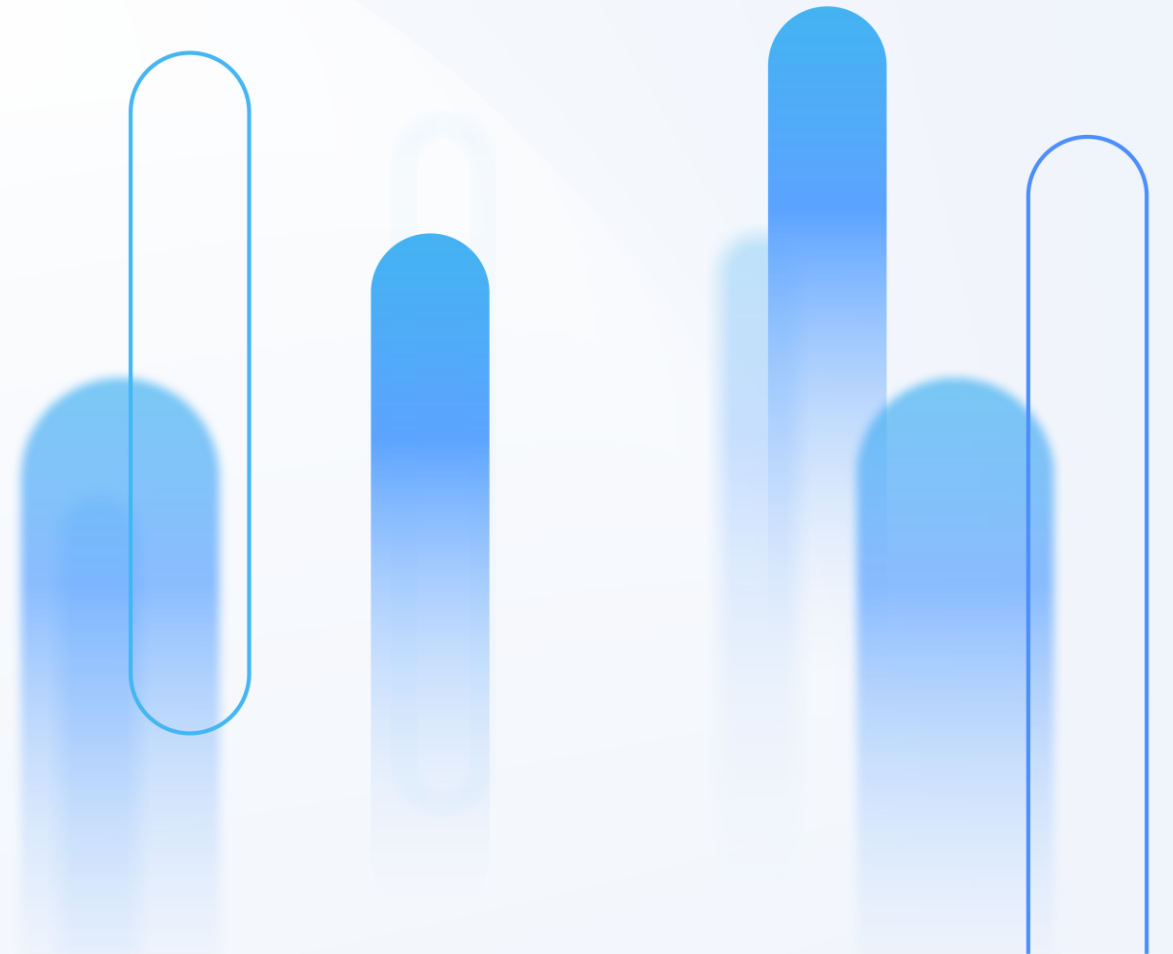


[B]³

GT - iMERCADO



Agenda



Roadmap - 09:35

Listados - 09:40

Troca de Informações (Apresentação da Adesão)

- 1) Pre Matching INR
- 2) Empréstimo de Ativos
- 3) Ficha Cadastral

Troca de Informações (Novas Iniciativas e Desenvolvimentos)

- 4) Pre Matching: Local e Corretagem
- 5) Liquidação Financeira
- 6) Priorização de Novos Fluxos

Relatórios Programados

- 7) Divisão do IMBARQ001
- 8) Informações Registro 06 – Estoque de Empréstimo de Ativos (Hearing)
- 9) Cartas de Circularização

Evolução Tecnológica - 10:50

Balcão - 11:00

Troca de Informações

- 10) Emissão e Distribuição de Renda Fixa Privada – mercado primário (MVP)

Difusão de Informações: Online

- 11) Disponibilização de Informações online de Renda Fixa (tombamento)
- 12) Antecipação de Características de Ativos

Roadmap - 2023



Relatórios Programados

Cartas de Circularização
Melhorias IMBARQ007
Extrato de Balcão

Troca de Informações

Emissão e Distribuição de Renda Fixa Privada
Melhorias Liquidação Financeira (Portal iMercado)
Portabilidade de Cadastro x Fluxo de Garantias

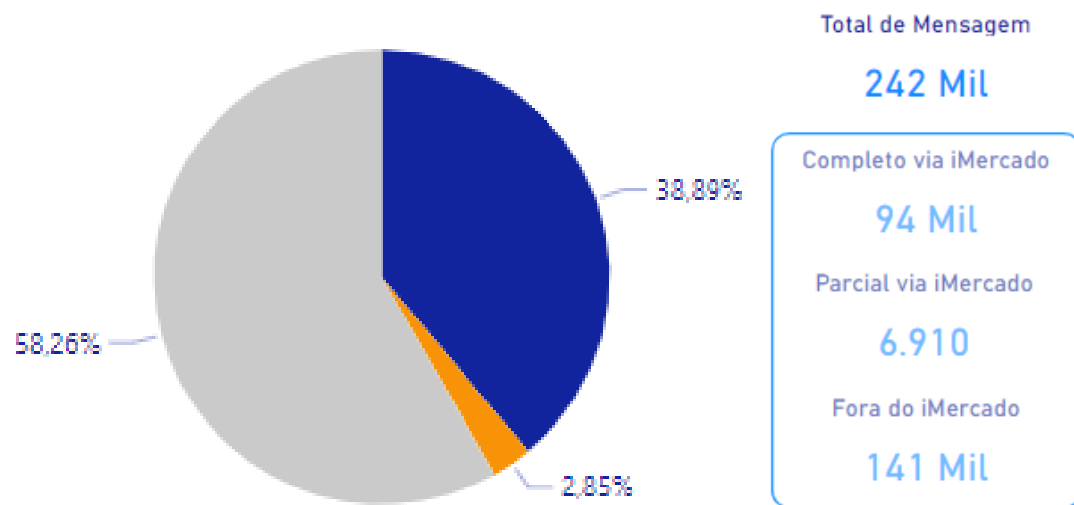
Difusão de Informações Online

Emissão e distribuição de Renda Fixa Privada – Mercado primário
Tombamento Infohub para iMercado - grupos de ativos: cotas de fundos (CFA e CFF), derivativos com/sem CCP, CBIO, LIG (stretch)
Antecipação Cadastral de Ativos (como requisição)
Adequação ICVM 160

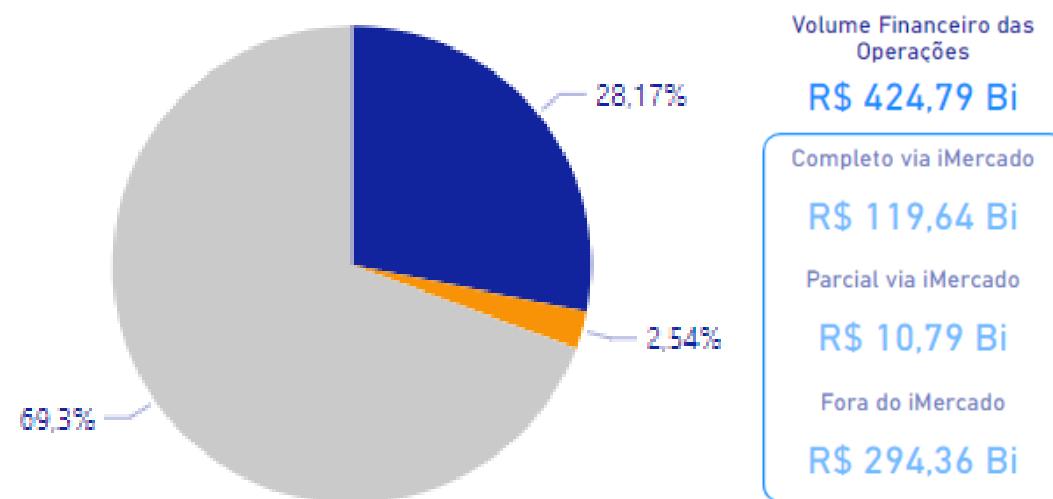
Adesão ao fluxo do Pre Matching INR

Uso do Pre Matching INR, Fev/2023

Em Quantidade



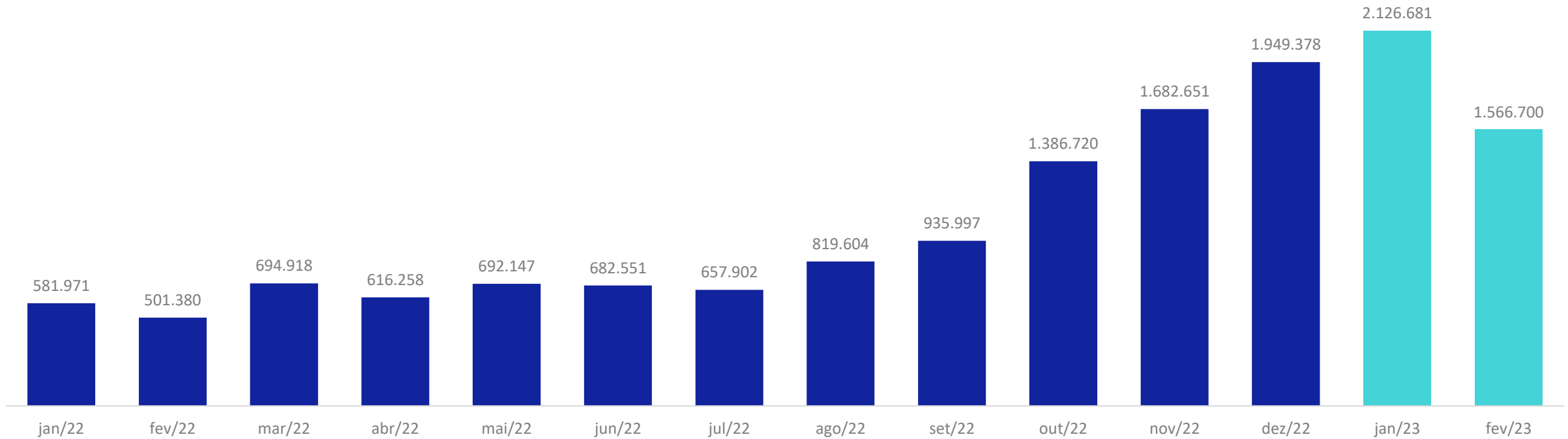
Em Volume Financeiro



● Completo via Imercado ● Parcial via Imercado ● Fora do Imercado

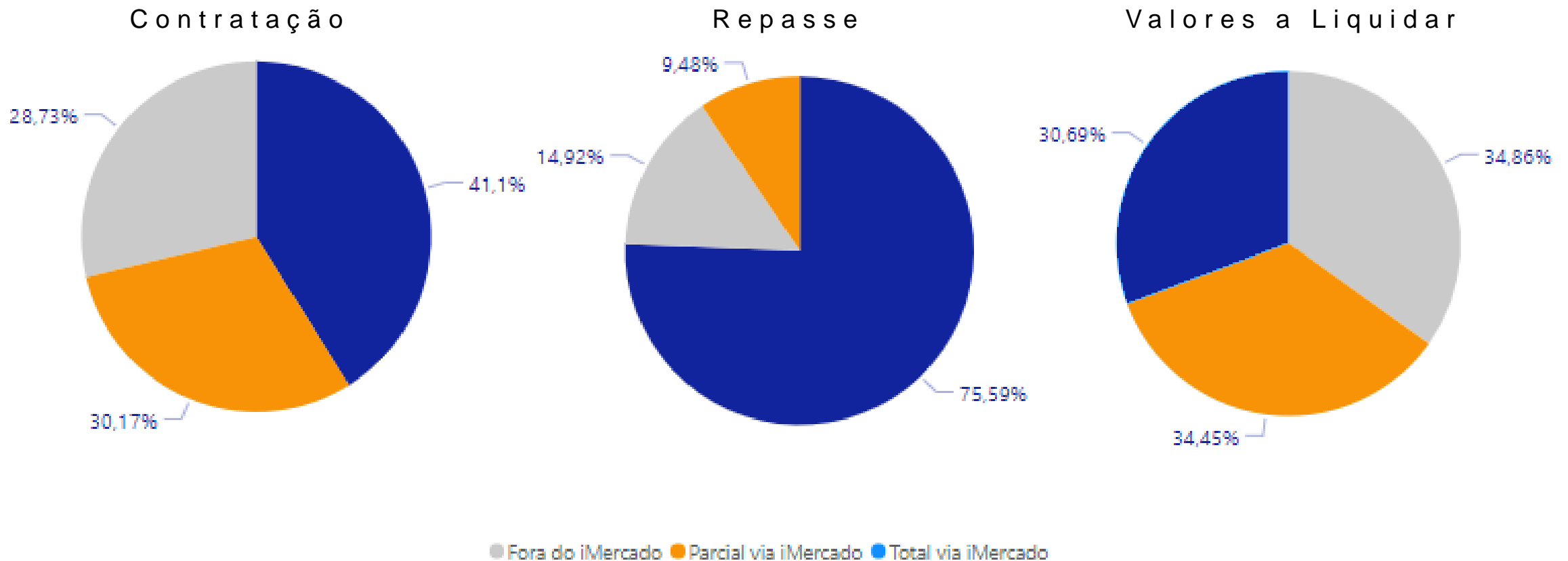
Adesão ao fluxo do Pre Matching INR

Evolução da quantidade de mensagens Pre Matching (2022 x 2023)



Adesão ao fluxo de Empréstimo de Ativos

Uso do Empréstimo de Ativos (em Quantidade), Fev/2023



Adesão ao fluxo da Ficha Cadastral INR

Uso da Ficha Cadastral (em Quantidade), Fev/2023



Utilização do Pre Matching para clientes locais e batimento de corretagem



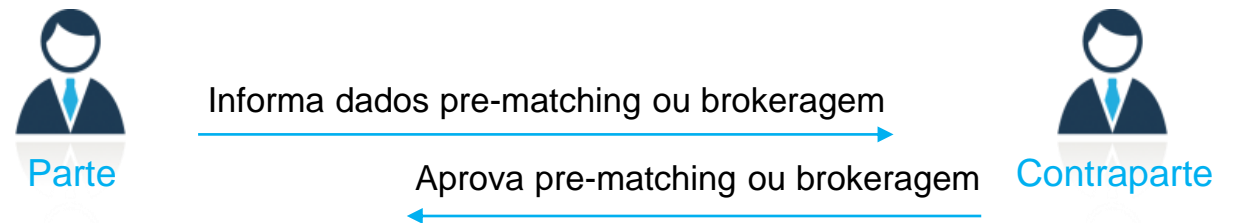
Proposta:

Realizar o batimento de operações a vista de clientes locais, bem como batimento de corretagem de maneira automatizada e online.



Adequações:

Não há alteração nas mensagens



Liquidação Financeira



Objetivo:

Automatizar o processo do batimento de liquidação financeira entre PNP, PL e Custodiante através mensageria



Entregas/Planejamento:

Entrega do reinício do fluxo de maneira mais automatizada através do Portal iMercado – 2T23

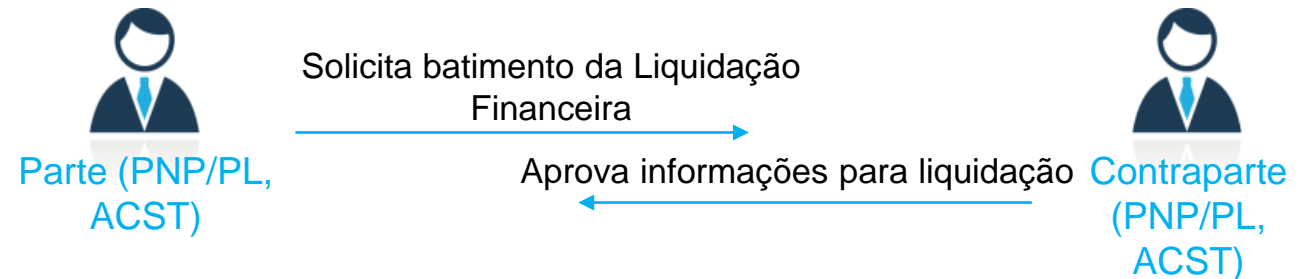
Inclusão de códigos de lançamentos financeiros para batimento – 2T23

Início pela corretora – TBD



Grupo Foco:

Retomada de conversas bilaterais



Priorização dos Novos Fluxos



Garantias x Portabilidade de Cadastro:

(i.) Realizar trocas de informações a respeito de processos de depósito e retiradas de garantias ou (ii.) propiciar a abertura e atualização de contas de fundos de investimentos de maneira centralizada e automatizada pelo iMercado .



Grupo Foco:

Criação de grupo foco



Prontidão do mercado:

TBD

Divisão do arquivo IMBARQ001



Entregas/Planejamento:

- ✓ IMBARQ014 – Informações de Garantias – 2T22
 - ✓ IMBARQ004 – Informações de Liquidação Financeira – 3T22
 - ✓ IMBARQ006 – Informações da Clearing B3 – 3T22
 - ✓ IMBARQ011 – Informações de Balcão – 3T22
 - ✓ IMBARQ012 – Informações da Depositária de Listados – 3T22
 - ✓ IMBARQ013 – Informações de Ofertas de Empréstimos de Ativos– 3T22
-
- ▶ Disponibilização do Plano de Desativação do IMBARQ001 – 4T23
 - ▶ Desativação do IMBARQ001 - 2024



Proximidade:

O time de Produtos do iMercado e/ou Transição externa está em contato com clientes e vendedors

IMBARQ006: Registro 06 - Posições de empréstimo de ativos



Hearing:

Remoção de informações com o campo **Quantidade Atual** zerado do registro 06 do IMBARQ006.

Premissa: continuar fornecendo nos arquivos do iMercado informações que a Clearing B3 disponibiliza aos participantes

Manter as informações no
arquivo tal como estão
atualmente

Retirada as informações de
quantidades atuais zeradas
do registro 06, com a
criação de um novo registro
XX com informações das
posições de empréstimo de
ativos com quantidades
atuais zeradas

Manter o registro 06
inalterado, com a criação
de um novo registro XX
contendo informações das
posições de empréstimo de
ativos com quantidades
atuais diferentes de zero

Cartas de circularização



Objetivo:

Automatizar o processo relativo às cartas de circularização, por meio do iMercado, centralizando os mecanismos de solicitações, aprovações e envios de arquivos



Entregas/Planejamento:

- ✓ Entrega do fluxo - 2T22



Evolução Tecnológica

Formas de Conectividade:

ATUAL

Relatórios Programados
Secure Client, Cloud, Portal iMercado

Troca de informações
FIX, API, Portal iMercado

Difusão de informações
API , Portal iMercado

FUTURO

Streaming, Cloud, API, ...?

Emissão e Distribuição de RF Privada – Mercado Primário (MVP)



Objetivo:

Automatizar a troca de informações no processo de Emissão e Distribuição de Renda Fixa Primária (mercado privado) no segmento de Balcão



Entregas/Planejamento:

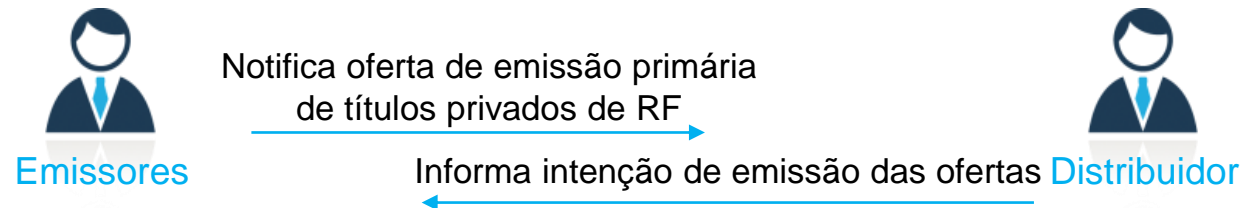
- ✓ Entrega do fluxo de mensageria - 4T22
- ▶ Disponibilização do Portal do iMercado para Emissores – 2T22



Grupo Foco:

Retomada de conversas bilaterais

05



Disponibilização de Informações online de Renda Fixa



Objetivo:

Permitir o acompanhamento de operações de renda fixa e recebimento das informações de características de ativos, agenda de eventos e comitentes (LTR)



Entregas/Planejamento:

- ✓ Captação bancária e Debentures (CDB, CDBS, CDBV, LF, LFSC, LFSN, DPGE, NC, DEB) - 1T22
- ✓ IMOB (CRI, CCI, LCI) - 2T22
- ✓ AGRO (CRA, LCA) - 2T22

- ▶ Cotas de Fundos (CFA, CFF)
- ▶ Derivativos com/sem CCP
- ▶ CBIO
- ▶ LIG
- ▶ Demais tipos de instrumentos financeiros

05

Antecipação de Características de Ativos

Títulos e Valores Mobiliários > Instrumento Financeiro > Consulta Instrumento Financeiro

Consulta Instrumentos Financeiros

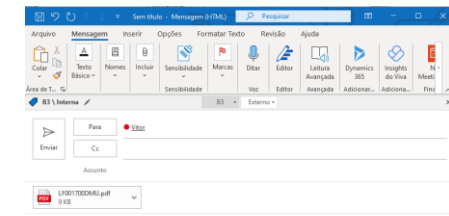
Registrador/Emissor (Nome Simplificado)
 Registrador/Emissor (Código)
 Tipo Instr.Financeiro **LF**
 Código de Instr. Financeiro **LF001700DMU**
 Código Interno
 Tipo de Regime
 Situação do Instr. Financeiro
 Situação de Inadimplência
 Situação p/ Negociação
 Data de Emissão -
 Data de Vencimento -
 Emissor - Mnemônico
 Agente de Pagamento (Razão Social)
 Agente de Pagamento (Nome Simplificado)
 Agente de Pagamento
 Escriturador/Emissor
 Agente Fiduciário (Razão Social)
 Conta do Agente Fiduciário

b.220808.1835

CPF	Nome	CPF	Nome	CPF	Nome	CPF	Nome	CPF	Nome
00000000000		00000000000		00000000000		00000000000		00000000000	

Dados de Emissão e Registro			
Quantidade Emitida: 10	Valor Unitário de Emissão: 50.000.000,00	Valor Total de Emissão: 500.000.000,00	
Quantidade Registrada: 0	Valor Registrado: 0,00	Valor de (Original): 50.000.000,00	
Distribuição Pública: 50%			
Forma de Pagamento: Pagamento de juros e principal no vencimento			

Instrumento Financeiro		Ficha 1	
Tipo: LF	Conta do Emissor: 6125444-0	Nome Simplificado do Emissor: ANS-086	
Código IF: LF001700DMU	Data de Emissão: 15/03/2017	Data de Vencimento: 15/03/2023	
Situação: CONFIRMADO	Plan de Emissão: 2.191		
Dados de Emissão e Registro			
Quantidade Emitida: 10	Valor Unitário de Emissão: 50.000.000,00	Valor Total de Emissão: 500.000.000,00	
Quantidade Registrada: 0	Valor Registrado: 0,00	Valor de (Original): 50.000.000,00	
Valores Atualizados			
Valor de (Base de Cálculo): 50.000.000,00	em: 15/03/2017		
Valor Unitário de Emissão Atualizado: 50.000.000,00	em: 07/06/2022		
Preço Unitário de Ajuste: 13.263,777909	em: 07/06/2022		
Preço Unitário Atualizado: 63.263,777909	em: 07/06/2022		
Valor Financeiro Atualizado: 632.637,27	em: 07/06/2022		
Forma de Pagamento			
Forma de Pagamento: Pagamento de juros e principal no vencimento			
Rembolsabilidade: Taxa Fixa: 0%			
Índice: Taxa Fixa: 0%			
Taxa de Ajuste: 1,0000			
Critério de cálculo de juros: 252 - número dias entre a data de início ou último pagamento e o próximo			



Antecipação de Características de Ativos

Home > Títulos e Valores Mobiliários > Instrumento Financeiro > Consulta Instrumento Financeiro HOMOLOGAÇÃO

Consulta Instrumentos Financeiros

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)
Data e Hora da Consulta: 07/06/2022 - 09:39:26

Critério de pesquisa

Ação	Tipo Instr. Financeiro	Código IF	Tipo de Regime	Eventos Cursados pela Cetip?	Emissão	Série	Sistema	Registrador/Emissor (Nome Simplificado)
CONSULTA	LF	LF001700DMU	DEPOSITADO				CETIP21	ANABM

« 1 Exibir página »

Obter no formato:

b.220606.1635

Thumbnail of the 'Consulta Instrumentos Financeiros' page showing the top navigation and search criteria.

Thumbnail of the 'Consulta Instrumentos Financeiros' page showing detailed instrument information and 'Dados da Emissão e Registro'.

Thumbnail of a Windows Mail client window showing an email with an attachment 'LF001700DMU.pdf'.

Thumbnail of the 'Consulta Instrumentos Financeiros' page showing a detailed search filter form.

Antecipação de Características de Ativos

> Títulos e Valores Mobiliários > Instrumento Financeiro > Consulta Instrumento Financeiro

Consulta Instrumentos Financeiros

Instrumento Financeiro

Tipo LF	Conta do Emissor 03250.40-0
Código IF LF001700DMU	Nome Simplificado do Emissor ANABM
Código ISIN	Data de Emissão 15/03/2017
Situação CONFIRMADO	Data de Vencimento 15/03/2023
IF Inadimplente NÃO	Prazo de Emissão 2.191
Data de Registro 15/03/2022	
Data de Alteração	

Dados da Emissão e Registro

Quantidade Emitida 10	Valor Unitário de Emissão 50.000,00000000
Quantidade Depositada 10	Valor Financeiro de Emissão 500.000,00
Quantidade Resgatada 0	
	Valor de (Original) 50.000,00000000 em 15/03/2017
Descrição Adicional	
Modelo da Distribuição Dispensa Especifica COE/LF/LIG	
Eventos Cursados pela Cetip?	
Possui Opções/Possui Opção de Recompra pelo Emissor SIM	
Distribuição Pública SIM	
Tipo de Regime DEPOSITADO	
Conta Escriturador/Emissor	

Valores Atualizados

Valor de (Base de Cálculo) 50.000,00000000	em 15/03/2017
Valor Unitário de Emissão Atualizado 50.000,00000000	em 07/06/2022
Preço Unitário de Juros 13.263,72770000	em 07/06/2022
Preço Unitário Atualizado 63.263,72770000	em 07/06/2022
Valor Financeiro Atualizado 632.637,27	em 07/06/2022

Forma de Pagamento

Formas de Pagamento Pagamento de juros e principal no vencimento

Rentabilidade/Indexador/Taxa Flutuante DI

% Índice/Taxa Flutuante 60,00

Taxa de Juros/Spread 1,0000

Critério de cálculo de juros 252 - número dias úteis entre a data de início ou último pagamento e o próximo

[Voltar](#) [Sair](#)

[Versão para Impressão](#)

Consulta Instrumentos Financeiros		Ficha 1
Instrumento Financeiro		
Tipo LF	Conta do Emissor 03250.40-0	
Código IF LF001700DMU	Nome Simplificado do Emissor ANABM	
Código ISIN	Data de Emissão 15/03/2017	
Situação CONFIRMADO	Data de Vencimento 15/03/2023	
IF Inadimplente NÃO	Prazo de Emissão 2.191	
Data de Registro 15/03/2022		
Data de Alteração		
Dados da Emissão e Registro		
Quantidade Emitida 10	Valor Unitário de Emissão 50.000,00000000	
Quantidade Depositada 10	Valor Financeiro de Emissão 500.000,00	
Quantidade Resgatada 0	Valor de (Original) 50.000,00000000 em 15/03/2017	
Descrição Adicional		
Modelo da Distribuição Dispensa Especifica COE/LF/LIG		
Eventos Cursados pela Cetip?		
Possui Opções/Possui Opção de Recompra pelo Emissor SIM		
Distribuição Pública SIM		
Tipo de Regime DEPOSITADO		
Conta Escriturador/Emissor		
Valores Atualizados		
Valor de (Base de Cálculo) 50.000,00000000	em 15/03/2017	
Valor Unitário de Emissão Atualizado 50.000,00000000	em 07/06/2022	
Preço Unitário de Juros 13.263,72770000	em 07/06/2022	
Preço Unitário Atualizado 63.263,72770000	em 07/06/2022	
Valor Financeiro Atualizado 632.637,27	em 07/06/2022	
Forma de Pagamento		
Formas de Pagamento Pagamento de juros e principal no vencimento		
Rentabilidade/Indexador/Taxa Flutuante DI		
% Índice/Taxa Flutuante 60,00		
Taxa de Juros/Spread 1,0000		
Critério de cálculo de juros 252 - número dias úteis entre a data de início ou último pagamento e o próximo		

Segue instrumento conforme solicitado.

Miotta

Consulta Instrumentos Financeiros

Registro Emissor (Nome Simplificado)

Registro Emissor (Código)

Tipo de Instrumento

Código de Inst. Financeiro (LF001700DMU)

Código ISIN

Tipo de Regime

Modelo de Distribuição

Evento Cursado pela Cetip?

Possui Opções/Possui Opção de Recompra pelo Emissor

Distribuição Pública

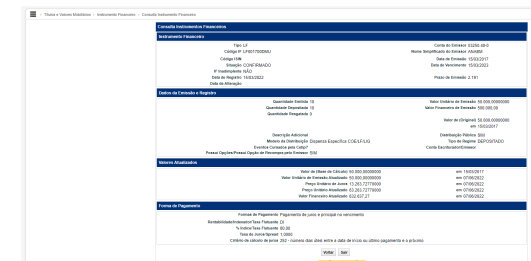
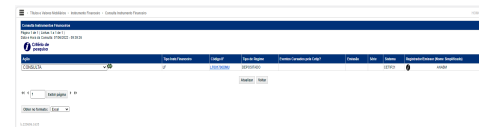
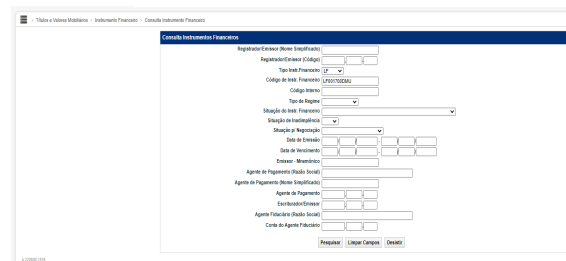
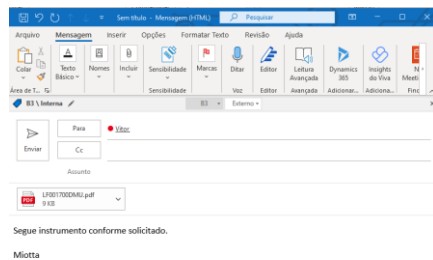
Tipo de Regime

Conta Escriturador/Emissor

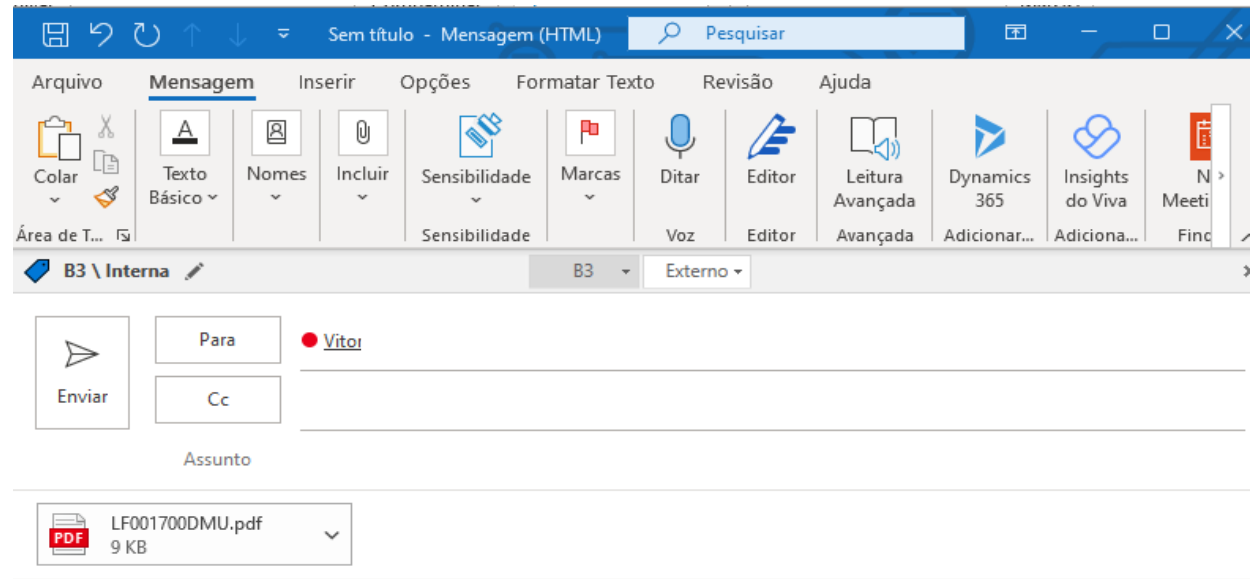
Preparar Limpar Campos Desistir

Antecipação de Características de Ativos

[B] ³ BRASIL BOLSA BALÇÃO		Consulta Instrumentos Financeiros	Ficha 1
Instrumento Financeiro			
Tipo: LF	Conta do Emissor: 03250.40-0		
Código IF: LF001700DMU	Nome Simplificado do Emissor: ANABM		
Código ISIN:	Data de Emissão: 15/03/2017		
Situação: CONFIRMADO	Data de Vencimento: 15/03/2023		
IF Inadimplente: NÃO			
Data de Registro: 15/03/2022	Prazo de Emissão: 2.191		
Data de Alteração:			
Dados da Emissão e Registro			
Quantidade Emitida: 10	Valor Unitário de Emissão: 50.000,00000000		
Quantidade Depositada: 10	Valor Financeiro de Emissão: 500.000,00		
Quantidade Resgatada: 0			
	Valor de (Original): 50.000,00000000		
	em: 15/03/2017		
Descrição Adicional:	Distribuição Pública: SIM		
Modelo da Distribuição: Dispensa Específica COE/LF/LIG	Tipo de Regime: DEPOSITADO		
Eventos Cursados pela Cetip?:	Conta Escriturador/Emissor:		
Possui Opções/Possui Opção de Recompra pelo Emissor: SIM			
Valores Atualizados			
Valor de (Base de Cálculo): 50.000,00000000	em: 15/03/2017		
Valor Unitário de Emissão Atualizado: 50.000,00000000	em: 07/06/2022		
Preço Unitário de Juros: 13.263,72770000	em: 07/06/2022		
Preço Unitário Atualizado: 63.263,72770000	em: 07/06/2022		
Valor Financeiro Atualizado: 632.637,27	em: 07/06/2022		
Forma de Pagamento			
Formas de Pagamento: Pagamento de juros e principal no vencimento			
Rentabilidade/Indexador/Taxa Flutuante: DI			
% Índice/Taxa Flutuante: 60,00			
Taxa de Juros/Spread: 1,0000			
Critério de cálculo de juros: 252 - número dias úteis entre a data de início ou último pagamento e o próximo			

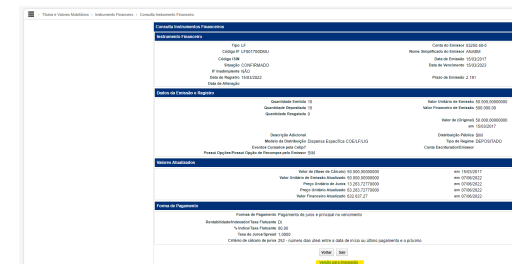
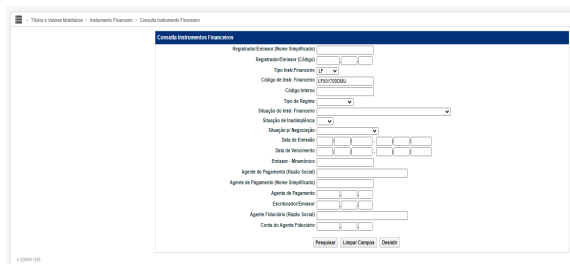


Antecipação de Características de Ativos



Segue instrumento conforme solicitado.

Miotta



Consulta Instrumentos Financeiros		Ficha 1
Instrumento Financeiro		
Tipo: LF	Conta de Emissão: 81226.40-0	
Código LF: LF001700DMU	Nome Simplificado do Emissor: ANANHA	
Código UNIS	Data de Emissão: 15/03/2017	
Situação: CONFIRMADO	Data de Vencimento: 15/03/2023	
Bancabilizado: NÃO		
Data de Registro: 15/03/2022		
Data de Ativação:		
Dados da Emissão e Registro		
Quantidade Emitida: 10	Valor Unitário de Emissão: 50.000,00000000	
Quantidade Depositada: 10	Valor Fornecedor de Emissão: 500.000,00	
Quantidade Resgatada: 0	Valor de Original: 50.000,0000000000	
Descrição Adicional: Modelo de Distribuição: Disposição Específica COELFLIG Descrição Adicional: Distribuição Pública: SIM Tipo de Registro: DEPOSITADO Forma de Pagamento: Conta Funcionária Emissor		
Valores Atualizados		
Valor de Base de Cálculo: 50.000,0000000000	em: 15/03/2017	
Valor Unitário de Emissão Atualizado: 50.000,0000000000	em: 07/06/2022	
Preço Unitário de Juros: 15.263,7277000000	em: 07/06/2022	
Preço Unitário Atualizado: 65.263,7277000000	em: 07/06/2022	
Valor Financeiro Atualizado: 652.437,27	em: 07/06/2022	
Formas de Pagamento		
Formas de Pagamento: Pagamento de juros e principal no vencimento		
Rentabilidade Indicador Taxa Financeira: 0%		
Taxa Indexada Financeira: 0,0000		
Taxa de Juros/Spernal: 1,0000		
Critério de cálculo de juros: 212 - interesse duas vezes sobre a data de início ou último pagamento e a posteriori		

Antecipação de Características de Ativos

Requisição



Tela

Tela de Solicitação

Arquivo Upload em Lote

API Solicitação - Bloco de Notas

Arquivo Editar Formatar Exibir Ajuda
 IMERCADO0CONSHOGWARTSBM 20
 IMERCADO1CONS01002028690050286910
 DEB HARRY09
 CDB 22488999
 CDB 22488999
 CDB 22488999
 CDB 22488999
 9



API

Exemplo API

```
operationId: CaptacaoPost
consumes:
  - application/json
parameters:
  - in: body
    name: Captacao
    description: ''
    schema:
      $ref: '#/definitions/InstrumentPostReq'
responses:
  '201':
    description: Created
    headers:
      x-v:
        type: string
        description: 'Versão da api. Ex 1.0.0'
  '400':
    description: Bad Request.
  '404':
    description: Not Found.
```



Versão Atual: Tela

TBD: Upload (Lote) + API

Antecipação de Características de Ativos

Recebimento



Malote

Arquivos de Característica e eventos - Malote

DCARACTPART

DEVENTOSPART

```
05000_210910_DCARACTPART-LF-LF00200926 - Bloco de Notas
Arquivo Editar Formatar Exibir Ajuda
Data do arquivo;Codigo do instrumento financeiro;Codigo do tipo do instrumento financeiro;Codigo ISIN;Data de emissao;Data de vencimento;Data de registro;Valor unitario de emissao;Valor nominal atu
icacao da origem de credito;Percentual de coobrigacao;Garantidor;CPF/CNPJ Garantidor;Natureza Garantidor;Tipo de Garantia 1;Proprietario Garantia 1;Descricao Garantia 1;Tipo de Garantia 2;Proprietari
ncao;Limite Maximo de Conversibilidade;Critérios para Conversao;Forma de Integralizacao;Recomprou pelo Emissor(Limite de ate 3% - Resolucao 4.123 Art. 7o Inciso II);Obteve Autorizacao do Banco Centr
20210910;LF00200926;LF;;20201117;20211117;20211117;0000070000,0000000000;0000070000,0000000000;20211117;0000070000,0000000000;20210910;0000053022,2177800000;20210910;0000123022,2177800000;CONFIRMA
```



Mensagem iMercado

Mensagem iMERCADO – Captação Bancária

```

"BusMsg": {
  "data": {
    "messageIdentification": {
      "channelCode": "APIRIO",
      "systemMessageCode": "DADOSCAPT",
      "messageCode": 25899842,
      "participantAccountCode": "05000005",
      "messageReasonText": "OPERACAO",
      "eventDatetime": "2022-06-06T07:35:09Z",
      "trackingAccountCode": "05000005",
      "monitoredAccountCode": "05000108"
    },
    "instrument": {
      "tickerSymbolTypeCode": "DEB",
      "tickerSymbol": "EBEN19",
      "otcIssuerAccountCode": "05000407",
      "otcRegisterShortName": "RIOBM",
      "issuerCorporationName": "TESTE - BCO RIO S/A",
      "otcAccountBookkeeperShortName": "RIOBM",
      "otcAccountBookkeeperCode": "05000005",
      "issueDate": "2018-08-15",
      "maturityDate": "2025-08-15",
      "registrationDate": "2019-04-24",
      "profitabilityStartDate": "2018-08-31",
      "issueDeadlineQuantity": 2541,
      "issueQuantity": 260000,
      "depositQuantity": 260000
    }
  }
}

```



Portal iMercado

Portal iMERCADO – Consulta web de mensagens

The screenshot shows the iMERCADO web interface. At the top, there's a navigation bar with the logo and menu items like 'Captura, Ativação e Registro', 'Perfil Mensagem', etc. Below that is a 'Status de Operações' section with a search form containing fields for 'Codigo Centro de Participante', 'Data de Evento', 'Codigo Montadora', 'Codigo Montadora', 'Codigo Operacao', 'Instrumento Financeiro', 'Codigo Rate', and 'Codigo Contraparte'. There are 'Procurar' and 'Nova Pesquisa' buttons. Below the search form is a table titled 'Captura Bancária' with columns for 'Id Mensagem', 'Id Cód. Participante', 'Id. Motivo Serv. Msg.', 'Id. Data/Hora Evento', 'Id. Cód. Montadora', 'Id. Cód. Operação', 'Id. Cód. Parte', 'Id. Cód. Centro Parte', 'Id. Cód. Tipo Operação', and 'Id. Cód. T'. The table contains several rows of data representing different operations.

! Versão Atual: Malote

TBD: Mensagem (API iMERCADO + Portal iMercado)

[B]³

BRASIL
BOLSA
BALCÃO