



MANUAL OPERACIONAL MARGIN SIMULATOR

Sumário

1	INTRODUÇÃO	4
2	INCLUSÃO E EXCLUSÃO DE ATIVOS VIA PLANILHA EXCEL	4
2.1	INCLUSÃO POR TIPO DE POSIÇÃO	4
2.2	INCLUSÃO DIRETO NA CARTEIRA A SER SIMULADA	7
2.3	INCLUSÃO ATRAVÉS DO UPLOAD DO ARQUIVO IMBARQ001	7
2.3.1	AJUSTES NECESSÁRIOS AO FAZER O UPLOAD DO IMBARQ001	10
2.4	EXCLUIR ATIVOS	11
3	ENVIO DE PORTFÓLIO PARA SIMULAÇÃO DE CÁLCULO DE MARGEM	13
3.1	SIMULAÇÃO COM ERRO	17
4	RECURSO DE LIQUIDEZ	18
5	INSTALAÇÃO DO CERTIFICADO DIGITAL	18
6	CONFIGURAÇÃO DO EXCEL E INSTALAÇÃO DO SUPLEMENTO	21
6.1	CONFIGURAÇÃO DO EXCEL	22
6.2	INSTALAÇÃO DO SUPLEMENTO DO EXCEL (EXCEL <i>ADD-IN</i>)	24
7	TIPOS DE INSTRUMENTO	29
7.1	DERIVATIVOS	29
7.2	OPÇÃO SOBRE AÇÃO	30
7.3	LEILÃO DE SWAP CAMBIAL (PRÉ BOLETA)	31
7.4	POSIÇÃO À VISTA	32
7.5	TERMO DE AÇÃO	33
7.6	TERMO NDF	34
7.7	OPÇÃO FLEXÍVEL	35
7.8	POSIÇÃO DE SWAP	37
7.9	BTB (EMPRÉSTIMO DE TÍTULOS)	38
7.10	GARANTIAS	39
7.11	EVENTO CORPORATIVO DE BTB	40
7.12	RECOMPRA DE AÇÃO	41
7.13	TERMO DE OURO	42
7.14	OUTROS	43
8	RESULTADO DA SIMULAÇÃO	44
9	SOLICITAÇÕES DE AJUSTE E MELHORIAS NA FERRAMENTA	47
10	SUORTE NO USO DA FERRAMENTA	48

IMPORTANTE!

- O módulo CORE 0, sistema ao qual o *Margin Simulator* está ligado através de uma API, não traz informações sobre chamada de margem adicional;
- Carteiras simuladas podem apresentar diferentes chamadas de margem ao decorrer do dia, pois levam em consideração as janelas de liquidação descritas no link: http://www.b3.com.br/pt_br/produtos-e-servicos/compensacao-e-liquidacao/clearing/grades-e-janelas/;
- Para obter o valor correto da simulação do cálculo de risco, o usuário deve preencher os campos com todas as características e valores correspondentes à posição registrada na B3;
- Posições de empréstimo de ativos vencidos e com pendência de liquidação financeira devido a evento corporativo não são consideradas pelo simulador;
- A margem requerida que é cobrada na abertura do dia seguinte à simulação pode ter variações relevantes devido ao processo de final de dia (EoD), no qual são atualizados preços e podem ser atualizados cenários de estresse dos fatores de risco;
- A liberação de garantias pode estar sujeita a outras obrigações do comitente com a Câmara (ex.: valor devedor de liquidação na janela financeira) que não são consideradas no cálculo de margem;
- O PNP/PL responsável pelo comitente pode adotar uma política que resulte na exigência de garantias adicionais ao requerimento da Câmara.

1 INTRODUÇÃO

Este documento apresenta os procedimentos operacionais para uso da ferramenta *Margin Simulator*. Descrições de como instalar o certificado digital, instalação do *add-in* e modo de uso da ferramenta são apresentadas nos itens abaixo.

2 INCLUSÃO E EXCLUSÃO DE ATIVOS VIA PLANILHA EXCEL

A planilha do Margin Simulator permite ao usuário, através da inclusão de ativos financeiros e valores mobiliários transacionados nos mercados administrados pela B3, criar um portfólio hipotético e enviar os dados para cálculo de risco.

Existem três formas de inclusão de ativos na carteira via planilha Excel que serão descritas abaixo.

2.1 INCLUSÃO POR TIPO DE POSIÇÃO

Para adicionar ativos na carteira, o usuário deve selecionar o tipo de posição desejada:

- Derivativo;
- Ação;
- Opção sobre Ação;
- Termo de Ação;
- Garantia;
- BTB (empréstimo de títulos);
- Evento Corporativo BTB;
- Leilão de Swap Cambial (pré boleto);
- Swap;
- Opção Flexível;
- Termo;
- Recompra de Ação;
- Termo de Ouro.

As características desses tipos de ativos, serão descritos no item 7 desse documento.

Haverá um campo “Filtrar” onde será possível inserir parte do código de negociação e a planilha buscará um valor aproximado alfabeticamente para que o usuário esteja mais próximo do código de negociação escolhido.

Importante: para usuários que utilizam o Excel em português, deve ser utilizado vírgula “,” como separador de decimais (Ex: 15,10). Para usuários que utilizam o Excel em inglês, deve ser utilizado ponto “.” como separador de decimais (Ex: 15.10). Para usuários que utilizarem a API deve ser utilizado ponto “.” como separador de decimais.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Derivativo	Filtrar
Código de Ne	<ul style="list-style-type: none">DerivativoAçãoOpção sobre AçãoTermo de AçãoGarantiaBTBLeilão de Swap CambialSwap	enda
Adicionar		

Para cada tipo de ativo inserido, são apresentados os campos para que o usuário informe seu respectivo valor. Em caso de não preenchimento de um determinado campo obrigatório, a planilha exibe uma mensagem informando que faltam campos a serem preenchidos.

Caso o campo seja preenchido indevidamente, o sistema apresenta mensagem de erro de campo inválido. Exemplo: caso um campo seja preenchido com letra.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Derivativo	Filtrar	
Código de Negociação	Quantidade		
AFSM19	Compra	Venda	
Adicionar			
<div style="border: 1px solid gray; padding: 5px;"> Microsoft Excel Quantidade compra ou venda deve ser preenchida OK </div>			
CARTEIRA			
Recurso de Liquidez (R\$)	3.430.000.000,00	Calcular	Limpar
		Importar	

Caso o usuário não preencha o campo de um campo mandatório, o sistema apresenta a seguinte mensagem de erro:



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Termo de Ação	Filtrar	ABEV3T
Código de Negociação	Quantidade		Preço Negociado
ABEV3T	Compra	Venda	Compra
	0	100	5
Adicionar			
<div style="border: 1px solid gray; padding: 5px;"> Microsoft Excel Data de vencimento inválida OK </div>			
CARTEIRA			
	Calcular	Limpar	Importar

Ao inserir um ativo que tem posição de compra ou venda, o usuário deve inserir o valor no campo específico e o outro campo deve ser preenchido com zero "0" ou ficar em branco. Não é mandatório informar o valor "0" (zero) na ponta que não há posição do ativo, ao deixar o campo em branco, o sistema irá considerar o campo como valor "zero" Ex: ao inserir uma posição vendida de ABEV3T, basta inserir a quantidade de ações no campo "venda", o campo compra pode ser preenchido com zero ou ficar sem preenchimento.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Termo de Ação	Filtrar	ABEV3T	
Código de Negociação	Quantidade		Vencimento	Preço Negociado
ABEV3T	Compra	Venda	Compra	Venda
	0	100	5	5
Adicionar	Coberto			

Microsoft Excel
Data de vencimento inválida
OK

CARTEIRA Calcular Limpar Importar

2.2 INCLUSÃO DIRETO NA CARTEIRA A SER SIMULADA

Ao realizar a inclusão por tipo de posição, o ativo informado vai direto para a carteira uma vez apertado o botão “adicionar”.

Outro meio de inclusão seria a inclusão manual de ativos diretamente na carteira. É importante ressaltar que neste caso não há validação dos campos mandatórios pelo sistema como acontece no modelo de inclusão descrito no item acima, portanto, é importante verificar se todos os dados necessários para o cálculo estão corretos – as características desses tipos de ativos, serão descritos no item 7 desse documento.

2.3 INCLUSÃO ATRAVÉS DO UPLOAD DO ARQUIVO IMBARQ001

Através da integração com o arquivo IMBARQ001, é possível fazer a importação de suas posições de final de dia (EoD) e manipular esses dados de acordo com as simulações que se deseja fazer. As informações para contratação do IMBARQ001 estão disponíveis em: http://www.b3.com.br/pt_br/solucoes/plataformas/middle-e-backoffice/mercado/como-contratar/.

Para fazer o upload do arquivo, deve-se seguir os passos abaixo:

Clique no item “Importar.”

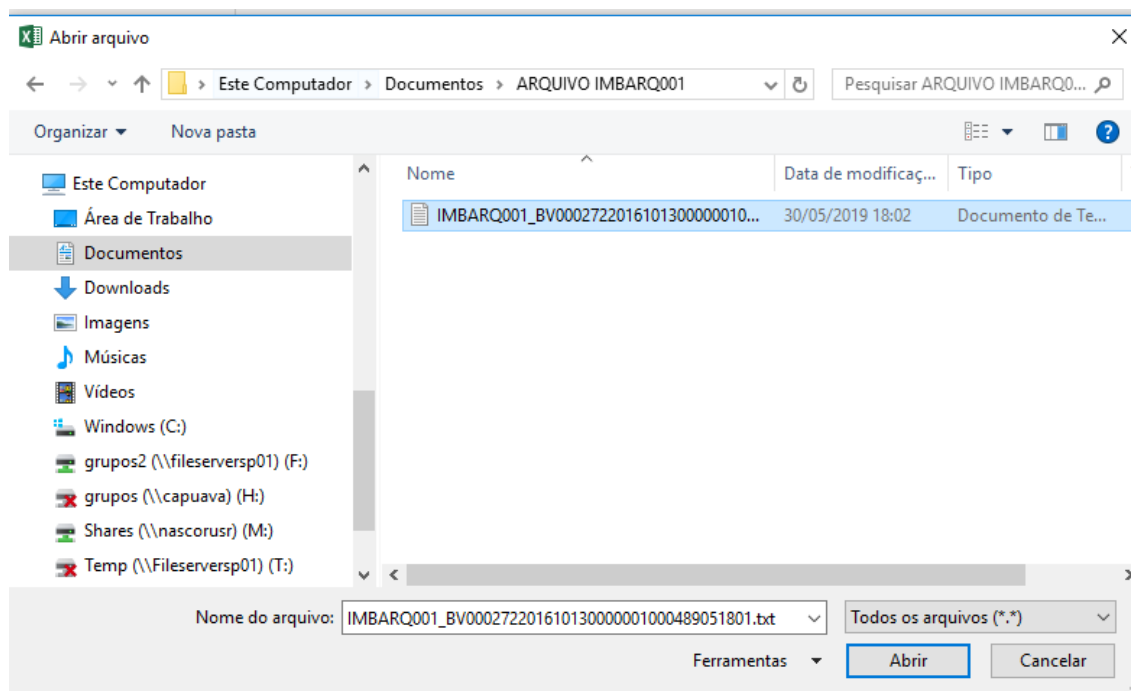


MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Derivativo	Filtrar	
Código de Negociação	Quantidade	Compra	Venda
Adicionar			
CARTEIRA	Calcular	Limpar	Importar
Recurso de Liquidez (R\$)	3.430.000.000,00		

Em seguida, o Excel abrirá uma tela para que você procure e selecione o arquivo desejado. Após selecionado, clique em abrir.



Após clicar em “abrir”, as posições das contas serão importadas para a memória do Excel e uma lista de contas e o botão “Carregar” serão exibidos, conforme abaixo:



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição **Derivativo** Filtrar

Código de Negociação	Quantidade	
	Compra	Venda

Adicionar

CARTEIRA

Recurso de Liquidez (R\$) 3.430.000.000,00

POSIÇÕES

Código de Negociação / Contrato	Tipo Posição	Quantidade	Preço	Valor	Aberto
---------------------------------	--------------	------------	-------	-------	--------

Contas Importadas

Todas

- Todas
- 1
- 2
- 4
- 5
- 7
- 10
- 66

O usuário deverá selecionar a conta desejada e clicar em “Carregar.”



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Derivativo	Filtrar	
Código de Negociação	Quantidade		
	Compra	Venda	
Adicionar			

CARTEIRA	Calcular	Limpar	Importar	Contas Importadas	Carregar
Recurso de Liquidez (R\$)	3.430.000.000,00			66	

POSIÇÕES

Código de Negociação / Contrato	Tipo Posição	Quantidade		
		Compra	Venda	Coberto
DI1F17	0 - POSITION		44700	
DOLF17	0 - POSITION	1700		
DOLX16	0 - POSITION	500		
DOLJ18P002350	0 - POSITION	90		

É possível também importar todas as posições de todas as contas contidas no arquivo. Para isso, deve-se selecionar a opção “Todas” e, em seguida, clicar no botão “Carregar.”

2.3.1 AJUSTES NECESSÁRIOS AO FAZER O UPLOAD DO IMBARQ001

- i. **Opção Flexível OTC**
 - a. Não há valor de rebate, inserir manualmente se houver;
- ii. **Swap OTC**
 - a. Não há o campo “preço de start,” inserir manualmente;
 - b. Há somente um campo de taxa de juros, sendo necessário a informação das taxas das duas pontas. Na atual versão, estamos utilizando esse valor de taxa de juros.
- iii. **Recuperação de ações**

a. Não há o campo de código de negociação da ação, inserir manualmente.

iv. Pré-boleta de SCC/SCS

a. Não há o campo de código de negociação, inserir manualmente.

2.4 EXCLUIR ATIVOS

A exclusão pode ser realizada de 2 maneiras:

i. Excluir todo o portfólio

Através do botão “Limpar”, o sistema exclui todos os ativos previamente inseridos. O usuário deve confirmar a ação requerida conforme descrito abaixo:



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Derivativo	Filtrar	
Código de Negociação	Quantidade		
D15M19P000725	Compra	Venda	30
Adicionar			

Limpar carteira

Tem certeza que deseja limpar a carteira?

Sim Não

CARTEIRA Calcular Limpar Importar

Recurso de Liquidez (R\$) 3.430.000.000,00

POSIÇÕES

Código de Negociação / Contrato	Tipo Posição	Quantidade				Lado	Data de Negociação	Preço Negociado	
		Compra	Venda	Coberto	Garantia			Compra	Venda
DOLX19P005000	0 - POSITION	20	0						
AFSM19	0 - POSITION	30	0						
D15M19P000725	0 - POSITION	30	0						

Desta maneira, a carteira fica zerada e disponível para o usuário inserir uma nova posição.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Derivativo	Filtrar	<input type="text"/>
Código de Negociação	Quantidade		
D15M19P000725	Compra	Venda	30
<input type="button" value="Adicionar"/>			

CARTEIRA

Recurso de Liquidez (R\$) | 3.430.000.000,00

POSIÇÕES

Código de Negociação / Contrato	Tipo Posição	Quantidade				Lado	Data de Negociação
		Compra	Venda	Coberto	Garantia		

ii. Excluir ativos específicos

Através da ação padrão do *MS Excel*, é possível excluir pontualmente um determinado ativo da carteira. Para tanto, basta clicar com o botão direito na linha do ativo que o usuário deseja excluir e clicar na opção “Excluir”. Os demais ativos permanecerão na carteira, que pode receber novos ativos para que o usuário execute a simulação desejada.

Ex. Exclusão da posição de 30 unidades na ponta de venda do ativo ARBQ19.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Derivativo	Filtrar	
Código de Negociação		Venda	
ARBQ19			
Adicionar			
CARTEIRA	Calcula	Importar	
Recurso de Liquidez (R\$)			
POSIÇÕES			
Código de Negociação / C	Quantidade		Lado
	Compra	Venda	Coberto
D15M19P000725	30	0	Garantia
ARBQ19	30	0	Data de Negociação

3 ENVIO DE PORTFÓLIO PARA SIMULAÇÃO DE CÁLCULO DE MARGEM

Após incluir os ativos que deseja enviar para cálculo de margem, clique em “calcular”.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Derivativo	Filtrar	
Código de Negociação	Quantidade		
B3SAOM19	Compra	Venda	15
Adicionar			

CARTEIRA

Calcular

Limpar

Importar

Recurso de Liquidez (R\$) | 3.430.000.000,00

POSIÇÕES

Código de Negociação / Contrato	Tipo Posição	Quantidade				Lado	Data de Negociação
		Compra	Venda	Coberto	Garantia		
D15M19P000725	0 - POSITION	30	0				
ARBQ19	0 - POSITION	30	0				
AUDN19	0 - POSITION	20	0				
B3SAOM19	0 - POSITION	15	0				

Em seguida, o Excel abrirá uma nova aba chamada "marginSimulatorStatus"

The screenshot displays the 'MARGIN SIMULATOR' interface. At the top left is the logo **[B]**³. Below it, the title 'MARGIN SIMULATOR' is centered. A table titled 'SIMULAÇÕES REALIZADAS' is shown, with a 'Verificar Status' button above it. The table has three columns: 'Simulações', 'Status', and 'Link'. One row is visible with the simulation ID '07_06_2019 15h39m26s,507ms', a status of 'Em Processamento...', and a link icon. At the bottom, a browser tab is visible with the title 'marginSimulatorStatus' highlighted in a red box.

Simulações	Status	Link
07_06_2019 15h39m26s,507ms	Em Processamento...	

O usuário deve clicar em “Verificar Status” para que o resultado da simulação fique disponível, conforme abaixo.



MARGIN SIMULATOR

SIMULAÇÕES REALIZADAS		Verificar Status
Simulações	Status	Link
31_05_2019 12h06m41s,643ms	OK	Abrir resultado

Ao clicar em “abrir resultado,” outra aba será criada com o resultado da simulação.

Essa função permite que após o envio de uma simulação para cálculo, mesmo que o sistema ainda esteja processando o portfólio anterior, o usuário consiga solicitar novas simulações e obter o resultado sem a necessidade de aguardar o término da primeira requisição.

Cálculos Iniciais		R\$
Risco das Posições (A)		467.734,18
Valor das Garantias Depositadas (B)		0,00
Recurso de Liquidez Utilizado (C)		0,00
Saldo de Garantias Após Procedimentos Adicionais		R\$
Todas as Posições da Carteira (D)		-461.217,72
Exclusão de Posições de Entrega de Ativos no Dia (E) **		0,00
Exclusão de Posições de Derivativos Vincendos (F) **		-467.734,18
Exclusão de Ambos os Tipos de Posições Acima (G) **		0,00
Saldo de Garantias (F) *		R\$
Recurso de Liquidez Potencial		467.734,18
		0,00

* $\min(B + (C) - (A); (B))$
 ** Simulações com resultado 0,00 significam que não há tais tipos de posições ou seu cálculo resultou em 0,00.

31_05_2019 12h06m41s,643ms | riskSimulatorStatus | riskSimulator | Planilha1 | +

3.1 SIMULAÇÃO COM ERRO

Ao solicitar uma simulação, o *MS Excel* abrirá uma nova aba chamada “marginSimulatorStatus”, o sistema irá disponibilizar o link para abrir o resultado conforme descrito no item anterior, mas também pode apresentar o status “erro” caso houver algum tipo de inconsistência com as informações inseridas na carteira.

[B] ³ MARGIN SIMULATOR			
1			
2	SIMULAÇÕES REALIZADAS	Verificar Status	
3	Simulações	Status	Link
4	11_06_2019 11h16m33s,174ms	Erro na simulação.	Ver Erro
5			
6			
7			
8			
9			
10			

Ao clicar no link “Ver Erro” o sistema irá mostrar a descrição dos ativos que apresentaram algum tipo de erro na simulação proposta, conforme imagem abaixo:

A		B
1		
2		
3	Erro	
4	ABEVL92[1] is not ok: symbol invalid	
5	DOLJ18P002350[14] is not ok: symbol invalid	
6	BOVA11[15] is not ok: tradeDate invalid	
7	OIBR3T[22] is not ok: maturityDate expired	
8	OIBR3T[23] is not ok: maturityDate expired	
9	ALTS3T[53] is not ok: symbol invalid	
10	BAUH4T[64] is not ok: maturityDate expired	
11	OTCSECLEND[73] is not ok: maturityDate expired	
12	OTCSECLEND[80] is not ok: maturityDate expired,underlyingSymbol invalid	
13	OTC-SNP[114] is not ok: maturityDate expired,SwapLegList must have 1 IND otclndicatorCode and 1 PRE otclndicatorCode	
14	CCXC3[118] is not ok: Collateral is required	
15		
16		
17		

Importante: Simulações com erro não serão contabilizadas para tarifaç o. Ao clicar no link o sistema informará qual (ou quais) ativos apresentaram erro para que o usu rio ajuste a carteira e fa a a simula o novamente.

4 RECURSO DE LIQUIDEZ

Valor utilizado baseado nas linhas de liquidez das posi es da carteira para cobrir perdas transit rias no processo de encerramento de carteira originadas pelo risco de

principal. Para esse campo, o valor m ximo a ser utilizado   de R\$ 3.430.000.000,00 (tr s bilh es e cem milh es de reais). O usu rio pode alterar esse valor, desde que seja menor que o valor m ximo pr -determinado.

[B]³
MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSI O

Tipo Posi�o	Derivativo	Filtrar
C�digo de Negocia�o	Quantidade	
ETHF20	Compra	Venda
		100

Adicionar

Microsoft Excel

Recurso de Liquidez n o pode ser maior que 3.430.000.000,00

OK

CARTEIRA

Calcular Limpar Importar

Recurso de Liquidez (R\$) | 7.000.000.000,00

5 INSTALA O DO CERTIFICADO DIGITAL

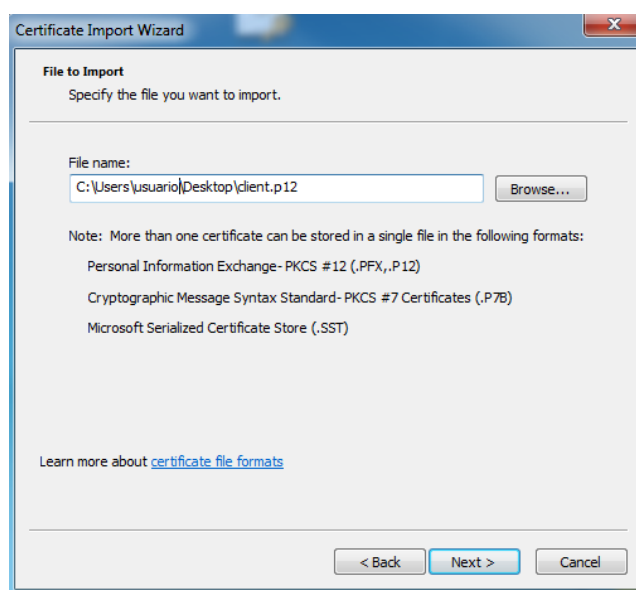
Ser  disponibilizado pela B3 um certificado digital para acesso  s APIs (do Ingl s “*Application Programming Interface*”) do Simulador de Risco.

Para realizar a instala o do certificado digital, seguir com os passos abaixo:

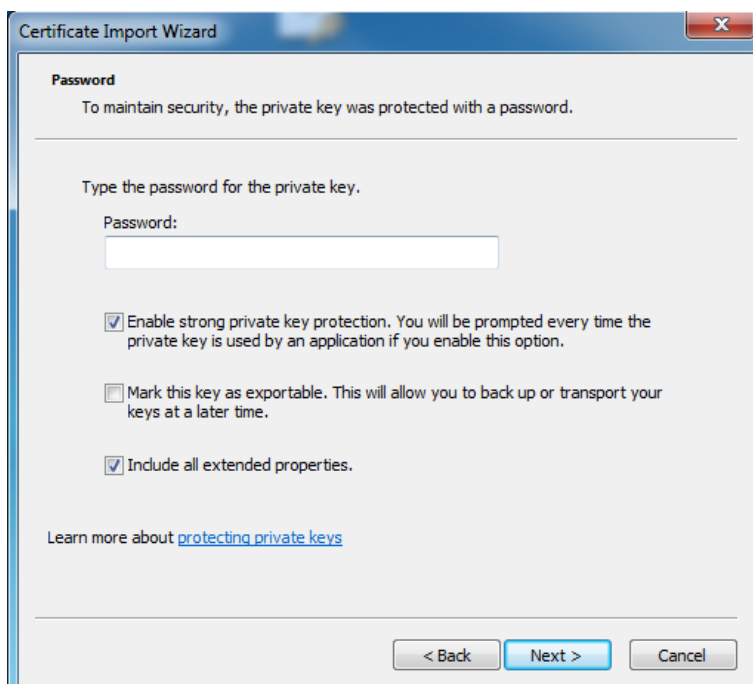
- 1) Executar, com perfil de administrador da m quina, o certificado digital fornecido pela B3.
- 2) Na tela que ser  exibida, clicar no bot o “Next”:



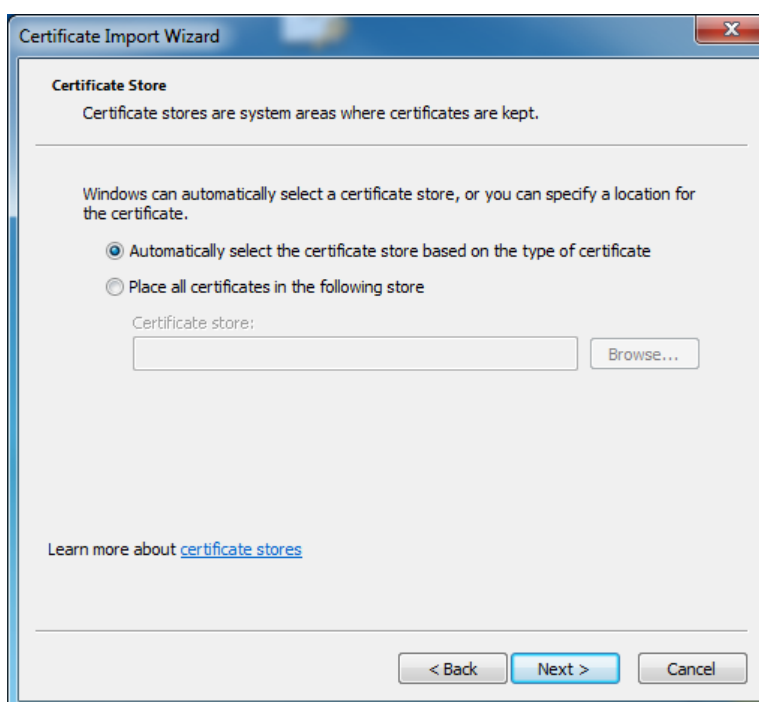
3) Clicar no botão "Next" novamente:



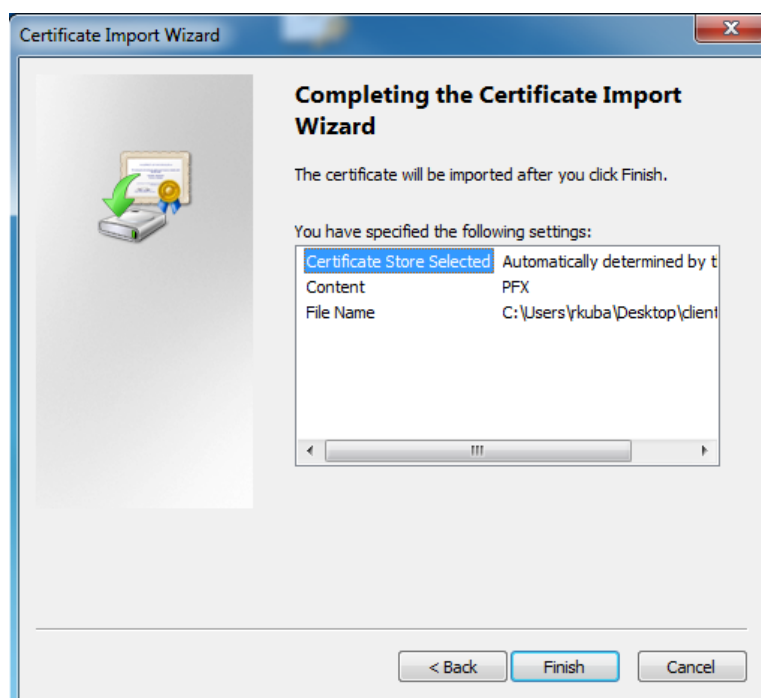
4) Digitar a senha fornecida pela B3, deixando marcadas as opções padrões, e clicar no botão "Next":



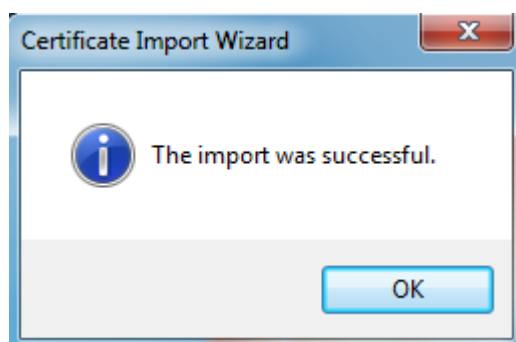
5) Deixar marcada a opção padrão e clicar em “Next”:



6) Finalizar a instalação, clicando em “Finish”:



7) A seguinte tela de confirmação da instalação será exibida:



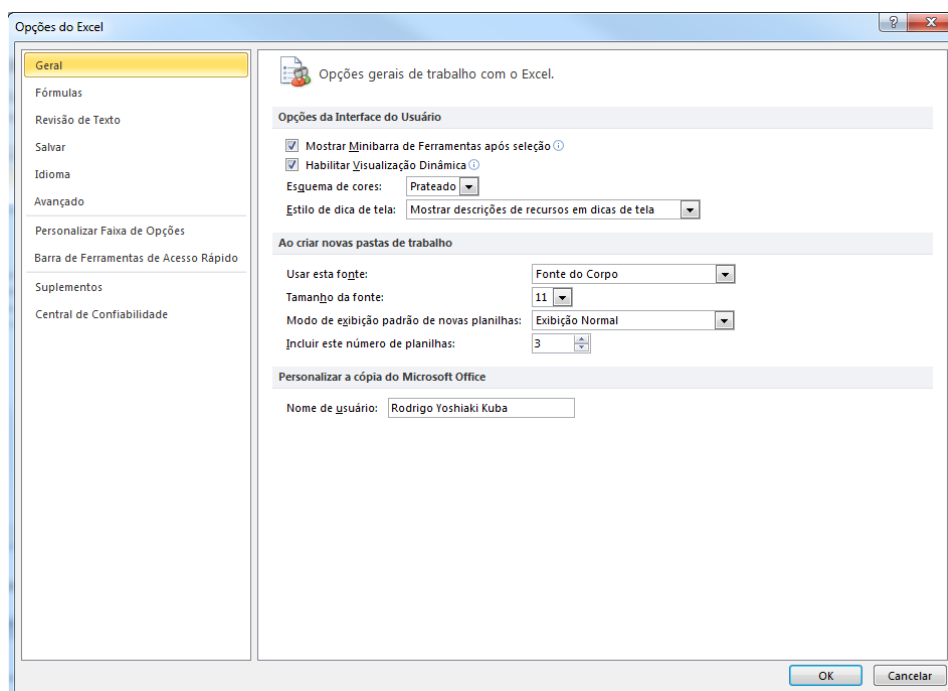
6 CONFIGURAÇÃO DO EXCEL E INSTALAÇÃO DO SUPLEMENTO

Para o correto funcionamento do *Margin Simulator* da B3, é necessário realizar algumas configurações no Excel e também realizar a instalação do suplemento do Excel (*add-in*), que será fornecido pela B3.

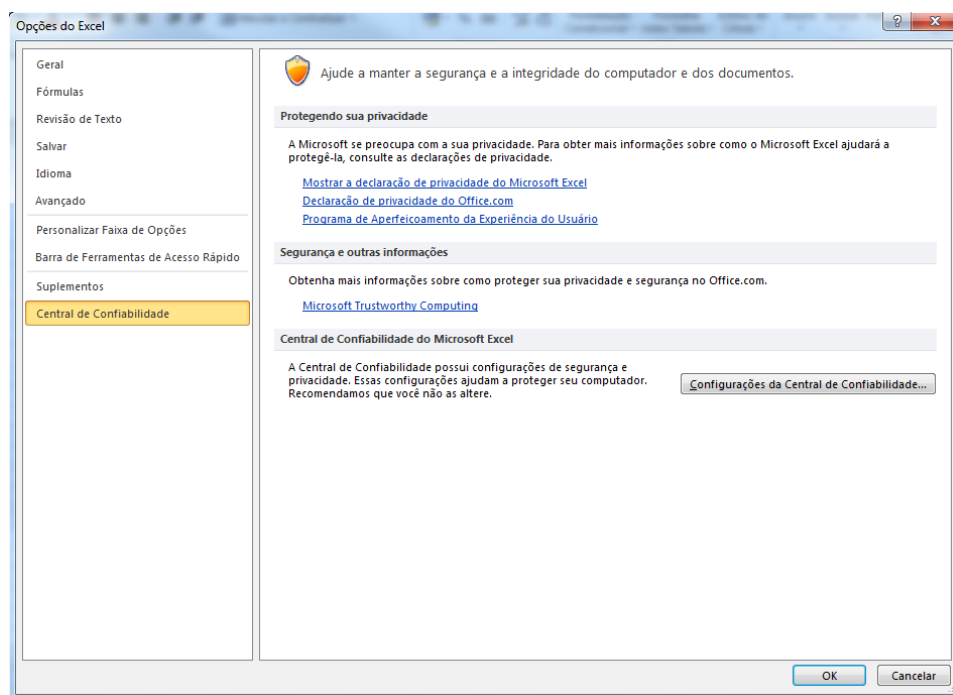
6.1 CONFIGURAÇÃO DO EXCEL

Para a configuração do Excel, seguir com os passos abaixo:

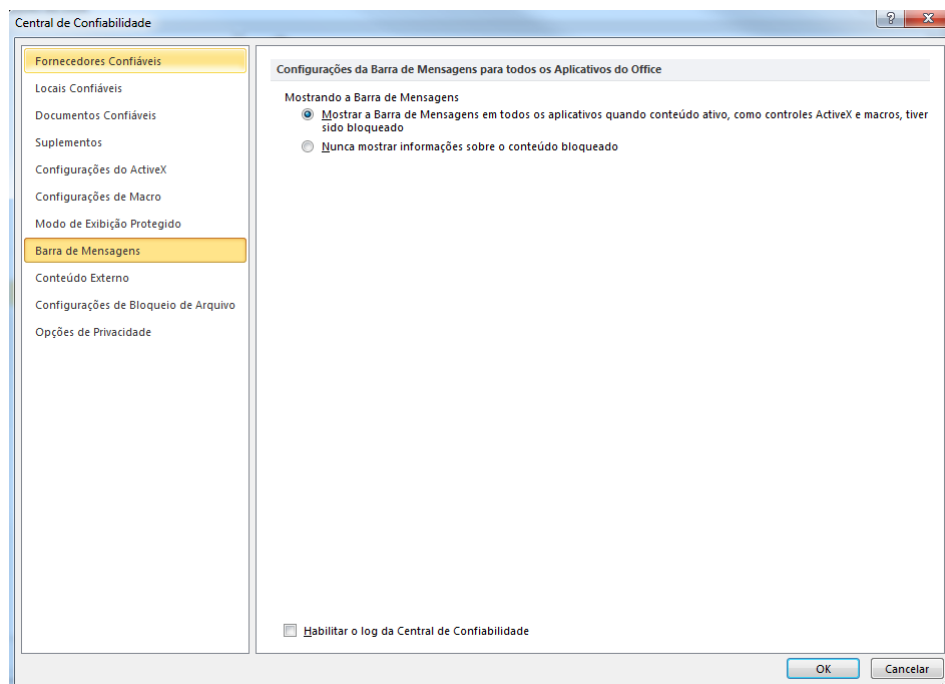
- 1) No Excel, ir em "Arquivos" → "Opções". A seguinte tela será exibida:



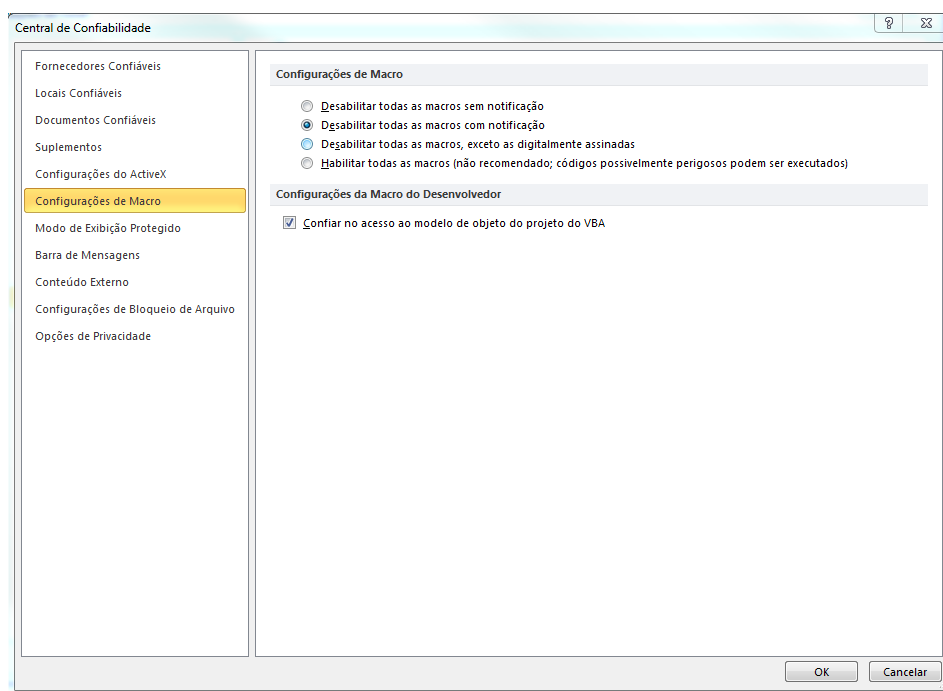
- 2) Ir em "Central de Confiabilidade", conforme abaixo:



3) Clicar em "Configurações da Central de Confiabilidade", a seguinte tela será exibida:



- 4) Ir para a opção "Configurações de Macro", habilitar a opção "Confiar no acesso ao modelo de objeto do projeto do VBA" e clicar em "OK".

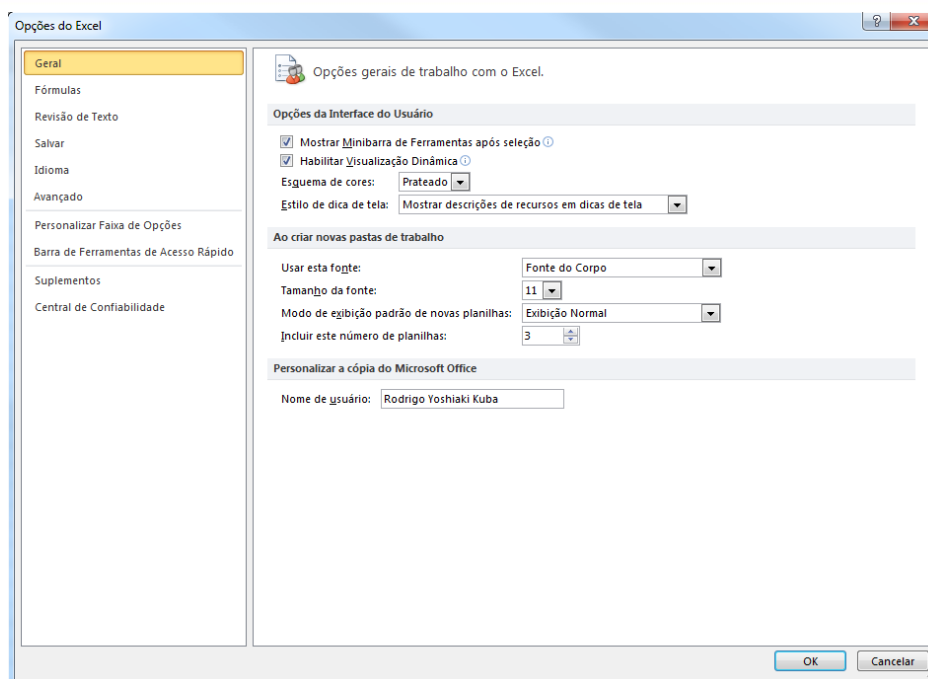


6.2 INSTALAÇÃO DO SUPLEMENTO DO EXCEL (EXCEL ADD-IN)

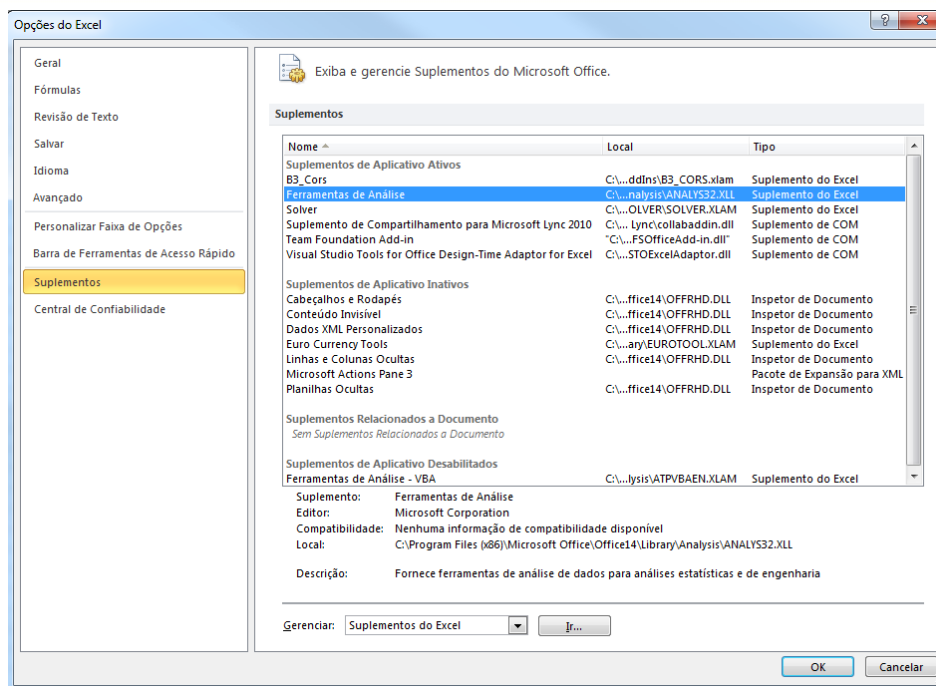
A B3 disponibilizará um suplemento (*add-in*) a ser instalado no Excel e um arquivo config. É importante ressaltar que a instalação do *add-in* é suportada apenas para Windows nas versões Microsoft Office 10 ou superior e o nome do arquivo não pode ser alterado sob hipótese alguma.

Para a instalação do suplemento e do config, seguir com os passos abaixo:

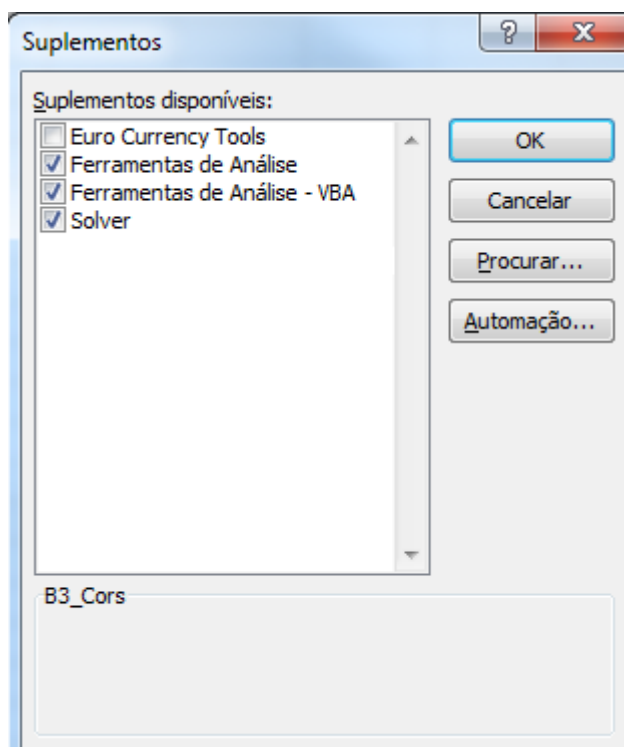
- 1) Copiar o suplemento B3_CORS.xlam para o seguinte diretório:
Diretório: C:\Users\{usuário}\AppData\Roaming\Microsoft\Excel\XLSTART, onde {usuário} é o seu usuário de rede. A pasta AppData é uma pasta oculta no Windows.
- 2) Abrir o Excel.
- 3) Ir em "Arquivos" → "Opções". A seguinte tela será exibida:



4) Ir a Suplementos. A seguinte tela será exibida:

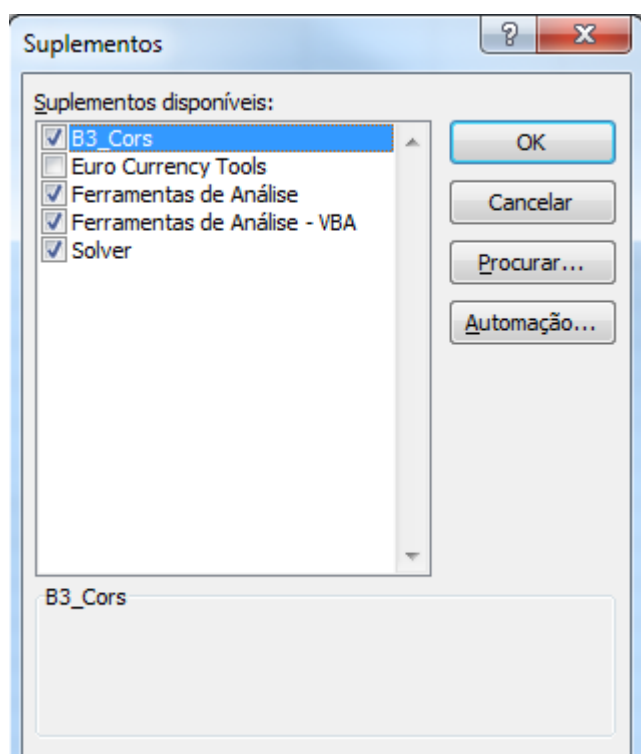


5) Em "Gerenciar", selecionar a opção "Suplementos do Excel" e clicar no botão "Ir...". A seguinte tela será exibida:

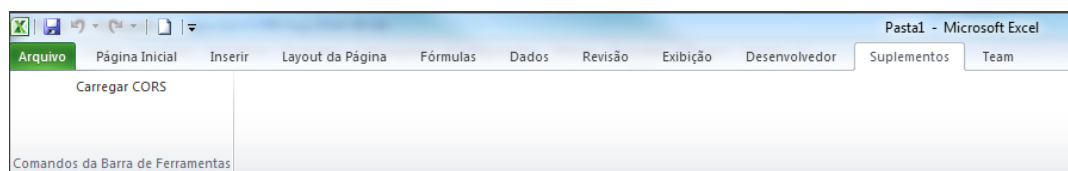


6) Clicar no botão "Procurar...".

- i. Procurar pelo *add-in* na pasta C:\Users\{usuário}\AppData\Roaming\Microsoft\Excel\XLSTART onde {usuário} é o seu usuário de rede
- ii. Selecionar o arquivo B3_CORS.xlam e clicar em "OK". A seguinte tela será exibida:



- 7) Selecionar o suplemento "B3_Cors" e clicar em "OK".
- 8) A opção "Suplementos" será habilitada no Excel, com a funcionalidade "Carregar CORS", conforme imagem abaixo:



7 ARQUIVO DE CONFIGURAÇÃO PARA DIRECIONAMENTO DE PROXY

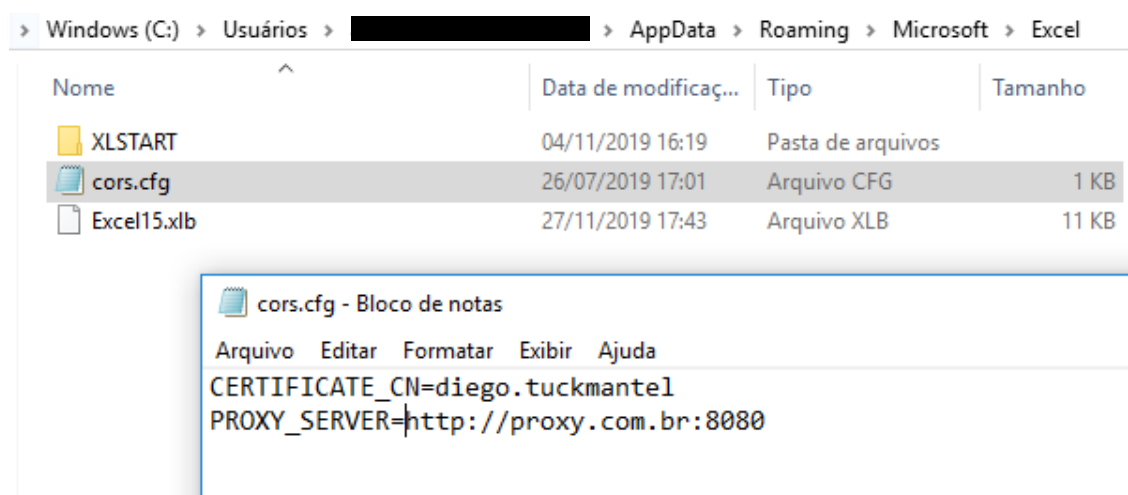
Além da instalação do add-in do Excel, também é necessária a inclusão de um arquivo de configuração.

O arquivo deve ser copiado na pasta: **C:\Users\{usuário}\AppData\Roaming\Microsoft\Excel**, onde {usuário} é o usuário de rede e a pasta AppData é uma pasta oculta no Windows. Note que o diretório da configuração é em um nível anterior ao do add-in.

Abaixo, segue configuração do arquivo e exemplo:

CERTIFICATE_CN= (usuário do certificado)

PROXY_SERVER=incluir_o_servidor_proxy_e_porta



8 TIPOS DE INSTRUMENTO

8.1 DERIVATIVOS

Posições de derivativos são representadas por ativos dos seguintes segmentos:

- Agribusiness: futuros e futuros de opções;
- *Agribusiness: future and options future;*

- Financeiro: futuros, opções à vista, opções de futuros;
- *Finacial: future, options spot, options future and foward;*

- Metais: opções à vista e termo.
- *Metal: options spot and forward.*

Parâmetros	Observações
Código de Negociação (PT) / Symbol (EN)	Código de negociação de posição a ser inserida.
Quantidade de Compra (PT) / Long Qty (EN)	Caso a posição seja apenas de Venda, informar zero ou deixar em branco.
Quantidade de Venda (PT) / Short Qty (EN)	Caso a posição seja apenas de Compra, informar zero ou deixar em branco.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Derivativo	<input type="text"/>	Filtrar	<input type="text"/>
Código de Negociação	Quantidade			
ETHF20	Compra	Venda		
		100		
<input type="button" value="Adicionar"/>				

8.2 OPÇÃO SOBRE AÇÃO

Posições de opção sobre ação são representadas por ativos do segmento:

- Derivativo de ação: Opção de compra e Opção de Venda.
- Equity derivative: Equity call and equity put

Parâmetros	Observações
Código de Negociação (PT) / Symbol (EN)	Código de negociação de posição a ser inserida.
Quantidade de Compra (PT) / Long Qty (EN)	Caso a posição seja apenas de Venda, informar zero ou deixar em branco.
Quantidade de Venda (PT) / Short Qty (EN)	Caso a posição seja apenas de Compra, informar zero ou deixar em branco.
Coberto (PT) / Covered Qty (EN)	Campo opcional para o usuário. Informar se existir posição coberta.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Opção sobre Ação	Filtrar	ABEV
Código de Negociação	Quantidade		
ABEVA200	Compra	Venda	Coberto
<input type="button" value="Adicionar"/>			

8.3 LEILÃO DE SWAP CAMBIAL (PRÉ BOLETA)

Posições de leilão swap (pré boleto) são representadas por ativos do segmento:

- Financeiro: Termo
- Financial: Forward

Parâmetros	Observações
Código de Negociação (PT) / Tradable Instrument (EN)	Código de negociação de posição a ser inserida – referência de SCS.
Preço (PT) / Price (EN)	Preço do leilão.
Quantidade de Compra (PT) / Long Qty (EN)	Caso a posição seja apenas de Venda, informar zero ou deixar em branco.
Quantidade de Venda (PT) / Short Qty (EN)	Caso a posição seja apenas de Compra, informar zero ou deixar em branco.
Preço Compra (PT) / Purchase Price (EN)	Preço de compra do ativo em BRL.
Preço Venda (PT) / Sales Price (EN)	Preço de venda do ativo em BRL.

Data Início de Valorização (PT) / Start of Value Date (EN)	Data de início de valorização da pré-boleta.
--	--



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição Leilão de Swap Cambial

Código de Negociação	Quantidade		Preço Negociado		Data Início Valorização
	Compra	Venda	Compra	Venda	
<input type="button" value="Adicionar"/>					

8.4 POSIÇÃO À VISTA

Posições à vista são representadas por ativos dos seguintes segmentos:

- Posição à vista: ETF (mercado primário) e Dinheiro;
- Equity Cash: ETF primary and cash
- Renda Fixa: termo.
- Fixed Income: forward

Parâmetros	Observações
Código de Negociação (PT) / Symbol (EN)	Código de negociação do ativo.
Quantidade de Compra (PT) / Long Qty (EN)	Código de negociação de posição a ser inserida.
Quantidade de Venda (PT) / Short Qty (EN)	Caso a posição seja somente de Venda, informar zero ou deixar em branco.
Coberto (PT) / Covered Qty (EN)	Caso a posição seja somente de Compra, informar zero ou deixar em branco.

Data de Negociação (PT) / Trade Date (EN)	Campo não obrigatório. Caso não seja informada uma data, assume-se a data do dia.
Preço de Compra (PT) / Purchase Price (EN)	Caso a posição seja de Compra, informar o preço. Caso a posição seja de Venda, informar zero.
Preço de Venda (PT) / Sales Price (EN)	Caso a posição seja de Compra, informar zero. Caso a posição seja de Venda, informar o preço.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Ação	Filtrar	
Código de Negociação	Quantidade		Data de Negociação
	Compra	Venda	Preço Negociado
		Coberto	Compra
			Venda
Adicionar			

8.5 TERMO DE AÇÃO

Posições de termo de ação são representadas por ativos do segmento:

- Derivativo de ação: ação a termo
- *Equity Derivative: Equity forward*

Parâmetros	Observações
Código de Negociação (PT) / Symbol (EN)	Código de negociação de posição a ser inserida.
Vencimento (PT) / Expiration Date (EN)	Campo obrigatório para posição de termo à vista. Informar data de vencimento do termo a ser simulado.
Quantidade de Compra (PT) / Long Qty (EN)	Caso a posição seja de Compra, informar a quantidade. Caso a posição seja de Venda, informar zero.

Quantidade de Venda (PT) / Short Qty (EN)	Caso a posição seja de Compra, informar zero. Caso a posição seja de Venda, informar a quantidade.
Coberto (PT) / Covered Qty (EN)	Se não informado, assume-se posição descoberta. Se informado, assume-se quantidade a ser simulada como coberta.
Preço Negociado Compra (PT) / Purchase Price (EN)	Informar o preço a termo do contrato a ser simulado.
Preço Negociado Venda (PT) / Sales Price (EN)	Informar o preço a termo do contrato a ser simulado.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Termo de Ação	Filtrar	
Código de Negociação	Quantidade Compra Venda	Coberto	Vencimento Preço Negociado Compra Venda
<input type="button" value="Adicionar"/>			

8.6 TERMO NDF

Posições de termo NDF são representadas por ativos do segmento:

- Balcão: termo, opções flexíveis de venda e opções flexíveis de compra;
- OTC: *forward, flexible put option and flexible call option*;

Parâmetros	Observações
Contrato (PT) / Contract (EN)	Código do contrato a termo.

Vencimento (PT) / Expiration Date (EN)	Vencimento do contrato a termo a ser simulado. Esse vencimento deve ser de no mínimo 2 dias úteis a partir da data da simulação.
Indicador (PT) / Underlying Security (EN)	Tipo de contrato a termo a ser simulado.
Compra/Venda (PT) / Purchase/Sale (EN)	Usuário deve selecionar uma das opções: <ul style="list-style-type: none"> • C (termo de compra) • V (termo de venda)
Valor Nocial (PT) / Notional Value (EN)	Valor Base/ Quantidade
Preço de Start (PT) / Start Price (EN)	Preço de início do contrato a termo.

[B]³
MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Termo						
Contrato	Vencimento	Indicador	Compra/Venda	Valor Nocial	Preço de Start		
TMC							

Adicionar

8.7 OPÇÃO FLEXÍVEL

Posições de opções flexíveis são representadas por ativos do segmento:

- Balcão: opções flexíveis de venda e opções flexíveis de compra;
- OTC: *flexible put option and flexible call option*;

Parâmetros	Observações
Contrato (PT) / Contract (EN)	Código do contrato de opção flexível.

Vencimento (PT) / Expiration Date (EN)	Vencimento do contrato a termo a ser simulado. Esse vencimento deve ser de no mínimo 1 dia útil a partir da data da simulação.
Indicador (PT) / Underlying Security (EN)	Tipo de contrato a termo a ser simulado
Compra/Venda (PT) / Purchase/Sale (EN)	Usuário deve selecionar uma das opções: <ul style="list-style-type: none"> • C (termo de compra) • V (termo de venda)
Preço Exercício (PT) / Type of Price (EN)	Tipo de preço do contrato a termo a ser simulado.
Valor Nocial (PT) / Notional Value (EN)	Valor Base/Quantidade (dependendo do tipo de contrato)
Tipo de Barreira 1 (PT) / Type of Barrier 1 (EN)	Campo Opcional para o usuário, se houver barreira, informar o tipo.
Valor de Barreira 1 (PT) / Barrier Value 1 (EN)	Campo Opcional para o usuário, se houver barreira, informar valor.
Tipo de Barreira 2 (PT) / Type of Barrier 2 (EN)	Campo Opcional para o usuário, se houver barreira, informar o tipo.
Valor de Barreira 2 Barrier Value 2 (EN)	Campo Opcional para o usuário, se houver barreira, informar valor.
Tipo de Barreira 3 (PT) / Type of Barrier 3 (EN)	Campo Opcional para o usuário, se houver barreira, informar o tipo.
Valor de Barreira (PT)/ 3 Barrier Value 3 (EN)	Campo Opcional para o usuário, se houver barreira, informar valor.
Rebate (PT) / Rebate Value (EN)	Campo Opcional para o usuário, se houver, informar o valor do rebate.

Caso o usuário defina alguma barreira, também é necessário preencher os campos de Knock-in, Knock-out, barreira limite e valor do rebate.

Esses valores só devem ser preenchidos, caso sejam características do contrato.



SIMULADOR DE RISCO CORE

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição		Opção Flexível										
Contrato	Vencimento	Indicador	Compra/Venda	Preço Exercício	Valor Nocial	Barreira Knock-In		Barreira Knock-Out		Barreira Limite		Valor do Rebate
						Tipo da Barreira	Valor da Barreira	Tipo da Barreira	Valor da Barreira	Tipo da Barreira	Valor da Barreira	

8.8 POSIÇÃO DE SWAP

Posições de opções flexíveis são representadas por ativos do segmento:

- Balcão: swap;
- OTC: swap;

	Parâmetros	Observações
	Contrato (PT) / Contract (EN)	Código do contrato de swap.
	Vencimento (PT) / Expiration Date (EN)	O vencimento deve ter data maior ou igual a d+1
	Indicador (PT) / Security (EN)	De acordo com o contrato selecionado, o sistema irá disponibilizar os indicadores disponíveis nesse contrato que devem ser definidos pelo usuário.
Ponta Ativa	Valor Base (PT) / Notional (EN)	Informar o valor base do contrato.
	Juros (PT) / Interest Rate (EN)	Campo Opcional. Usuário deve inserir apenas o número relativo ao percentual (ex. Se o valor do juro for 2%, informar o valor "2").
	%Indicador (PT) / %Variable (EN)	Campo Opcional. Usuário deve inserir apenas o número relativo ao indicador (ex. Se o valor do juro for 2%, informar o valor "2").
	Preço Start (PT) / Start Price (EN)	Campo Opcional. Usuário deve informar o preço de início do contrato.
	Indicador (PT) / Security (EN)	Informar sempre as 2 pontas do contrato (ativo e passivo).
Ponta Passiva	Valor Base Atualizado (PT) / Updated Notional (EN)	Informar o valor base atualizado do contrato.
	Juros (PT) / Interest Rate (EN)	Campo Opcional. Usuário deve inserir apenas o número relativo ao percentual (ex. Se o valor do juro for 2%, informar o valor "2").
	%Indicador (PT) / %Variable (EN)	Campo Opcional. Usuário deve inserir apenas o número relativo ao indicador (ex. Se o valor do juro for 2%, informar o valor "2").
	Preço Start (PT) / Start Price (EN)	Campo Opcional. Usuário deve informar o preço de início do contrato.



SIMULADOR DE RISCO CORE

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição		Swap											
Contrato	Vencimento	Ponta Ativa				Ponta Passiva							
		Indicador	Valor Base Atualizado	Juros	% Indicador	Preço de Start	Indicador	Valor Base Atualizado	Juros	% Indicador	Preço de Start		

8.9 BTB (EMPRÉSTIMO DE TÍTULOS)

Posições de empréstimo de títulos são representadas por ativos do segmento:

- Balcão Empréstimo de ativos: BTB;
- *OTC traded securities lending*: BTB;

Parâmetros	Observações
Código de Negociação (PT) / Symbol (EN)	Código de negociação do contrato de BTB a ser inserido.
Ativo-Objeto (PT) / Underlying Symbol (EN)	Código de Negociação do ativo objeto.
Quantidade de Tomador (PT) / Long Qty (EN)	Caso a posição seja de Tomador, quantidade é informada. Caso a posição seja de Doador, zero deve ser informado.
Quantidade de Doador (PT) / Short Qty (EN)	Caso a posição seja de Tomador, zero deve ser informado. Caso a posição seja de Doador, quantidade é informada.
Coberto (PT) / Covered Qty (EN)	Campo não obrigatório para o usuário, porém é considerado no cálculo de risco, se informado.
Antecipável (PT) / Anticipatory (EN)	Opções Sim ou Não / Yes or No.
Aceito como Colateral (PT) / Accepted as Collateral (EN)	Opções Sim ou Não / Yes or No.
Vencimento (PT) / Expiration Date (EN)	Data de Vencimento, que deve ser de no mínimo 1 dia útil a partir da data de simulação.

Carência (PT) / Unlock Date (EN)	Data de Carência, que deve ser anterior à data de vencimento e posterior à data de negociação.
Finalidade (PT) / Finality (EN)	Campo obrigatório. O sistema considera para efeitos de cálculo as carteiras 22012 e 23906. Caso outro número seja imputado, o resultado do cálculo irá considerar que a finalidade é a de carteira livre (21016).

[B]³
SIMULADOR DE RISCO CORE

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	BTB	Filtrar							
Código de Negociação	Ativo-Objeto	Quantidade			Antecipável	Aceito como Colateral	Vencimento	Data da Carência	Finalidade
		Doador	Tomador	Coberto					
OTCSELEND									

8.10 GARANTIAS_[ABRDS1]

Posições de empréstimo de títulos são representadas por ativos do segmento:

- Posição à vista: dinheiro;
- *Equity cash: cash;*
- Financeiro: à vista;
- *Financial: spot;*
- Metais: à vista;
- *Metal: spot;*
- Títulos Públicos: termo;
- *Gov. Bonds: forward;*

Parâmetros	Observações
Código de negociação (PT) / Symbol (EN)	Código de negociação de colateral a ser inserido.
Quantidade (PT) / Quantity (EN)	Quantidade de colateral.

[B]³
SIMULADOR DE RISCO CORE

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Garantia	Filtrar
Código de Negociação	Quantidade	

8.11 EVENTO CORPORATIVO DE BTB

Ao inserir uma posição de BTB cujo ativo-objeto sofreu evento corporativo, o usuário deve inserir normalmente a posição de BTB e, adicionalmente, inserir a quantidade e vencimento do ativo-objeto que sofreu o evento através do tipo de posição “Evento Corporativo de BTB”.

O usuário deve preencher os campos conforme especificação abaixo:

Parâmetros	Observações
Código de negociação (PT) / Symbol (EN)	Campo Obrigatório. É preenchido automaticamente com “OTCSECLEND_CORPEVT”
Quantidade (PT) / Quantity (EN)	Quantidade de colateral.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição		Evento Corporativo de BTB		
Código de Negociação	Quantidade Compra	Venda	Vencimento	
OTCSECLEND_CORPEVT				
<input type="button" value="Adicionar"/>				

8.12 RECOMPRA DE AÇÃO

Para inserir uma posição de recompra no simulador, o usuário deve selecionar a opção “Recompra de Ação” no campo “Tipo Posição” do simulador. Em seguida, o usuário deve preencher os campos conforme especificação abaixo:

Parâmetros	Observações
Código de negociação (PT) / Symbol (EN)	Campo Obrigatório. É necessário para selecionar o instrumento da posição de recompra. A busca é facilitada através do campo “Filtrar”
Quantidade Compra	Quantidade de compra da recompra. Deve ser preenchido somente se a posição for de recompra comprada.
Quantidade Venda	Quantidade de venda da recompra. Deve ser preenchido somente se a posição for de recompra vendida.
Data de Negociação	Campo obrigatório

	Corresponde à data em que a ação foi negociada inicialmente.
Preço Negociado Compra	Preço negociado de recompra. Deve ser preenchido somente se a posição for de recompra comprada.
Preço Negociado Venda	Preço negociado de recompra. Deve ser preenchido somente se a posição for de recompra vendida.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Recompra de Ação	Filtrar	
Código de Negociação	Quantidade Compra Venda	Data de Negociação	Preço Negociado Compra Venda
<input type="button" value="Adicionar"/>			

8.13 TERMO DE OURO

Para inserir uma posição de Termo de Ouro no simulador, o usuário deve selecionar a opção “termo de Ouro” no campo “Tipo Posição” do simulador. Em seguida, o usuário deve preencher os campos conforme especificação abaixo:

Parâmetros	Observações
Código de Negociação	Campo Obrigatório. É necessário para selecionar o instrumento da posição de termo de ouro.

	A busca é facilitada através do campo "Filtrar"
Quantidade Compra	Quantidade de compra do termo de ouro. Deve ser preenchido somente se a posição for de compra.
Quantidade Venda	Quantidade de venda da recompra. Deve ser preenchido somente se a posição for de venda.
Data de Negociação	Campo obrigatório Corresponde à data em que o termo de ouro foi negociado inicialmente.
Preço Negociado Compra	Preço negociado do termo de ouro. Deve ser preenchido somente se a posição for de compra
Preço Negociado Venda	Preço negociado de recompra. Deve ser preenchido somente se a posição for de venda.



MARGIN SIMULATOR

ADICIONAR POSIÇÃO

Tipo Posição	Termo de Ouro	Filtrar	
Código de Negociação	Quantidade Compra Venda	Data de Negociação	Preço Negociado Compra Venda
<input type="button" value="Adicionar"/>			

8.14 OUTROS

Para a simulação de garantias (Carta de fiança ou CDB), não há uma opção específica. Estes tipos de colaterais podem ser simulados a partir da opção de EQUITY CASH, informando o valor da garantia.

9 RESULTADO DA SIMULAÇÃO

9.1 RESULTADO DA SIMULAÇÃO DA CHAMADA DE MARGEM

Após clicar no botão “calcular”, o sistema irá processar o cálculo e gerar a seguinte tela de resultado:

[B]³	
SIMULADOR DE RISCO CORE	
Cálculos Iniciais	
	R\$
Risco das Posições (A)	412.800,00
Valor das Garantias Depositadas (B)	0,00
Recurso de Liquidez Utilizado (C)	0,00
Saldo de Garantias Após Procedimentos Adicionais	
	R\$
Todas as Posições da Carteira (D)	-412.800,00
Exclusão de Posições de Entrega de Ativos no Dia (E) **	0,00
Exclusão de Posições de Derivativos Vincendos (F) **	0,00
Exclusão de Ambos os Tipos de Posições Acima (G) **	0,00
Saldo de Garantias (D) *	
	R\$
Recurso de Liquidez Potencial	-412.800,00
	0,00

Tempo de Cálculo: 1123 ms

* $\min((B) + (C) - (A) ; (B))$
 ** Simulações com resultado 0,00 significam que não há tais tipos de posições ou seu cálculo resultou em 0,00.

Erro:
EMBPPM19 is not ok;

Abaixo a descrição de cada campo:

- **Risco das Posições (A):** Risco calculado de todas as posições excluindo-se o valor de garantias depositado;
- **Valor das Garantias Depositadas (B):** Valor de todas as garantias depositadas na carteira;
- **Recurso de Liquidez Utilizado (C):** Valor utilizado baseado nas linhas de liquidez das posições da carteira para cobrir perdas transitórias no processo de encerramento de carteira originadas pelo risco de principal;
- **Todas as Posições da Carteira (D):** Risco com todas as posições;

- **Exclusão de Posições de Entrega de Ativos no Dia (E):** Risco com todas as posições, exceto as liquidações do dia;
- **Exclusão de Posições de Derivativos Vincendos (F):** Risco com todas as posições, exceto os vencimentos curtos;
- **Exclusão de Ambos os Tipos de Posições Acima (G):** Risco com todas as posições, exceto as sub-carteiras 1 e 2;
- **Saldo de Garantias:** Valor final do saldo de garantias da carteira, considerando o pior valor dentre os calculados nas sub-carteiras e as garantias depositadas;
- **Recurso de Liquidez Potencial:** Valor que a carteira adicionada poderia tomar de risco sem a necessidade de aporte de garantias devido a fluxos positivos no processo de encerramento de carteira, ainda considerando os ativos elegíveis.

9.2 RESULTADO DA SIMULAÇÃO DA CHAMADA DE MARGEM COM FLUXO DE ENCERRAMENTO DE POSIÇÃO

Após realizar a criação do portfólio a ser simulado, o usuário deve selecionar na opção “Sim” na função “Risco Detalhado.” Em seguida, clique em calcular.

CARTEIRA		Calcular	Limpar	Importar	Contas Importadas	Carregar
Recurso de Liquidez (R\$)	3.430.000.000,00				Risco Detalhado	<input checked="" type="radio"/> Sim <input type="radio"/> Sim <input type="radio"/> Não
POSIÇÕES		Tipo Posição		Quantidade		
Código de Negociação / Contrato		Compra	Venda	Coberto	Garantia	

O resultado da simulação apresentará as características descritas abaixo:

- **Margens Consolidadas:** Apresentará dentro do fluxo de encerramento os valores financeiros de garantias e posições acumulados no período de D+1 até D+10, isto é, o saldo acumulado consistirá no resultado da

equação Garantias + Posições = Saldo Acumulado. Na apresentação, o valor do saldo acumulado é apresentado até o último dia de encerramento. Segue um exemplo abaixo desta informação apresentada na ferramenta:

Margens Consolidadas	d1	d2	d3	d4	d5	d6	d7	d8	d9	d10
Garantias	99.997.100,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Posições	0,00	-35.189.552,15	-14.458.431,27	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Saldo Acumulado	99.997.100,00	64.807.547,85	50.349.116,58	50.349.116,58	50.349.116,58	50.349.116,58	50.349.116,58	50.349.116,58	50.349.116,58	50.349.116,58

- ii. **Posições/Garantias:** Apresentará o fluxo de caixa do encerramento, segmentado por tipo de posição, do portfólio simulado. Segue um exemplo abaixo desta informação apresentada na ferramenta:

Garantias	d1	d2	d3	d4	d5	d6	d7	d8	d9	d10
Título Público Federal	14.191.445,36	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Real	5.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Posições	d1	d2	d3	d4	d5	d6	d7	d8	d9	d10
Ação	0,00	-19.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Reversão de Ação	0,00	0,00	0,00	9.346,03	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Opção sobre Ação (Call)	0,00	0,00	-170.322,58	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Opção sobre Ação (Put)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Termo de Ação	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Futuro Financeiro	0,00	-31.533.754,54	-17.589.355,98	-9.154.289,95	-2.886.069,70	-302.067,97	0,00	0,00	0,00	0,00

Os tipos de posição que podem ser apresentados são:

- a. Posições:
 - i. Ação
 - ii. Reversão de Ação
 - iii. Opção sobre Ação (Call)
 - iv. Opção sobre Ação (Put)
 - v. Termo de Ação
 - vi. Debênture
 - vii. Futuro Agropecuário
 - viii. Futuro Financeiro
 - ix. Futuro sobre Ação
 - x. Futuro de Energia
 - xi. Opção sobre Futuro Agropecuário
 - xii. Opção sobre Ativo Financeiro
 - xiii. Opção sobre Futuro Financeiro
 - xiv. Swap Cambial
 - xv. BTB de Ação - Doador
 - xvi. BTB de Ação - Tomador
 - xvii. BTB de Ação - Falha
 - xviii. BTB de Ação - Evento Corporativo
 - xix. Termo de Ouro
 - xx. OTC - Swap
 - xxi. OTC - Opção Flexível (Call)
 - xxii. OTC - Opção Flexível (Put)
 - xxiii. OTC - Termo

- b. Garantias
 - i. Título Público Federal
 - ii. Título Internacional
 - iii. Ação
 - iv. Real
 - v. Dólar
 - vi. FIC
 - vii. Ouro
 - viii. ADR

10 EXTRATO DE UTILIZAÇÃO

Ao abrir o add-in do Simulador no Excel, a aba “SimulatorReport” estará disponível para que seja feita a consulta do extrato de utilização mensal do participante.

Após informar o mês e o ano que se deseja consultar, basta clicar no botão “Calcular” e os resultados serão exibidos conforme abaixo:



MARGIN SIMULATOR

Relatório de Consumo

Mês	Ano
12	2019
<input type="button" value="Consultar"/>	

Resumo

Tipo	Quantidade	Faixa
Sem OTC	1	Até 20 posições

Detalhado

Data	Hora	Tamanho	Possui OTC?
04/12/2019	17:19:34	6	Não

11 SOLICITAÇÕES DE AJUSTE E MELHORIAS NA FERRAMENTA

Qualquer tipo de ajuste na ferramenta ou sugestões de melhorias para o produto podem ser encaminhadas para o e-mail riskservices@b3.com.br.

12 SUPORTE NO USO DA FERRAMENTA

O suporte técnico de tecnologia ao Margin Simulator poderá ser solicitado ao SAT (Suporte de Tecnologia), pelo telefone (11) 2565-5120 ou pelo e-mail sat@b3.com.br.

Demais dúvidas sobre a ferramenta deverão ser direcionadas à equipe de Operações de Administração de Risco, pelo telefone (11) 2565-5031, opção URA 3 – 1, ou pelo e-mail risco@b3.com.br.

Esclarecimentos adicionais sobre o Risk Services poderão ser obtidos com a Superintendência de Produtos de Front e Middle, pelo telefone (11) 2565-5996 ou pelo e-mail riskservices@b3.com.br. [ABRDS2]