

19 de junho de 2019

021/2019-VOP

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

Ref.: **Nova Versão do Sistema de Risco Pré-Negociação LiNe 5.0.**

Como parte do processo de aprimoramento contínuo de seus sistemas, a B3 implementará, em **01/07/2019**, nova versão do sistema de risco pré-negociação LiNe 5.0 com alterações de comportamento, melhorias e correções, entre as quais se destacam as descritas a seguir.

Alterações de comportamento

a) Netting nas operações executadas na conta origem de repasse (executor de repasse)

Atualmente, todas as contas que são origem de repasse têm a característica de conta transitória, de forma que não há netting nas operações executadas nessa conta. Na nova versão, todas as contas origem de repasse terão a mesma característica da conta destino, isto é, caso a conta destino seja definitiva, a conta origem também terá as características de conta definitiva, tendo ambas as duas netting no consumo dos limites.

b) Modo síncrono – Violação de SPCI/SPVI do carrying

Na versão atual, a violação das métricas de risco SPCI e SPVI do carrying acionam o modo protegido e o LiNe 5.0 envia para o núcleo de negociação solicitação de cancelamento de todas as ofertas que violaram essa métrica. Após o LiNe 5.0 receber o cancelamento das ofertas em aberto, o sistema permitirá somente o ingresso de ofertas com o propósito de redução de posição e de risco.

Na nova versão, quando uma entidade (documento\conta) entrar em modo protegido devido à violação de SPCI e SPVI em um instrumento, o LiNe 5.0 permitirá que novas ofertas sejam enviadas para outros instrumentos, mesmo aumentando a posição. No entanto, as ofertas que tiverem sido enviadas para os instrumentos que violaram a métrica de SPCI e SPVI deverão ter como única finalidade a redução da posição. Como é necessária a validação dos limites do carrying e do executor para garantir a redução do SPCI e SPVI, enquanto estiver em modo síncrono, deve-se esperar aumento de latência das ordens daquela entidade.

Melhorias

a) Detalhamento do motivo do modo protegido

A nova versão do sistema oferecerá ao participante de negociação uma tela que descreve, com detalhes, o motivo de uma entidade ter entrado em modo protegido.

b) Alerta para o executor quando o carrying entrar em modo protegido

A nova versão do sistema enviará um alerta para o participante executor quando uma entidade entrar em modo protegido no carrying. Ressalta-se que o motivo de o documento ter entrado em modo protegido não será informado ao participante executor, ficando essa informação restrita ao carrying.

Defeitos corrigidos

a) Possibilidade de um participante de negociação carregar arquivos com o papel de carrying.

b) Rejeição de modificação de oferta (ClientOrderID Not Found).

c) Criação de opções on-line.

d) Exportação de todos os dados da tela de rejeições.

e) Ordenação do ranking de consumo.

f) Performance na tela de gestão de perfis (Aba SPCI\SPVI).

021/2019-VOP

As especificações técnicas da ferramenta de risco pré-negociação LiNe 5.0 podem ser consultadas em www.b3.com.br/line5.

A B3 continuará aprimorando o sistema LiNe 5.0 e novas alterações serão divulgadas oportunamente.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Suporte à Negociação, pelo telefone (11) 2565-5021 ou pelo e-mail suporteanegociacao@b3.com.br.

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

Juca Ribeiro de Andrade
Vice-Presidente de Produtos
e Clientes