

19 de maio de 2022  
054/2022-PRE

## OFÍCIO CIRCULAR

Participantes do Listado B3

Ref.: **Alterações no Manual de Administração de Risco da Câmara B3 e no Manual de Acesso da B3**

Informamos que entrarão em vigor, em **23/05/2022**, as novas versões do Manual de Administração de Risco da Câmara B3 (Manual de Risco) e do Manual de Acesso da B3 (Manual de Acesso).

No Manual de Risco, a alteração, no Capítulo 5 (Limites de concentração de posição em aberto), tem como objetivo, exclusivamente, esclarecer que as posições agregadas em diversos níveis de participantes contemplam as operações realizadas durante todo o período de negociação, incluindo os períodos de negociação estendida (*after-market*) e de negociação *after-hours*.

No Manual de Acesso, as alterações têm como objetivo:

**(i)** refletir as mudanças anteriormente divulgadas pela B3 por meio de Ofício Circular, quais sejam:

- atualizar os valores das contribuições para o fundo de liquidação da Câmara B3 (FLI), nos termos do Ofício Circular 001/2022-VNC, de 04/01/2022; e
- substituir o balancete consolidado "COS4040" pelo "COS4060", em razão da extinção do arquivo "COS4040" pelo Banco Central do Brasil a partir da data-base janeiro/2022, inclusive, e da publicação das Resoluções CMN 4.911/2021 e 4.950/2021 e da Instrução Normativa BCB 210/2021,

conforme divulgado pela B3 por meio do Ofício Circular 004/2022-VNC, de 15/02/2022.

- (ii) incluir requerimento para envio à B3 das demonstrações financeiras do participante no formato "COS9010"; e
- (iii) excluir a necessidade de envio à B3 da apresentação de resultados e do balanço nas formas BRGAAP e IFRS.

O prazo de envio do "COS4060" permanece igual ao prazo de envio do "COS4040", ou seja, 30 (trinta) dias após o encerramento do exercício a que o balancete se refere. O arquivo deve ser gerado em formato XML (*eXtensible Markup Language*) e conforme leiaute definido pelo Banco Central do Brasil, disponível em [www.bcb.gov.br](http://www.bcb.gov.br) (Estabilidade financeira, Sistema Financeiro Nacional, Sistemas e informações ao BC, Controle de Remessa de Documentos (CRD) Leiaute de documentos e base normativa).

As alterações implementadas no Manual de Risco e no Manual de Acesso estão detalhadas no Anexo deste Ofício Circular.

As novas versões do Manual de Risco e do Manual de Acesso estarão disponíveis, respectivamente, a partir de **23/05/2022** em [www.b3.com.br](http://www.b3.com.br): (i) Regulação, Estrutura normativa, Regulamentos e manuais, Compensação, liquidação e gerenciamento de riscos, Acessar documentos; e (ii) Regulação, Estrutura normativa, Regulamentos e manuais, Acesso, Listado B3, Acessar documentos.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Administração de Risco, pelos telefones (11) 2565-5031 ou 2565-5032.

Gilson Finkelsztain  
Presidente

Mario Palhares  
Vice-Presidente de Operações –  
Negociação Eletrônica e CCP

**Anexo do OFÍCIO CIRCULAR 054/2022-PRE****Descrição das Alterações****I. MANUAL DE ADMINISTRAÇÃO DE RISCO DA CÂMARA B3****CAPÍTULO 5 – Limites de concentração de posição em aberto**

A inclusão de texto no terceiro parágrafo do capítulo visa esclarecer que as posições agregadas em diversos níveis de participantes contemplam as operações realizadas durante todo o período de negociação, incluindo os períodos de negociação estendida (*after-market*) e de negociação *after-hours*.

**II. MANUAL DE ACESSO DA B3****CAPÍTULO 2 – PARTICIPANTES AUTORIZADOS****Seção 2.1 – PARTICIPANTE DE NEGOCIAÇÃO PLENO****Subseção 2.1.5 – Depósito de Garantias****Seção 2.3 – MEMBRO DE COMPENSAÇÃO****Subseção 2.3.4 – Depósito de Garantias****Seção 2.4 – PARTICIPANTE DE LIQUIDAÇÃO****Subseção 2.4.4 – Depósito de Garantias**

Nas subseções acima, foram atualizados os valores de contribuição para o fundo de liquidação da Câmara B3 (FLI), requeridos da B3 dos membros de compensação, dos participantes de negociação plenos e dos participantes de liquidação, nos termos do Ofício Circular 001/2022-VNC, de 04/01/2022.

## **CAPÍTULO 2 – PARTICIPANTES AUTORIZADOS**

### **Seção 2.1 – PARTICIPANTE DE NEGOCIAÇÃO PLENO**

#### **Subseção 2.1.3 – Requisitos Econômicos e Financeiros**

### **Seção 2.2 – PARTICIPANTE DE NEGOCIAÇÃO**

#### **Subseção 2.2.3 – Requisitos Econômicos e Financeiros**

### **Seção 2.3 – MEMBRO DE COMPENSAÇÃO**

#### **Subseção 2.3.3 – Requisitos Econômicos e Financeiros**

### **Seção 2.4 – PARTICIPANTE DE LIQUIDAÇÃO**

#### **Subseção 2.4.3 – Requisitos Econômicos e Financeiros**

### **Seção 2.5 – AGENTE DE CUSTÓDIA**

#### **Subseção 2.5.2. – Requisitos Econômicos e Financeiros**

### **Seção 2.6 – PARTICIPANTE DE REGISTRO**

#### **Subseção 2.6.3. – Requisitos Econômicos e Financeiros**

### **Seção 2.7 – INFRAESTRUTURA DE MERCADO**

#### **Subseção 2.7.3. – Requisitos Econômicos e Financeiros**

## **CAPÍTULO 3 – PARTICIPANTES CADASTRADOS**

### **Seção 3.5 – DEPOSITÁRIO DE OURO**

#### **Subseção 3.5.3 – Requisitos Econômicos e Financeiros**

### **Seção 3.6 – FUNDIDOR DE OURO**

#### **Subseção 3.6.2 – Requisitos Econômicos e Financeiros**

### **Seção 3.9 – BANCO EMISSOR DE GARANTIAS**

#### **Subseção 3.9.2 – Requisitos Econômicos e Financeiros**



054/2022-PRE

Em cada uma das subseções acima elencadas, foi substituída a menção ao balancete consolidado "COS4040" por "COS4060" e incluído o requerimento para envio das demonstrações financeiras no formato "COS9010" para as datas-base de junho e dezembro.

Na seção 3.9 – BANCO EMISSOR DE GARANTIAS, subseção 3.9.2 – Requisitos Econômicos e Financeiros, foi excluída a necessidade de o banco emissor de garantias encaminhar à B3 a apresentação de resultados e o balanço nas formas BRGAAP e IFRS.