

ATA DE REUNIÃO

REUNIÃO DO GRUPO DE TRABALHO IMERCADO

Data: 24/03/2021

Horário: 09:30

Local: Webex

Assuntos discutidos:

1. Roadmap

A B3 apresentou Roadmap de listados para o ano de 2022.

2. Evolução do Pre-Matching

Foi apresentada a evolução da utilização do serviço, na qual o engajamento de participantes e custodiantes que já utilizavam a rede de maneira parcial, resultou em um significativo aumento do batimento das operações totalmente realizadas pelo iMercado, passando de 4,28% em setembro/21 para 21,57% em fevereiro/22. Temos como objetivo o batimento **total** das operações via iMercado. Com isso, estamos realizando acompanhamento da utilização do serviço nas instituições para trazermos novas adesões, bem como auxiliar nas dificuldades existentes.

3. Fluxo Liquidação Financeira

A B3 apresentou o status do projeto, mencionando a disponibilização do ambiente de certificação para a mensageria. A previsão da entrega que atenderá esse serviço pelo Portal iMercado (acessado pelos Custodiantes) é de setembro/22, mesmo momento que o SINACOR libera sua versão (22.3).

No GT anterior (set/21), os participantes solicitaram a B3 a adição de campos com detalhamentos das operações, para que lançamentos rejeitados fossem analisados por ambas as partes e seguissem o fluxo via iMercado. Porém, após análise de desenvolvedores de sistemas, concluiu-se que a inclusão destes dados traria uma grande complexidade, retardando o prazo inicial do projeto. A B3 compartilhou o ponto acima e foi decidido pelos participantes do GT que daríamos andamento ao projeto sem a cobertura destes dados, para que o mercado pudesse se beneficiar da automatização deste fluxo

antecipadamente e em uma segunda fase, se realmente for necessário, esta melhoria será implementada.

Os participantes mencionaram a importância deste fluxo atender também o batimento de corretagem entre PNP e PL, automatizando como um todo o batimento para as devidas liquidações financeiras. A B3 se propôs a analisar a estrutura da mensagem e os fluxos de negócios e a realizar reuniões bilaterais com os participantes para as devidas adequações, que serão apresentadas no próximo GT.

4. IMBARQ – Consumo dos arquivos via API e Divisão do IMBARQ001

Atualmente, participantes que não possuem acessos aos sistemas da B3 não conseguem automatizar o processo de download dos arquivos IMBARQ, o processo é executado na tela da aplicação do iMercado. Com essa entrega, a B3 disponibilizará ao mercado uma nova forma de consumo dos arquivos IMBARQ: via API. O fluxo para consumo dos arquivos apresentado está disponível em https://clientes.b3.com.br/pt_br/roadmap/sobre/imercado-arquivos-imbarq-consumo-por-api.htm, Material de Apoio.

Conforme deliberações das discussões sobre monitoramento de arquivos de processamento noturno da B3, ocorrerá a divisão do IMBARQ001 - Pós-negociação. As informações do arquivo IMBARQ001 serão divididas em outros seis novos arquivos a serem disponibilizados ao mercado no momento de suas gerações. Informamos que os layouts dos registros dos novos arquivos serão os mesmos daqueles do IMBARQ001. Maiores informações sobre essa entrega estão disponíveis em https://clientes.b3.com.br/pt_br/roadmap/sobre/imercado-divisao-do-arquivo-imbar001.htm, Material de Apoio.

5. Portabilidade de Cadastro

Recebemos uma demanda do mercado para a criação de um novo serviço: automatização do processo abertura de cadastro de fundos de investimentos pelos Participantes Executores. Tal fluxo agilizaria o processo de cadastro, necessário para negociação de produtos operados em contas finais, como por exemplo, empréstimo de ativos.

Foram apresentadas duas propostas para o fluxo, ambas envolvendo o buy-side (gestores), seriam elas:

- a. (i.) Participante Executor solicita as informações cadastrais, (ii.) gestores aprovariam ou não o envio dos dados cadastrais e (iii), B3 enviaria as informações aos participantes mediante aprovação dos gestores; ou
- b. i. Gestores solicitariam o envio das informações para os Executores à B3, (ii.) a B3 enviaria as informações aos participantes Executores.

O mercado demonstrou interesse nesse fluxo e pontuaram uma importância de validação jurídica e regulatória à respeito da entidade responsável pelos dados cadastrais (administradores, gestores ou Carrying).

A B3 irá analisar a questão jurídica e bilateralmente com o auxílio do mercado desenhar novo fluxo do processo, se necessário. Esse item estará na pauta do próximo GT.

6. Liquidação D+1 - Fluxo de Pre-Matching Local e Fluxo de Garantias

Visando a proposta de redução do prazo de liquidação para D+1, a B3, junto aos participantes, mapeou alguns processos operacionais que, se automatizados, auxiliariam o mercado nessa futura redução de prazo de liquidação.

O primeiro processo é o batimento de operações de clientes locais. Neste cenário, entende-se que a mensageria atual do serviço Pre-Matching do iMercado comportaria o batimento das operações de renda variável pelo preço médio. A B3 propôs aos participantes a sua utilização, visto que já é usado para batimento de clientes não residentes (INR), viabilizando os processos de troca de informações entre corretoras/carryings e custodiantes, contribuindo com a agilidade e a precisão da liquidação financeira.

Posteriormente, seriam liberadas melhorias para englobar o mercado de futuros.

O segundo processo mapeado foi o depósito e retirada de ativos em garantia, onde foi apresentado uma proposta de fluxo para automatização deste processo. Os participantes do GT abordaram a possibilidade de inclusão do administrador nesse fluxo e a B3 irá remodelar a proposta para o próximo GT.

7. Tombamento InfoHub – iMercado

Apresentamos que a B3 está difundindo informações de acompanhamento de operações, características de eventos, agenda de eventos e comitentes (LTR) de instrumentos dos grupos de ativos de captação bancária, debentures e imobiliários.

Além das entregas, foi apresentado o roadmap do Tombamento para os demais grupos de ativos, sendo que cotas de fundos e agro devem ser as próximas entregas conforme demanda levantada pelo mercado. As informações das próximas entregas poderão ser acompanhadas por meio do site https://clientes.b3.com.br/pt_br/roadmap/sobre/mercado-disponibilizacao-de-informacoes-online-de-renda-fixa.htm.

8. Antecipação de características de ativos

Atualmente, existem cenários vinculados aos processos de registros que podem demandar o envio das características de ativos dos Vendedores para os Compradores. Foi apresentada, então, uma proposta de fluxo na qual o Vendedor solicita à B3 que envie as informações diretamente ao Comprador, sem a necessidade da distribuição dos dados pelo próprio Vendedor, mitigando riscos operacionais e sistêmicos, bem como colaborando com a agilidade no processo de registro.

9. Considerações Finais

Conforme combinado, foi disponibilizada uma pesquisa de satisfação do GT para entendermos o engajamento e a prioridade dos participantes juntos aos serviços e fluxo apresentados. Mediante as respostas, poderemos entrar em contato com vocês para construirmos/aprimoramos, juntos, as trocas de informações da pós-negociação.

Por fim, foi previsto um novo GT - iMercado para daqui dois meses.