



GT – IMERCADO



AGENDA:

LISTADOS – 09:30 às 11:00

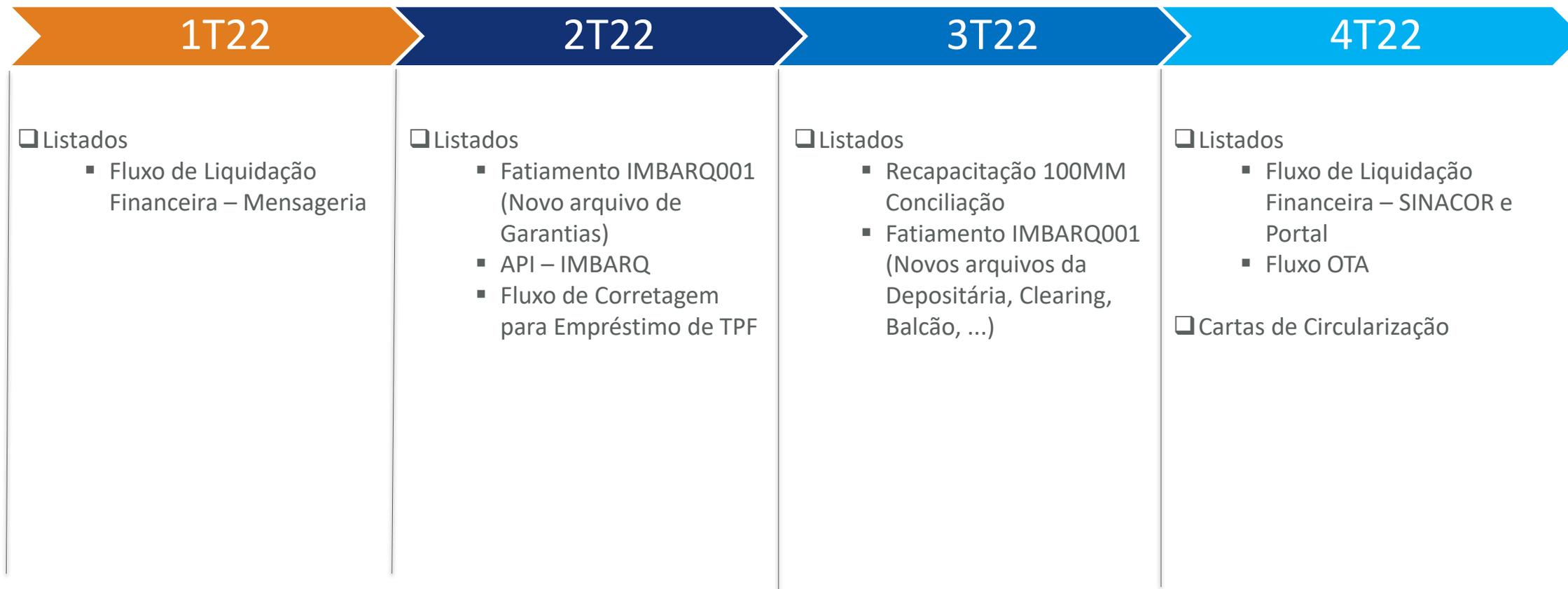
1. ROADMAP
2. EVOLUÇÃO DO PRE MATCHING
3. FLUXO DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA
4. IMBARQ
 - API
 - FATIAMENTO DO IMBARQ001
5. PORTABILIDADE DE CADASTRO
6. LIQUIDAÇÃO EM D-1
 - FLUXO PRE MATCHING LOCAL - A VISTA
 - FLUXO DE GARANTIAS
7. DEMAIS ASSUNTOS

BALCÃO – 11:00 às 11:30

1. UPDATES - TOMBAMENTO INFOHUB - IMERCADO
2. PRÓXIMOS ENTREGAS DE ATIVOS PRIVADOS (CFF, CBIO E LIG)
3. ANTECIPAÇÃO DE CARACTERÍSTICAS DE ATIVOS
4. DEMAIS ASSUNTOS

1. ROADMAP LISTADOS

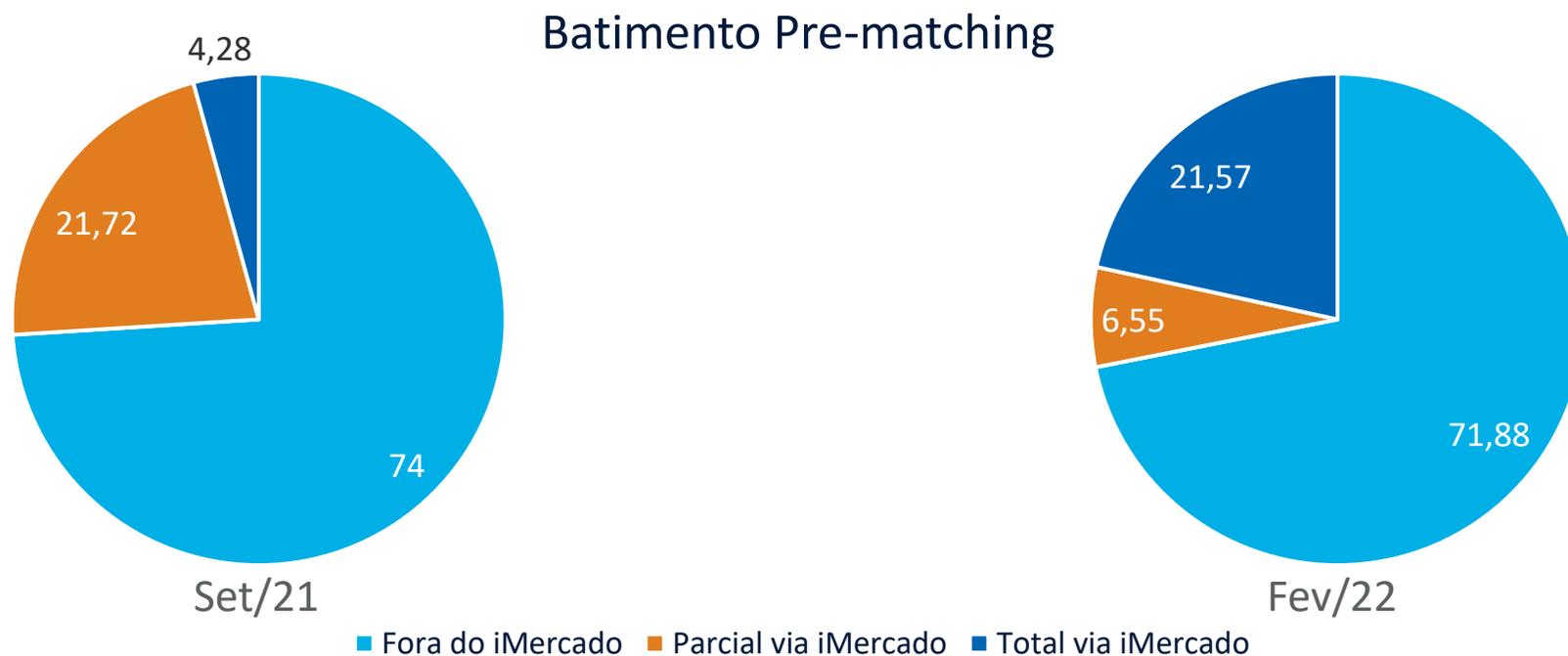
Roadmap Listados – iMercado 2022



2. EVOLUÇÃO PRE-MATCHING

Overview

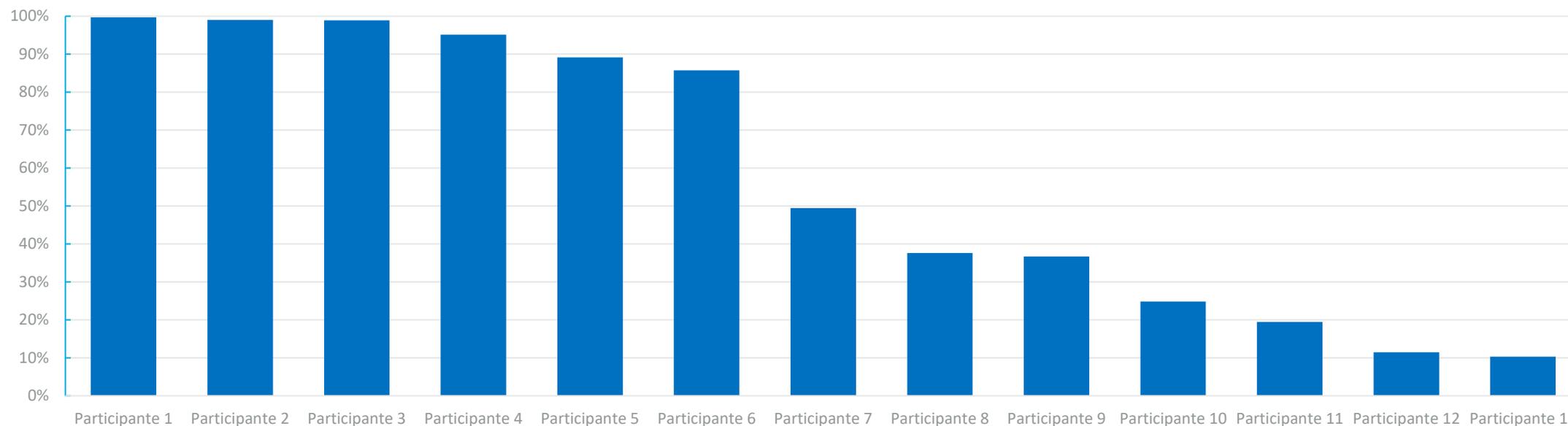
- Num primeiro momento, foi realizada a abordagem de tombar clientes que utilizavam iMercado Parcialmente para um uso total do serviço:



Overview

- No mês de fevereiro, 6 participantes apresentaram mais de 80% de seu volume financeiro totalmente batido via iMercado pre-matching

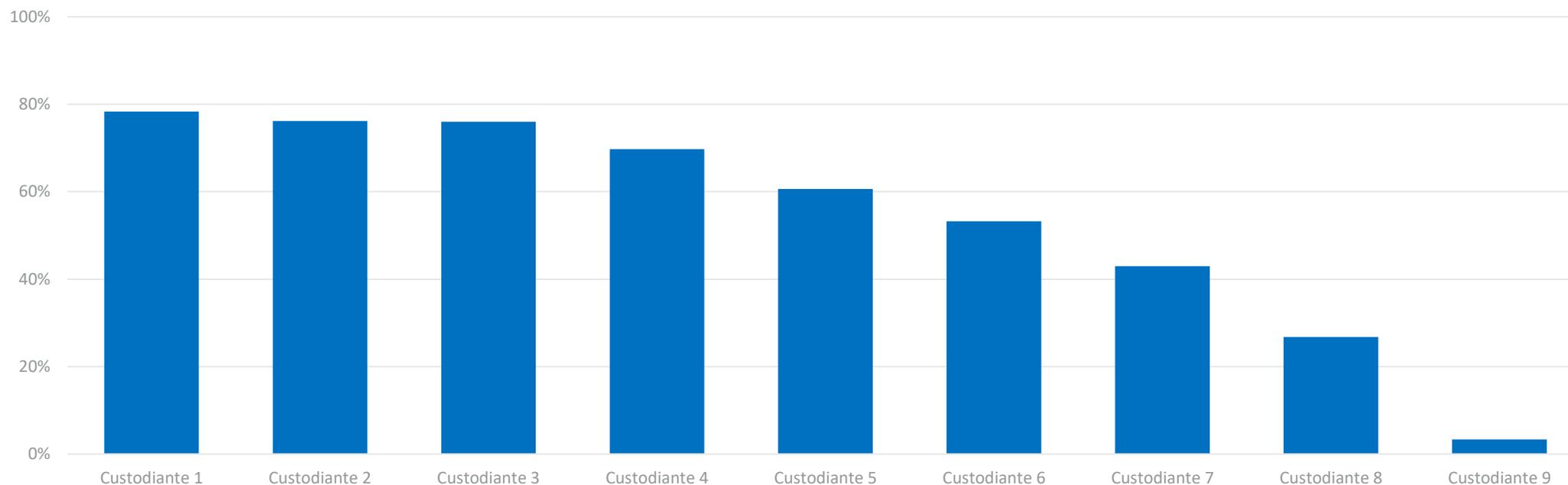
Percentual do Volume Financeiro do PNP/PL utilizando o Pré-matching, via iMercado



Overview

- No mês de fevereiro, 6 custodiantes apresentaram mais de 50% de seu volume financeiro totalmente batido via iMercado pre-matching

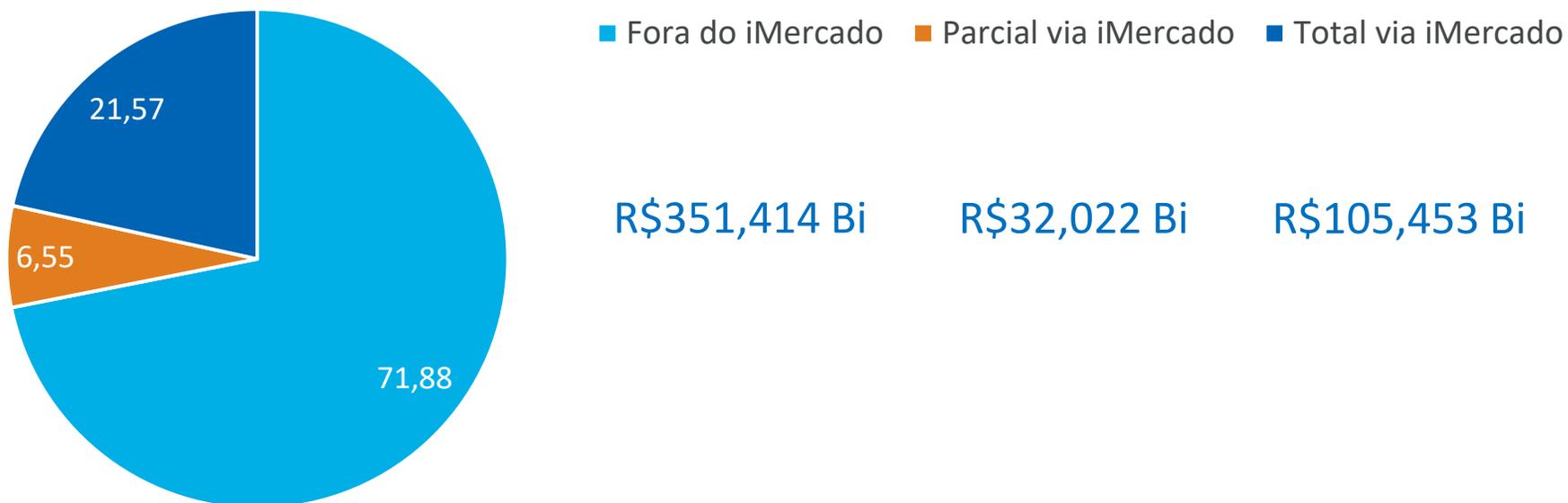
Percentual do Volume Financeiro do Custodiante utilizando o Pré-matching, via iMercado



Overview

- Baseado em Fev/22, os volumes financeiros cobertos pelo iMercado são:

Batimento Pre-matching



Próximos Passos

- Atualmente, B3 mantém contato com aproximadamente 20 participantes, realizando um acompanhamento bilateral voltado para adesão ao iMercado Pre-Matching
- A nova abordagem busca incluir no fluxo participantes que realizam o batimento fora do iMercado. Com a entrada desses clientes, podemos ter um aumento de até 50% na cobertura dos volumes batidos via iMercado Pre-Matching;
- Para maiores informações, entrar em contato através do produtoimercado@b3.com.br, seu RM ou atendimento Sinacor.

3. LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA

Status do Projeto

- Disponível no ambiente de certificação para mensageria
- Portal do iMercado (Custodiantes) prevista para certificação em setembro
- SINACOR será entregue na versão 22.3 (homologação em setembro)

Proposta de Ajuste

- Não utilização de detalhamento dos lançamentos rejeitados

❖ Campos identificação única

- ✓ ISIN
- ✓ Ticker
- ✓ Quantidade
- ✓ Nº Contrato BTB
- ✓ Tomador/Doador

❖ Campos de repetições

- ✓ Side
- ✓ Lançamento Financeiro
- ✓ Valor do Lançamento

4. IMBARQ – API E FATIAMENTO

IMBARQ – Consumo dos Arquivos IMBARQ via API



Fatiamento do IMBARQ001 – Modelo Atual



Fatiamento do IMBARQ001 – Modelo Proposto

Empréstimo de Ativos (Ofertas do Book)

IMBARQ013

Depositária
IMBARQ012

Administração de Colaterais
IMBARQ014

Liquidação de Ativos

Liquidação Financeira
IMBARQ004

Controle de Posições

Balcão/Renda Fixa
IMBARQ011

Liquidação de Contratos

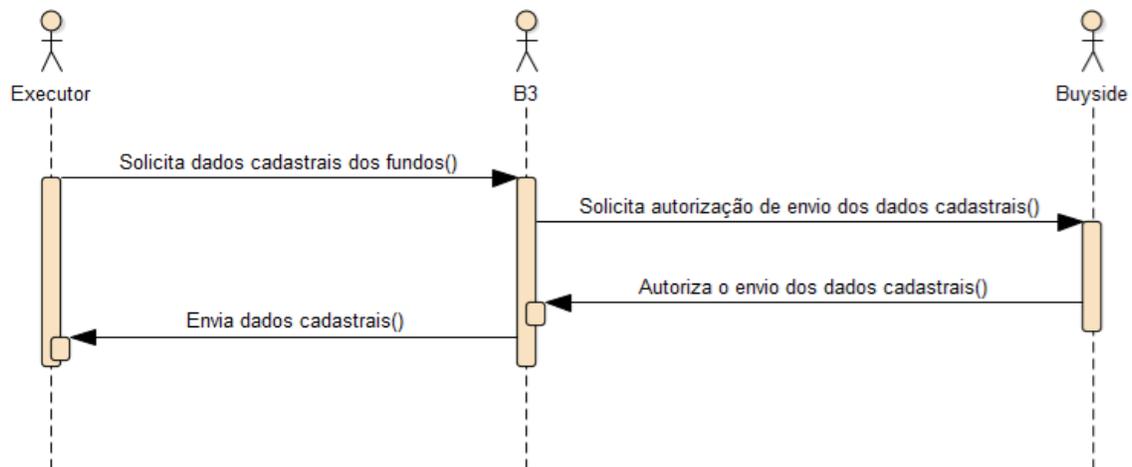


IMBARQ006

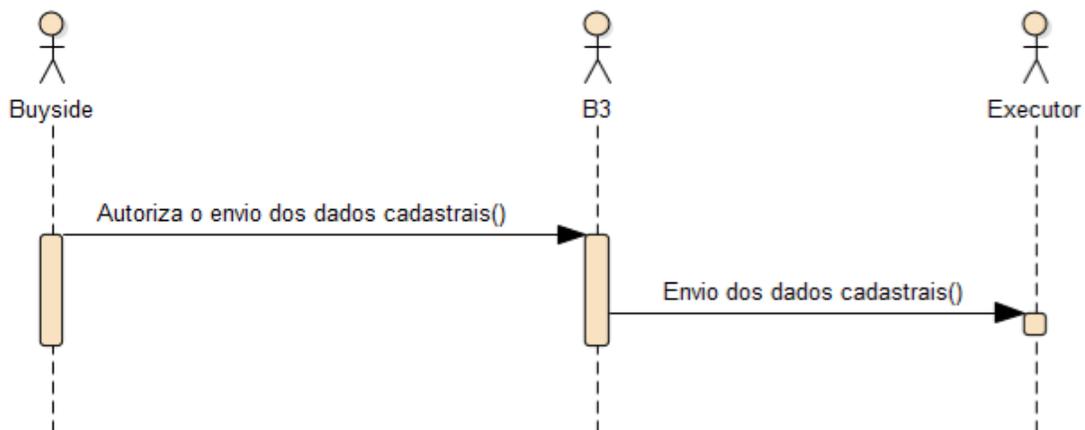
5. PORTABILIDADE DE CADASTRO

Portabilidade de Cadastro

sd Portabilidade - Proposta A



sd Portabilidade - Proposta B



6. LIQUIDAÇÃO D-1

7. FLUXO PRE-MATCHING - LOCAL

Mercado à Vista

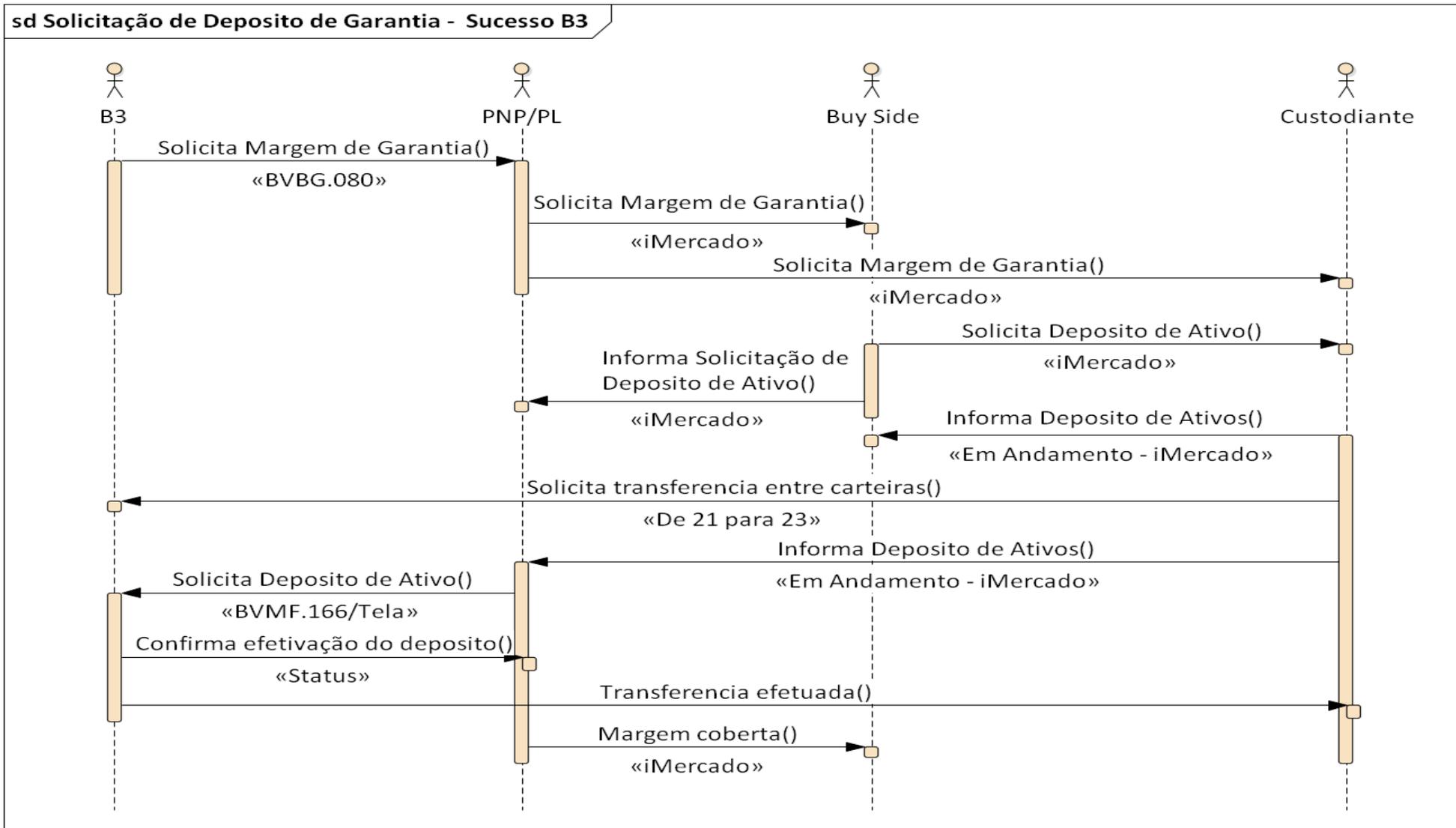
O fluxo do Pre-Matching, via iMercado, visa viabilizar os processos de batimento de operações entre participantes e custodiantes; contribuindo com a agilidade e a precisão da liquidação financeira.

Considerando o cenário no qual o ciclo de liquidação será reduzido para D+1, incentivamos a adesão desse fluxo, atualmente utilizado para INR, também para clientes locais.

Posteriormente, desenvolveremos melhorias para incluir o mercado de futuros.

8. FLUXO DE GARANTIAS

Deposito e Retirada de Ativos em Garantia



9. DEMAIS ASSUNTOS

1. UPDATES – TOMBAMENTO INFOHUB - IMERCADO

Roadmap Balcão – iMercado



■ Tombamento Infohub x iMercado

■ Demais entregas

Ativos

- Captação bancária: CDB-CDBS-CDBV/LF-LFS-LFSN-LFSP/DPGE/NC/DEB
- Imobiliários: CRI – CCI – LCI (LCI tombamento em conjunto com agro - 2T)
- Agro: CDA-WA/CRH-CRP-CRPH/CDCA-LCA/TDA/CPR/CRA
- Cotas de fundos
- CBIO
- LIG
- Derivativos com e sem CCP: Termo, opção e swap
- Demais ativos

2. PRÓXIMOS ATIVOS IMERCADO (FUNDOS, CBIO E LIG)

Próximos Ativos

- Os próximos ativos a serem entregues pelo iMercado são:
 - Fundos
 - CBIO
 - LIG
- Os ativos foram demandados por mais de 5 clientes, buscando otimizar sua operação;
- Caso as instituições entendam que querem participar de futuras priorizações, devem entrar em contato através do ProdutoiMercado@b3.com.br para posterior avaliação;

3. ANTECIPAÇÃO DE CARACTERÍSTICAS DE ATIVOS

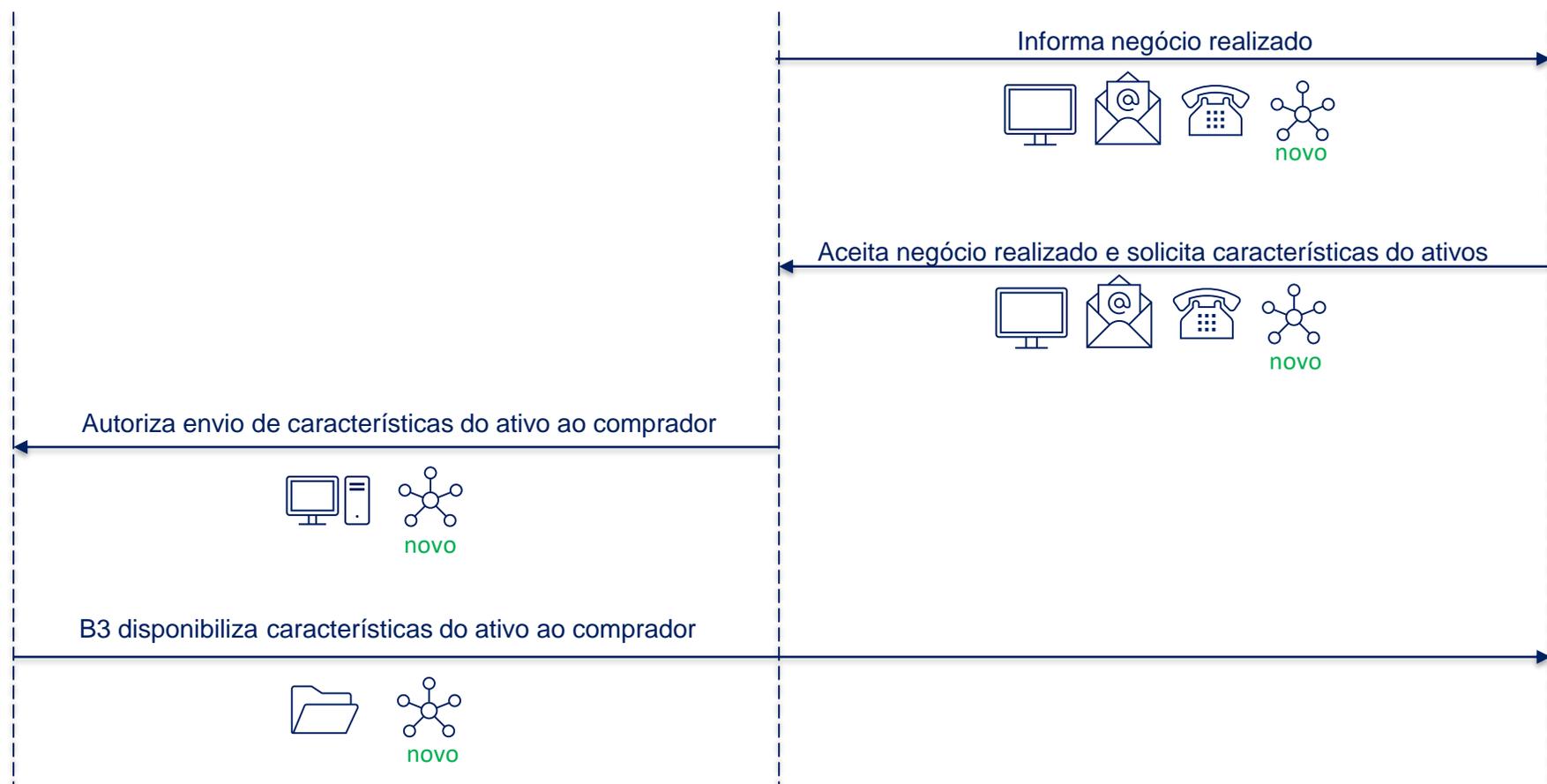
Antecipação Cadastral de Ativos - Negociação

[B]³

Vendedor



Comprador



- Trader (Voice/Tela)
- E-mail
- Telefone
- Rede iMERCADO
- Tela NoMe
- Malote / Conecta

4. DEMAIS ASSUNTOS

[B]³

BRASIL
BOLSA
BALCÃO