

12 de setembro de 2018
081/2018-VOP

COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

Ref.: Entrega do Terceiro Conjunto de Melhorias dos Sistemas da Câmara BM&FBOVESPA e Publicação de Nova Versão do Catálogo de Mensagens e Arquivos.

A B3 informa os itens (relacionados no Anexo deste Comunicado Externo) que irão compor o terceiro conjunto de melhorias de processos e sistemas da Câmara BM&FBOVESPA. Essa iniciativa ocorre em linha com os compromissos e os entendimentos mantidos com os participantes, reforçados com a entrega, em agosto de 2018, do segundo conjunto de melhorias e correções da Câmara BM&FBOVESPA.

Também serão implementados, concomitantemente com o terceiro conjunto de melhorias, os novos produtos divulgados no Comunicado Externo 015/2018-VPC, de 27/08/2018:

- Contrato Futuro de Ações e Units;
- Operação Estruturada de Rolagem de Futuro de Ações e Units;
- Microcontrato Futuro de Standard & Poors 500;
- Operação Estruturada de Rolagem de Microcontrato Futuro de Standard & Poors 500;
- Empréstimo de BDR Não Patrocinado Nível I;
- Contratos futuros de moedas negociados em dólares dos Estados Unidos;
- Minicontrato de Opções sobre Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial;
- Minicontrato de Opções sobre Taxa de Câmbio de Reais por Dólar Comercial com vencimento semanal;
- Contrato de Opções sobre Futuro de DI – Tipos 5, 6, 7, 8 e 9; e
- Operações Estruturadas de Volatilidade de Taxa de Juro Forward (VTF).

Todas as informações, detalhes e atualizações sobre cada um dos novos produtos estão disponíveis em www.b3.com.br/clientes.

Será realizado workshop técnico sobre esses produtos em **18/09/2018**, às 8h30, na B3 (Praça Antonio Prado, 48, 3º andar), em São Paulo (SP). Para participar, é necessário efetuar inscrição. [Garanta sua vaga.](#)

O workshop também será transmitido via streaming, não sendo necessário fazer inscrição. Basta acessar www.tvb3.com.br no dia do evento, no horário agendado.

É importante ressaltar que o lançamento desses produtos está condicionado às respectivas aprovações dos órgãos reguladores.

A nova versão do Catálogo de Mensagens e Arquivos, com atualizações relacionadas aos catálogos de Administração de Colaterais, Administração de Risco e Cadastro de Participantes, está disponível em www.bvmfnet.com.br, Manuais, Clearing BM&FBOVESPA, Catálogo de Mensagens e Arquivos.

O terceiro conjunto de melhorias e aprimoramentos de processos e sistemas da Câmara BM&FBOVESPA será disponibilizado para certificação a partir de 22/10/2018; e o Sinacor a partir de 26/10/2018, com expectativa de implementação em produção na segunda quinzena do mês de novembro.

Os interessados em testar e certificar as melhorias e os aprimoramentos de processos e sistemas da Câmara BM&FBOVESPA poderão solicitar suporte pelo telefone (11) 2565-4400 ou pelo e-mail cert@b3.com.br.

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.

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

Anexo do Comunicado Externo 081/2018-VOP

1. Melhorias dos processos e sistemas da Câmara BM&FBOVESPA

1.1. Sistema RTC

Sistema	Processo	Descrição
RTC – Real Time Clearing	Administração de Riscos	Alteração do cálculo de risco de operações não alocadas (CORE1) considerando inadimplência simultânea de N Maiores contas máster, com objetivo de melhorar o cálculo do saldo operacional dos PNPs/PLs. É importante ressaltar que a alteração do cálculo de risco de operações não alocadas (CORE1) está condicionada às respectivas aprovações dos órgãos reguladores.
RTC – Real Time Clearing	Mensagem de resposta bvmf.086.02 (Consulta do risco intradiário)	Inclusão do campo “Consolidated Non-Allocated 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 Non-Allocated N Largest Master Account”, decorrente da alteração no modelo do cálculo de risco não alocado que passa a considerar N maiores contas máster.

2. Correção de defeitos

Sistema	Processo	Descrição
RTC – Real Time Clearing	Repasse	Correção da mensagem de erro apresentada na tela quando um PNP tenta repassar parcialmente uma operação de estratégia.
NGA – Novo Garantias	Retirada de ações com 100% de deságio (por excesso de limite)	<p>Quando o participante realizava a requisição de retirada de ações e existia uma quantidade não valorizada pelo excesso de limite, o sistema bloqueava 100% dessas quantidades não valorizadas, inviabilizando a requisição da retirada.</p> <p>O sistema passará a permitir a requisição da retirada das quantidades de ações não valorizadas, desde que o saldo do cliente seja positivo.</p> <p>Se o saldo for negativo, o sistema irá bloquear somente a quantidade de ações correspondente ao valor do risco do cliente, mas ainda manterá a chamada de margem em aberto para o respectivo atendimento.</p>
NGA – Novo Garantias	Arquivo BVBG.078.01 (Consulta Movimentação de Garantias)	<p>No arquivo BVBG.078.01 (Consulta Movimentação de Garantias), o qual é gerado no processamento batch (abertura), a tag “AppHdr” não estava apresentando o nome da mensagem SMP correta (bvmf.113.02 – Movimentação de Garantias), mas sim, de forma incorreta, estava apresentando o código bvmf.111.02, que se refere à Consulta de Garantias.</p> <p>A mensagem correta, bvmf.113.02 – Movimentação de Garantias, passará a ser demonstrada nesta tag (“AppHdr”).</p>

Sistema	Processo	Descrição
NGA – Novo Garantias	Mensagem bvmf.112.01 (Consulta de Garantias Depositadas)	<p>Na mensagem bvmf.112.01 (Consulta de Garantias Depositadas):</p> <ul style="list-style-type: none"> as tags “SchemeNm” e “Issr” estavam sendo divulgadas com os valores incorretos. Os dados foram corrigidos e serão divulgados nesta mensagem, conforme o “external code list”; não estavam sendo apresentados os campos “Correction Type” e “InterestRateIndex”. Esses campos serão demonstrados nesta mensagem.
NGA – Novo Garantias	Mensagem bvmf.168.01 (Retirada de Garantias)	<p>Quando o participante efetuava uma requisição de retirada de Valor em Espécie (BRL), via Banco B3, por meio da mensagem bvmf.168.01 (Retirada de Garantias), ocorria um erro na operação quando o campo “ExctdMvmntTp” era preenchido com “1 – Padrão” ou “3 – ValorEspecieOutros”.</p> <p>Houve correção nos domínios da tabela “ExternalCollateralExecutedMovementType Code”, onde foi alterado o tipo “1” para “1 – Banco B3”, conforme descrito no “external code list”.</p>
NGA – Novo Garantias	Envio e recebimento de mensagens após o encerramento do Sistema de Garantias (NGA)	<p>Após o encerramento do NGA no fim do dia, o sistema não estava enviando as mensagens SMP de rejeição das operações não finalizadas (pendentes de atualização e/ou rejeição).</p> <p>Com a correção, quando o sistema estiver sendo encerrado, os participantes serão informados que as operações pendentes não foram finalizadas, sendo estas rejeitadas pelo sistema.</p>

Sistema	Processo	Descrição
NGA – Novo Garantias	Mensagem bvmf.160.01 (Transferência de Garantias)	Quando o participante de origem no processo de transferência de garantias enviava a mensagem bvmf.160.01 (Transferência de Garantias) para requisitar a aprovação da transferência pelo participante contraparte, a tag “SubAccount” dentro do tipo de ativo “OtherCollateral” no XSD da mensagem era obrigatória, agora é opcional.