, com o objetivo de criar posições para determinada conta máster.
RTC – Real Time Clearing	Mensagem de resposta bvmf.209.01 (Simulação de risco não alocado)	Inclusão do campo “Consolidated NonAllocated N Largest Master Account”, decorrente da alteração no modelo do cálculo de risco não alocado que passa a considerar N maiores contas máster.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Suporte à Pós-Negociação, pelo telefone (11) 2565-5000, opção 3, ou pelo e-mail [ssp@b3.com.br](mailto:ssp@b3.com.br).

Cícero Augusto Vieira Neto  
Vice-Presidente de Operações, Clearing e Depositária