

MANUAL DE NORMAS ATUAÇÃO DA B3 COMO AGENTE DE CÁLCULO

MANUAL DE NORMAS
ATUAÇÃO DA B3 COMO AGENTE DE CÁLCULO

ÍNDICE

REGISTRO DE ALTERAÇÕES.....	3
CAPÍTULO I – DO OBJETIVO	4
CAPÍTULO II – DAS DEFINIÇÕES	4
CAPÍTULO III – DAS METODOLOGIAS DE CÁLCULO, DOS MODELOS DE CÁLCULO E DAS FONTES DE DADOS UTILIZADOS PELA B3 NA MARCAÇÃO A MERCADO	5
CAPÍTULO IV – DA INDICAÇÃO, DA SUBSTITUIÇÃO, DA DESTITUIÇÃO E DA RENÚNCIA DA B3 COMO AGENTE DE CÁLCULO	5
Seção I – Da indicação da B3 como Agente de Cálculo.....	5
Seção II – Da substituição e da destituição da B3 como Agente de Cálculo	5
Seção III – Da renúncia da B3 da função de Agente de Cálculo.....	6
CAPÍTULO V – DO REGISTRO DO PREÇO OU DO VALOR APURADO NA MARCAÇÃO A MERCADO NO MID	6
CAPÍTULO VI – DAS TAXAS E DOS DEMAIS CUSTOS DEVIDOS POR PARTICIPANTE VINCULADO QUE INDIQUE A B3 COMO AGENTE DE CÁLCULO	6
CAPÍTULO VII – DAS DISPOSIÇÕES GERAIS.....	6

REGISTRO DE ALTERAÇÕES

(a partir de 02/05/2019)

<u>Número da alteração</u>	<u>Data de entrada em vigor do normativo</u>	<u>Ofício Circular que divulgou a alteração normativa*</u>
<u>1</u>	<u>31/07/2023</u>	<u>127/2023-PRE</u>
<u>2</u>	<u>02/05/2024</u>	<u>063/2024-PRE</u>

*Ofício Circular por meio do qual a alteração foi divulgada.

MANUAL DE NORMAS

ATUAÇÃO DA B3 COMO AGENTE DE CÁLCULO

CAPÍTULO I – DO OBJETIVO

Artigo 1º

O presente Manual de Normas é instituído pela **B3 – S.A. BRASIL, BOLSA, BALCÃO**, com o objetivo de descrever as regras e os aspectos específicos pertinentes à sua atuação como Agente de Cálculo.

§1º – Na função de Agente de Cálculo, a B3 efetua a Marcação a Mercado de *swap*, termo ou opção registrado em Sistema (“Operação com Derivativo”), bem como do(s) respectivo(s) Ativo(s) Garantidor(es).

§2º – Os tipos de Operação de Derivativo e de Ativo Garantidor para os quais a B3 pode ser indicada para atuar como Agente de Cálculo são divulgados em Manual de Operações e/ou em Comunicados.

CAPÍTULO II – DAS DEFINIÇÕES

Artigo 2º

Para os efeitos do presente Manual de Normas entende-se por, na sua forma singular ou plural:

- I - Alienação/Cessão Fiduciária – a alienação fiduciária e a cessão fiduciária, reguladas pelo Artigo 66-B da Lei nº 4.728/1965, incluído pela Lei nº 10.931/2004, e pelo Decreto-Lei nº 911/1969, sucessivamente complementados pelo disposto nos artigos 1.361 e seguintes do Código Civil Brasileiro.
- II - Ativo Garantidor – o valor mobiliário, título ou outro direito de crédito alienado ou cedido fiduciariamente em garantia de Operação de Derivativo.
- III - Presidente – o Presidente da B3.
- IV - Marcação a Mercado – a atividade que tem como principal objetivo identificar o valor de uma Operação de Derivativo e do(s) respectivo(s) Ativo(s) Garantidor(es) em uma determinada data, utilizando-se modelos matemáticos para esse fim.
- V - MID – Módulo de Informação de Derivativos, integrante do Sistema de Registro.
- VI - Normas do Balcão B3 – Regulamento, Manual de Normas, Manual de Operações, Código de Conduta, Comunicado ou Ofício-Circular do Balcão B3.

- VII - Operação com Derivativo – qualquer modalidade de operação com derivativo nos termos da legislação e regulamentação em vigor.
- VIII - Participante – o detentor de Direito(s) de Acesso.
- IX - Participante Vinculado – o Participante que seja parte da Operação de Derivativo ou o Participante cujo Cliente seja parte da operação.
- X - Regulamento – o Regulamento da B3 para Acesso de Participante, para Admissão de Ativo, para Negociação, para Registro de Operação, para Registro Eletrônico e para Liquidação.
- XI - Sistema do Balcão B3 – o sistema que compreende o Subsistema de Registro, o Subsistema de Depósito Centralizado, o Subsistema de Compensação e Liquidação, os subsistemas integrantes da Plataforma de Negociação do Balcão B3, o serviço computacional para ativos não submetidos a Registro ou a Depósito Centralizado e o Módulo de Distribuição de Ativos - MDA.

CAPÍTULO III – DAS METODOLOGIAS DE CÁLCULO, DOS MODELOS DE CÁLCULO E DAS FONTES DE DADOS UTILIZADOS PELA B3 NA MARCAÇÃO A MERCADO

Artigo 3º

As metodologias de cálculo, os modelos de cálculo e as fontes de dados utilizados pela B3 na Marcação a Mercado constam do documento “Metodologia CETIP de Marcação a Mercado”.

CAPÍTULO IV – DA INDICAÇÃO, DA SUBSTITUIÇÃO, DA DESTITUIÇÃO E DA RENÚNCIA DA B3 COMO AGENTE DE CÁLCULO

Seção I – Da indicação da B3 como Agente de Cálculo

Artigo 4º

O registro de indicação da B3 como Agente de Cálculo no MID é permitido para o(s) Participante(s) Vinculado(s) que tenha(m) previamente firmado o Termo de Compromisso e Adesão a este Manual de Normas.

Parágrafo único – As regras e os procedimentos relativos ao registro de indicação da B3 como Agente de Cálculo constam do Manual de Normas de Agente de Cálculo e Acelerador e do correspondente Manual de Operações.

Seção II – Da substituição e da destituição da B3 como Agente de Cálculo

Artigo 5º

Os procedimentos e as regras pertinentes à substituição e à destituição da B3 como Agente de Cálculo constam do Manual de Normas de Agente de Cálculo e Acelerador e do correspondente Manual de Operações.

Seção III – Da renúncia da B3 da função de Agente de Cálculo

Artigo 6º

É facultado à B3, mediante informação ao(s) Participante(s) Vinculado(s) que a tenha(m) indicado como Agente de Cálculo, interromper a prestação desse serviço, a qualquer tempo, para uma ou mais Operações de Derivativos e seu(s) Ativo(s) Garantidor(es).

Parágrafo único – A renúncia mencionada no *caput* deste Artigo será informada ao(s) correspondente(s) Participante(s) Vinculado(s) com 48 (quarenta e oito) horas de antecedência, podendo tal comunicação processar-se por meio eletrônico.

CAPÍTULO V – DO REGISTRO DO PREÇO OU DO VALOR APURADO NA MARCAÇÃO A MERCADO NO MID

Artigo 7º

O procedimento para registro de preço ou de valor apurado na Marcação a Mercado no MID consta de Manual de Operações ou de Comunicado.

CAPÍTULO VI – DAS TAXAS E DOS DEMAIS CUSTOS DEVIDOS POR PARTICIPANTE VINCULADO QUE INDIQUE A B3 COMO AGENTE DE CÁLCULO

Artigo 8º

O(s) Participante(s) Vinculado(s) arcam com as taxas e os demais custos pertinentes à indicação da B3 como Agente de Cálculo, conforme tabela de preços, divulgada na página da B3 na rede mundial de computadores (www.b3.com.br).

Artigo 9º

Na falta de pagamento de taxa ou custo referidos no Artigo 7º, aplicam-se os procedimentos previstos no Regulamento, no Capítulo que dispõe sobre os emolumentos, taxas e outros custos devidos pelo Participante.

CAPÍTULO VII – DAS DISPOSIÇÕES GERAIS

Artigo 10

Na hipótese de ambiguidade entre as disposições contidas neste Manual de Normas e nas demais Normas do Balcão B3 relacionada às disposições específicas aplicáveis aos Ativos, às Atividades de Registro, de Depósito Centralizado, de Compensação e Liquidação e ao Mercado de Balcão Organizado, deve prevalecer o normativo mais específico, considerando a matéria do objeto da ambiguidade. Caso os normativos e a matéria não estejam relacionados às disposições específicas aplicáveis aos Ativos,

às Atividades de Registro, de Depósito Centralizado, de Compensação e Liquidação e ao Mercado de Balcão Organizado, deve prevalecer o Regulamento do Balcão B3.

Artigo 1~~Artigo 11~~

A Diretoria Colegiada é competente para dirimir eventuais, decorrentes do disposto neste Manual de Normas ou de casos omissos, por meio de Ofício Circular ou outros instrumentos cujo conteúdo, para todos os efeitos, complementará o disposto neste Manual de Normas.

Artigo 12

O presente Manual de Normas é aprovado pela Diretoria Colegiada da B3 e, conforme aplicável, pelos órgãos reguladores competentes, nos termos da regulamentação editada por estes.

Artigo 2~~Artigo 13~~

O presente Manual de Normas cancela e substitui o Manual de Normas Atuação ~~Cetip B3~~ como Agente de Cálculo em vigor desde ~~21-31~~ de ~~junho-julho~~ de ~~2010~~2023.

Artigo 3~~Artigo 14~~

Este Manual de Normas entra em vigor na data de ~~31-02~~ de ~~julho-maio~~ de ~~2023~~2024.