



BRASIL
BOLSA
BALCÃO

PCO RTC – GUIA DO PARTICIPANTE

PCO | Plano de Continuidade Operacional

SUMÁRIO

1	OBJETIVO	3
2	ABRANGÊNCIA	3
3	ESCOPO	3
4	PREMISSAS E REGRAS GERAIS.....	3
5	ACIONAMENTO E COMUNICAÇÃO	4
6	ALOCAÇÃO E REPASSE DE SWAP CAMBIAL	4
7	LIQUIDAÇÃO BRUTA	6
8	PM - POSITION MANAGEMENT (CONTROLE DE POSIÇÕES).....	7
9	SM - SETTLEMENT MANAGEMENT (GESTÃO DE LIQUIDAÇÃO).....	9
10	TM - TRADE MANAGEMENT (CAPTURA, ALOCAÇÃO E REPASSE)....	11
11	ANEXOS	17
12	INFORMAÇÕES DE CONTROLE	20

1 OBJETIVO

O Plano de Continuidade Operacional (PCO, sistema de contingência PCO ou Plano) visa atender o segmento Listado no cenário em que houve a queda, total ou parcial, do sistema RTC – *Real Time Clearing*. Este plano permitirá a execução de atividades prioritárias de forma alternativa ao sistema.

Este documento, Guia do Participante, tem o objetivo de descrever os procedimentos a serem executados pelos Participantes, em caso de acionamento do Plano de Continuidade Operacional do sistema RTC.

2 ABRANGÊNCIA

O Plano de Continuidade Operacional e o Guia do Participante aplicam-se aos funcionários, estagiários, administradores e demais colaboradores da B3 S/A – Brasil Bolsa Balcão, bem como aos Participantes do mercado.

3 ESCOPO

São atendidos pelo Plano de Continuidade Operacional os seguintes módulos do sistema:

- Alocação e Repasse de Swap Cambial
- Liquidação Bruta
- PM – Position Management (Controle de Posições)
- SM – Settlement Management (Gestão de Liquidação)
- TM – Trade Management (Captura, Alocação e Repasse)

4 PREMISSAS E REGRAS GERAIS

O Plano de Continuidade Operacional poderá ser acionado somente se as premissas abaixo forem atendidas:

- A indisponibilidade do sistema RTC ocorreu após a realização do processamento *batch* do dia anterior e todos os arquivos gerados nesse processo foram transmitidos aos participantes;
- Os demais sistemas e recursos tecnológicos da B3, relacionados ao Cadastro, à Negociação, à Administração de Risco e à Central Depositária, estão disponíveis.

Com o acionamento do Plano, fica estabelecido que toda a comunicação entre a B3 e os Participantes, será realizada pelo canal **Atende B3** (<https://b3uxprod.service-now.com/atendeb3>), a fim de garantir a segurança e organização do processo.

5 ACIONAMENTO E COMUNICAÇÃO

A decisão de acionamento do Plano de Continuidade Operacional será tomada conforme previsto no Plano de Gestão de Crises da B3 e será formalizado aos Participantes por meio de comunicado oficial emitido pela B3.

O PCO poderá ser acionado total ou parcialmente, podendo haver horários diferentes no acionamento para cada módulo do sistema. Caso isso aconteça, a B3 enviará comunicado aos Participantes informando os horários a serem cumpridos.

6 ALOCAÇÃO E REPASSE DE SWAP CAMBIAL

6.1 ACIONAMENTO DO PLANO PARA ESTE MÓDULO

Esse plano será acionado a partir das **15h**, independente do horário em que o sistema RTC ficou indisponível.

6.2 REGRAS ESPECÍFICAS

Regras específicas para este módulo:

- O modelo de contingência será tratado por leilão;

- Todos os negócios deverão vir alocados em conta final, exceto quando a conta informada possuir vínculo de repasse. Caso não venham em conta final ou conta válida, o negócio irá para a conta erro da origem;
- O pré-registro resultante de um leilão pelo BACEN está sujeito à especificação de comitentes no mesmo dia. A não especificação do pré-registro implicará seu cancelamento pela B3;
- Durante a fase de pré-registro, não poderá haver reespecificação nem transferência de posição, devendo os participantes aguardar a fase de registro de negócio, que ocorrerá na DIV, quando os contratos pré-registrados serão transformados em posições no contrato de swap cambial;
- No período de pré-registro, não haverá valorização da ponta cupom nem ajuste periódico dos contratos.

6.3 FLUXO DE ATIVIDADES

1 A B3:

- Comunica a indisponibilidade do sistema e acionamento do PCO;
- Envia planilha parcialmente preenchida aos Participantes (primeira alocação).

2 O Participante (origem):

- Devolve planilha (primeira alocação) com os demais campos preenchidos para o e-mail alocação@B3.com.br.

3 A B3:

- Recebe planilha dos Participantes (origem);
- Para os negócios alocados com vínculo de repasse, envia planilha parcialmente preenchida aos Participantes (destino).

4 O Participante (destino):

- Devolve planilha com os demais campos preenchidos para o e-mail alocação@B3.com.br.

5 A B3:

- Recebe planilha dos Participantes (destino);
- Realiza registro no sistema RTC, após seu restabelecimento, conforme dados do leilão e planilhas recebidas;
- Envia e-mail para cada Participante final solicitando validação do(s) negócio(s) alocado(s).

7 LIQUIDAÇÃO BRUTA

O Plano de Continuidade Operacional para o processo de Liquidação Bruta atende a liquidação de operações de:

- Renda Fixa;
- Oferta Pública;
- Leilão D+3;
- OPA - Oferta Pública de Aquisição; e
- ETF - *Exchange Traded Fund* (estrangeiro).

A ativação desse plano não requer alterações relevantes no processo interno do Participante, exceto a possibilidade de alterações no horário da liquidação e limitações conforme descrito no item 7.2. Regras Específicas.

7.1 ACIONAMENTO DO PLANO PARA ESTE MÓDULO

Esse plano poderá ser acionado a qualquer momento do dia, a partir das **12h**, independente do horário em que o sistema RTC ficou indisponível.

7.2 REGRAS ESPECÍFICAS

Regras específicas para este módulo:

- Para os casos de restrição e/ou liberação de entrega de ativos na liquidação de Ofertas Públicas, o participante deverá entrar em contato com a B3, que efetuará a atualização da instrução antes do envio à Central Depositária.

7.3 FLUXO DE ATIVIDADES

1 A B3:

- Comunica a indisponibilidade do sistema, acionamento do PCO e orientações aos participantes.

2 O Participante:

- Informa à B3 os casos de restrição e/ou liberação, se houver, pelo telefone (11) 2565-5014 e encaminha as informações por e-mail para liquidação.posicoes@b3.com.br e entregaepagamento@b3.com.br.

Restrição/Liberação	Num. Instrução	Cód. ISIN	Quantidade Original	Quantidade a restringir	Quantidade a liberar

3 A B3:

- Atualiza a instrução e encaminha lançamento à Central Depositária.

8 PM - POSITION MANAGEMENT (CONTROLE DE POSIÇÕES)

O Plano de Continuidade Operacional para o módulo PM do sistema RTC atende a todos os negócios da B3 relacionados ao Controle de Posições:

- Liquidação Antecipada;
- Renovação de Empréstimos;
- Cobertura;
- Descobertura; e
- Transferência de Posições.

A ativação desse plano requer alterações no processo interno do Participante, às quais estão descritas no item 9.2. Regras Específicas.

8.1 ACIONAMENTO DO PLANO PARA ESTE MÓDULO

Esse plano poderá ser acionado a qualquer momento do dia, a partir de **14h**, independente do horário em que o sistema RTC ficou indisponível.

8.2 REGRAS ESPECÍFICAS

Regras específicas para este módulo:

1. O envio de informações por parte dos Participantes deverá ser realizado exclusivamente por meio de planilhas (modelos no Anexo B deste documento).
2. Liquidação Antecipada de Empréstimo:
 - A quantidade requisitada pelo participante deve ser menor ou igual a quantidade original do título;
 - Nova data de liquidação do contrato deve ser menor ou igual data antiga.
3. Liquidação Antecipada de Termo:
 - A quantidade requisitada pelo participante deve ser menor ou igual a quantidade original do contrato;
 - A data do Trade deve ser menor ou igual a data de expiração do contrato;
 - Será permitido apenas LA (liquidação em D+1).
4. Renovação de empréstimo
 - Quantidade solicitada para renovação deverá ser menor que a quantidade atual do contrato;
 - A nova data de carência do contrato renovado deverá ser no mínimo um dia maior do que a própria data da solicitação.
5. Os processos de Subscrição, Devolução de Direitos, Descobertura de Posição, Pedidos de Transferência de Posição e Participação em Oferta Prioritária estão em desenvolvimento e serão atendidos pelo PCO em breve. Nessa ocasião, esse Guia do Participante será atualizado.

8.3 FLUXO DE ATIVIDADES

- 1 A B3:
 - Comunica a indisponibilidade do sistema, acionamento do PCO e orientações aos participantes.
- 2 O Participante:
 - Envia planilha contendo as solicitações (ver modelos no anexo B) para o e-mail liquidacao@b3.com.br até o horário e data estabelecidos pela equipe que tratará a contingência. Informações podem ser obtidas por meio do telefone (11) 2565-5014.
- 3 A B3:
 - Atualiza a instrução e encaminha lançamento à Central Depositária.

9 SM - SETTLEMENT MANAGEMENT (GESTÃO DE LIQUIDAÇÃO)

O Plano de Continuidade Operacional para o módulo SM do sistema RTC atende as janelas de liquidação de ativos, que ocorrem às 11h e 13h (débitos) e 15h50 (créditos).

A ativação desse plano não requer alterações relevantes no processo interno do Participante, exceto situações descritas no item 9.2. Regras Específicas.

9.1 ACIONAMENTO DO PLANO PARA ESTE MÓDULO

Esse plano poderá ser acionado a qualquer momento do dia, a partir das **11h**.

9.2 REGRAS ESPECÍFICAS

Regras específicas para este módulo:

- Para os casos de aceite de custodiante, troca de carteira e/ou de restrição, o Participante deverá entrar em contato com a B3, que efetuará a atualização da instrução antes do envio à Central Depositária;

- Em caso de indisponibilidade somente do módulo de liquidação (SM - Settlement Management), este plano pode ser utilizado por mais de um dia consecutivamente;
- Em caso de retorno do sistema RTC após a realização da janela de débito pelo PCO, a janela de crédito pode ser executada normalmente pelo sistema;
- Os horários das grades de liquidação poderão ser alterados e, nestes casos, os Participantes serão comunicados.

9.3 FLUXO DE ATIVIDADES

1 A B3:

- Comunica a indisponibilidade do sistema, acionamento do PCO e orientações aos participantes.

2 O Participante:

- Informa à B3 os casos de aceite de custodiante, troca de carteira e/ou de restrição, se houver, pelo telefone (11) 2565-5014 e encaminha as informações por e-mail para liquidacao@b3.com.br e entregaepagamento@b3.com.br.

Aceite de custódia:

Num. Instrução	Qtde. Original	Qtde. aceita
----------------	----------------	--------------

Troca de carteira:

Num. Instrução	Carteira Original	Carteira Destino	Qtde Original	Qtde na Carteira Destino
----------------	-------------------	------------------	---------------	--------------------------

Restrição/Liberação:

Restrição/Liberação	Num. Instrução	Qtde. Original	Categoria que está solicitando: MC/TP/DP/CST
---------------------	----------------	----------------	--

3 A B3:

- Atualiza a instrução e encaminha lançamento à Central Depositária.

10 TM - TRADE MANAGEMENT (CAPTURA, ALOCAÇÃO E REPASSE)

O Plano de Continuidade Operacional para o módulo TM, do sistema RTC, atende os processos de **alocação de comitentes que devam obrigatoriamente ser realizados em D+0** referentes aos segmentos de negociação:

- *Equities* à vista (incluindo o mercado fracionário), exercício de opções de ações, leilões e ETF's do mercado secundário;
- Mercados derivativos, renda fixa D+1, opções de ações e termo, admitidos à negociação na plataforma PUMA.

O processamento da alocação ocorrerá via mensageria padrão. Não está prevista a disponibilização, para os participantes, de tela para viabilizar a alocação/repasse das operações. As mensagens utilizadas não sofrerão alteração em relação às mensagens de produção:

- Captura: bvmf.012 - Trade Leg Notification
- Alocação: bvmf.013 - Securities Allocation Instruction; bvmf.014 - Securities Allocation Instruction Status Advice
- Repasse: bvmf.019 - Inform Give-up Pending Approval; bvmf.014 - Securities Allocation Instruction Status Advice

Do ponto de vista operacional, a ativação desse plano não requer alterações relevantes no processo interno do Participante, no entanto, diversas restrições deverão ser observadas, conforme descrito no item 10.2. Regras Específicas.

10.1 ACIONAMENTO DO PLANO PARA ESTE MÓDULO

Esse plano será acionado a partir das **15h**, independente do horário em que o sistema RTC ficou indisponível.

10.2 REGRAS ESPECÍFICAS

Regras específicas para este módulo:

- As grades de alocação serão flexibilizadas durante a execução do plano de continuidade;
- Uma vez acionado o sistema de contingência (PCO), todos os negócios elegíveis serão tratados por este sistema, não havendo possibilidade de retorno para o RTC durante o dia;
- Em caso de indisponibilidade do sistema RTC após sua abertura, e consequente ativação do PCO, todo o processamento realizado até então no sistema RTC, nessa data, será desconsiderado. Os Participantes que utilizam o sistema SINACOR deverão restaurar nesse sistema sua posição do início do dia;
- Os negócios não priorizados para alocação no dia da contingência serão segregados e bloqueados para alocação, sendo seu processamento realizado no dia seguinte, após o retorno do sistema RTC;
- Os horários das grades de liquidação poderão ser alterados e, nestes casos, os Participantes serão comunicados;
- As mensagens bvmf.015 (*Securities Allocation Instruction Cancellation*) e bvmf.016 (*Response Give-Up Acceptance Or Rejection*) não serão tratadas e o seu recebimento pela B3 acarretará o não processamento da solicitação e o envio de mensagem de erro técnico ao participante;
- Alocação em sistema de contingência (PCO):
 - Negócios alocados em conta final não serão passíveis de alteração da alocação pelos participantes (não serão aceitas solicitações de exclusão de alocação);
 - As alocações poderão ser realizadas de forma completa, em uma única mensagem de alocação, ou de forma incremental, por meio de mensagens de alocação distintas, até o limite da quantidade

remanescente a alocar para o negócio;

- Os negócios alocados em conta transitória poderão ser alocados via mensageria pelo sistema do participante, com a condição de que a mensagem de alocação contenha a quantidade total remanescente a alocar para o negócio, sendo que: (i) Caso haja distribuição a ser realizada a partir de conta máster (ou outra transitória) para duas ou mais contas, a alocação deverá ser realizada de uma única vez com as distribuições somando a quantidade total do negócio, (ii) Caso um negócio previamente alocado tenha sido dividido parcialmente entre várias contas transitórias (t1, t2, tn) e parcialmente em contas finais (f1, f2,..fn), para cada alocação proveniente de uma conta transitória deverá ser contemplada a quantidade total alocada para essa conta;
- Os negócios que estejam indicados em conta máster somente poderão ser alocados para contas vinculadas a ela. Não será permitido realizar alocação para contas sem vínculo com a máster, o que abrange contas normais, outras contas máster ou transitórias e conta erro/erro operacional, exceto em caso de erros. A distribuição para os filhotes de máster deverá respeitar o critério da quantidade total alocada para a conta máster, sendo realizada em uma única etapa;
- A conta erro e a conta erro operacional são contas finais de alocação. Alocações para conta erro/erro operacional serão permitidas somente a partir de negócios alocados previamente em contas transitórias;
- Não será permitida no sistema de contingência (PCO) a realocação de negócios após sua alocação em uma conta considerada final: (i) Não haverá tratamento da funcionalidade goodwill (realocação de uma conta normal para conta do tipo normal, máster ou filhote, sem infringir quebra de regra da alocação, desde que as contas envolvidas sejam de mesma titularidade), (ii) Realocações entre contas transitórias serão permitidas, exceto quando a conta origem seja do tipo máster;
- Negócios poderão ser cancelados via sistema de contingência (PCO), porém a mensagem bvmf.017 (TradeLegNotificationCancellation) não

será enviada. Os negócios cancelados serão enviados após o encerramento da alocação;

- A mensagem bvmf.018 (TradeManagementReportRequest) não será tratada;
- Somente os arquivos BVBG.013 e BVBG.014 serão disponibilizados após o encerramento da alocação para todos os participantes (PNP, PL e Agentes de Custódia). Não será possível requisitá-los.
- Direcionamento de custódia em sistema de contingência (PCO):
 - Será possível realizar alocações com direcionamento de custódia no sistema de contingência (PCO), desde que o negócio não esteja previamente alocado em conta final;
 - O direcionamento de custódia poderá ocorrer de duas formas: (i) Automaticamente, por meio de alocação para conta com vínculo de custódia opcional, (ii) Pela inclusão durante a alocação, com indicação do agente de custódia e da conta no custodiante. Uma vez que a alocação esteja em conta final, não será possível realizar apenas a inclusão do direcionamento de custódia;
 - Se não houver direcionamento de custódia informado via mensagem enviada pelo participante, o sistema de contingência (PCO) procurará em sua base se existe um vínculo de custódia opcional, direcionando a alocação para a conta associada a este vínculo (caso exista). Se não existir na base, o direcionamento será feito para o mesmo participante e conta de alocação, desde que a alocação seja para uma conta final;
 - Em caso de erro no direcionamento de custódia, a conta de posição e a carteira livre serão atribuídas respectivamente, após o restabelecimento do sistema RTC.
- Indicação de carteira em sistema de contingência (PCO):
 - A indicação de carteira é permitida desde que o negócio não tenha sido

anteriormente alocado para conta final. Uma vez que a alocação esteja em conta final, não será possível realizar apenas a alteração da carteira;

- O sistema de contingência (PCO) não irá realizar validações ou integrações com outros sistemas.
- Repasse em sistema de contingência (PCO):
 - Os repasses serão aceitos automaticamente. O mecanismo de aceite automático ocorrerá por meio de envio pelo sistema de contingência (PCO) das mensagens de notificação de repasse pendente e confirmação do aceite do repasse (bvmf.014) aos participantes envolvidos, imediatamente após a captura de negócio ou recebimento de mensagens de alocação para uma conta com vínculo de repasse constante na base do sistema;
 - Não serão tratados, em caso de acionamento do sistema de contingência (PCO) e retornará erro técnico ao participante: (i) Aceite ou rejeição de repasse, (ii) Cancelamento de repasse, (iii) Confirmação de cancelamento de repasse pelo participante origem.
- Tratamento de exercício de opções em sistema de contingência (PCO):
 - Exercícios de opções sobre ações que forem capturados no dia da indisponibilidade não serão tratados, pois têm prazo de alocação em D+1.
- Cancelamento de negócios em sistema de contingência (PCO):
 - O cancelamento de operações realizadas em ambiente de negociação será realizado após o restabelecimento do sistema RTC.

10.3 FLUXO DE ATIVIDADES

1 A B3:

- Comunica a indisponibilidade do sistema, acionamento do PCO e orientações aos participantes.

2 O Participante:

- Envia as mensagens conforme regras estabelecidas e descritas neste documento. Informações podem ser obtidas pelo telefone (11) 2565-5014 ou e-mail liquidacao@b3.com.br.

3 A B3:

- Processa informações recebidas por meio do sistema de contingência (PCO) e disponibiliza relatórios, conforme regras estabelecidas e descritas neste documento.

11 ANEXOS

11.1 ANEXO A – ALOCAÇÃO E REPASSE DE SWAP CAMBIAL

11.1.1 Layout da planilha a ser enviada aos Participantes (origem)

Coluna	Campo	Descrição
01	Cód Participante	Código do participante que realizará a primeira especificação (preenchido pela B3)
02	Número do Comunicado	Número do leilão (preenchido pela B3)
03	Número de proposta	Número de Proposta (preenchido pela B3)
04	Conta Selic	Conta Selic (preenchido pela B3)
05	Data de vencimento	Data de Vencimento (preenchido pela B3)
06	Quantidade	Quantidade a ser alocada (preenchido pelo Participante origem)
07	Conta da Especificação Final	Conta final da especificação (preenchido pelo Participante origem) Caso seja especificado mais de uma conta para uma mesma proposta, informe as CONTAS FINAIS e as quantidades correspondentes da conta e proposta
08	Repasse (Sim ou Não)	Inclua "Sim" se a conta informada possuir vínculo de repasse e "Não" se a conta informada não possuir vínculo de repasse (preenchido pelo Participante origem)
09	Cód Participante Destino	Informar o Código do Participante Destino caso a conta informada possua vínculo de Repasse (preenchido pelo Participante origem)

11.1.2 Layout da planilha a ser enviada aos Participantes (destino)

Coluna	Campo	Descrição
10	Cód Participante Origem	Código do participante Origem do Repasse (preenchido pela B3)
11	Cód Participante Destino	Código do Participante Destino do Repasse (preenchido pelo Participante origem)
12	Número do Comunicado	Número do leilão (preenchido pela B3)
13	Número de proposta	Número de proposta (preenchido pela B3)
14	Quantidade	Quantidade a ser alocada (preenchido pelo Participante destino)
15	Conta da Especificação Final	Conta final da especificação (preenchido pelo Participante destino) Caso seja especificado mais de uma conta para uma mesma proposta, informe as CONTAS FINAIS e as quantidades correspondentes da conta e proposta

11.2 ANEXO B - POSITION MANAGEMENT

11.2.1 Liquidação Antecipada de Empréstimo - layout da planilha a ser recebida dos Participantes

Coluna	Campo	Descrição
1	Participant ID	Número do participante
2	Participant Account	Conta do Participante
3	Contract ID	Participante insere o número do contrato
4	Side	Participante insere lado: 1 se for tomador e 2 se for doador
5	Early Settlement	Participante insere quantidade de liquidação antecipada solicitada
6	Unlock Date	Data de abertura do contrato: O Participante deve preencher no formato (YYYYMMDD)
7	Expiration Date	Data de expiração do contrato: o Participante deve preencher no formato (YYYYMMDD)
8	Early Settl.	Possibilidade de o doador realizar liquidação antecipada = Inserir TRUE ou FALSE
9	Tender Offer	Permite participar de oferta pública? Inserir TRUE ou FALSE

11.2.2 Liquidação Antecipada de Termo - layout da planilha a ser recebida dos Participantes

Coluna	Campo	Descrição
01	Participant Id	Número do Participante
02	Participant Account	Conta do Participante
03	Contract Number	Número do Contrato
04	Side	Participante insere lado: 1 se for tomador e 2 se for doador
05	Early Settlement	A quantidade de liquidação antecipada solicitada
06	Settlement Type	Inserir LA (só serão aceitas Liquidações Antecipadas em D+1)
07	Trade Date	Preenchido pelo Participante no formato (DD/MM/YYYY)
08	Custodian Code	Código do Custodiante
09	Custodian Account	Conta do Custodiante

11.2.3 Renovação de Empréstimo - layout da planilha a ser recebida dos Participantes

Coluna	Campo	Descrição
01	Participant ID	ID do Participante
02	Participant Account	Conta do Participante
03	Contract ID	Número do contrato
04	Side	Tomador= 1 Doador= 2
05	Renewal Quantity	Quantidade renovada
06	Interest Rate	Taxa de renovação (Ex: 0.000)
07	Unlock Date	Preenchido pelo Participante (YYYYMMDD) – Data de abertura do contrato
08	Expiration Date	Preenchido pelo Participante (AAAAMMDD) – Data de vencimento
09	Early Settl.	Possibilidade de o doador realizar liquidação antecipada = Inserir TRUE ou FALSE
10	Tender Offer	Permite participar de oferta pública? Inserir TRUE ou FALSE

12 INFORMAÇÕES DE CONTROLE

RESPONSÁVEIS PELO DOCUMENTO:

Responsável	Área
Elaboração	Coordenação de Entrega e Pagamento Gerência de Alocação e Controle de Posições Gerência de Continuidade de Negócios
Revisão	Coordenação de Entrega e Pagamento Gerência de Alocação e Controle de Posições Gerência de Continuidade de Negócios
Aprovação	Superintendência de Entrega e Pagamento Superintendência de Alocação e Controle de Posições

REGISTRO DE ALTERAÇÕES:

Versão	Item Modificado	Motivo	Data
01	Versão Original	Publicação inicial	Março/2023