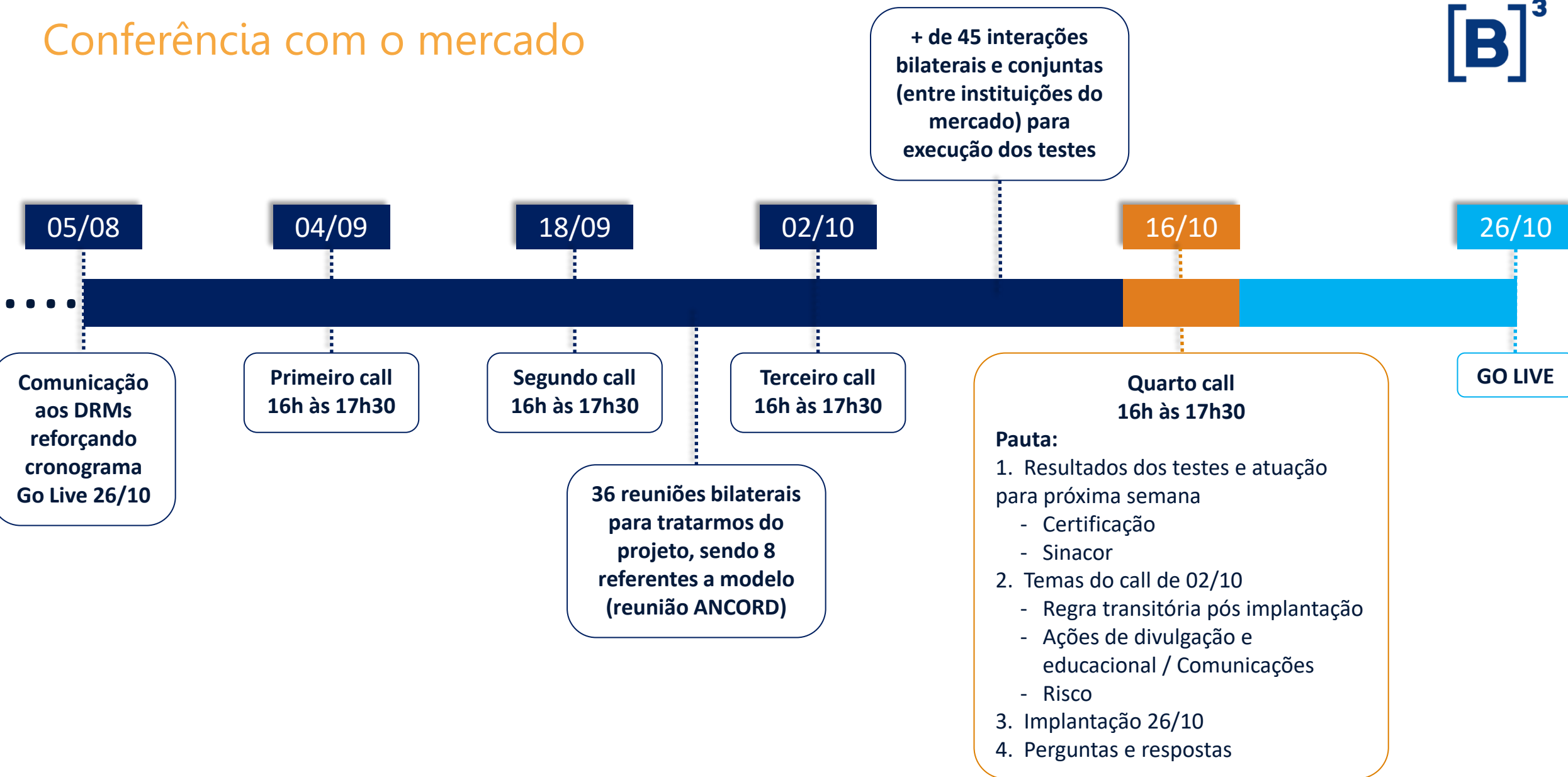




CONFERÊNCIA COM O MERCADO – 16/10

Projeto Negociação Eletrônica de Empréstimo de Ativos

Conferência com o mercado



1. Resultados dos testes e atuação para próxima semana

Certificação



Planos de ação e acompanhamento com clientes para garantir os testes “fim-a-fim”



Incidentes ocorridos no dia 13/10 (terça-feira), afetando a mensageria o iMercado e disponibilização dos arquivos BVBG's



As grades de operações dos sistemas RTC e de Negociação Eletrônica de Empréstimo de Ativos foram estendidas no ambiente de certificação, até o dia 23/10, além da extensão de horário do ambiente até às 22h

Extensão do ambiente de testes	
Data	Hora
13/out - terça	até às 22h00
14/out - quarta	até às 19h30
15/out - quinta	até às 22h00
16/out - sexta	até às 22h00
19/out - segunda	até às 22h00
20/out - terça	até às 22h00
21/out - quarta	até às 19h30
22/out - quinta	até às 22h00
23/out - sexta	até às 22h00

Sistema de Empréstimo			Grade de Operações
D+0	D+1	Registro	
	09h00		Abertura
21h45	21h45	21h45	Inclusão de oferta em conta final
-	21h45	-	Inclusão de oferta em conta transitória
20h50	20h50	20h50	Inclusão de oferta com repasse
21h30	21h30	21h30	Inclusão de oferta com custódia
21h30	21h30	21h30	Aprovação carrying - oferta doadora
-	-	21h30	Aprovação carrying tomador - negócio
21h45	21h45	21h45	Aprovação de custodiante - oferta
10h50	20h50	20h50	Fechamento de contrato com repasse
11h30	21h30	21h30	Fechamento de contrato com custódia
-	21h45	21h45	Fechamento de contrato conta transitória
11h45	21h45	21h45	Fechamento de contrato conta final
	21h45		Fechamento

RTC	Grade de Operações
09h00	Abertura
11h30	Horário limite de repasse Tela D+0
11h45	Horário limite de alocação Tela D+0
11h55	Horário limite de aceite do custodiante D+0
12h00	Janela de entrega de ativos
21h15	Horário limite de repasse Tela D+1
21h30	Horário limite de alocação Tela D+1
22h00	Horário limite de aceite do custodiante D+1
22h00	Fechamento

1. Resultados dos testes e atuação para próxima semana

SINACOR

- Acompanhamento dedicado para a execução dos processos e fluxos (fim-a-fim), com participantes do mercado, em busca de alto nível de prontidão até 23/10
- Todas as corretoras já estão com a versão base 20.2
- O Patch 20.2.2 sustentará o produto do empréstimo e deve ser implantado em produção até 25/10
- Cookbook – Será comunicado até 20/10 (terça-feira), com os processos a serem executados na implantação
- Acompanharemos o modelo de atendimento da B3 durante o final de semana da implantação

2. Temas do call de 02/10

Regra transitória pós implantação



B3 recebeu o pedido para avaliar o estorno de multas por falha de entrega de ativos durante a estabilização



Fizemos o pleito junto ao regulador e o acordado foi o seguinte

- O participante que, por motivo de erro operacional decorrente da implantação, sofrer multa por falha de entrega de ativos na janela de liquidação deve formalizar o pedido junto a B3, apresentando os motivos.
- A B3 avaliará o pedido e, se aprovado, efetivará os estornos e dividirá o caso junto ao regulador



A regra transitória se aplica à multa mínima de 0,5% e tem validade por 2 semanas após a implantação

2. Temas do call de 02/10

Ações de divulgação e educacional / Comunicações (1/2)



Envolvimento dos participantes nas discussões sobre clientes institucionais (locais e INR's)

Iniciativas da B3 voltadas para:

Clientes locais

- Interações (one/one) SP/RJ/DF/PA
- GTs específicos sobre o produto
- Discussões na câmara consultiva da B3
- Comunicações direcionadas para conhecimento do produto
- Webinar com Buy Side ([link](#))

Clientes INR's

- Envio de material sobre o projeto para base de clientes NR
- Calls bilaterais com clientes e *Agent Lenders*.
- Divulgação do projeto no evento da RMA (*Risk Management Association*)



Até o momento, a B3 não recebeu a relação de clientes que desconhecem do produto/projeto

2. Temas do call de 02/10

Ações de divulgação e educacional / Comunicações (2/2)



Comunicação para PF

- Vídeo e tutorial sobre o empréstimo divulgado no [HUB Educação B3](#) > [Como funciona o empréstimo de ativos](#)
- Corretagem e IR sobre o valor bruto: Disponibilizamos no site de clientes um *disclaimer* sobre a tributação das operações de empréstimo, incluindo um exemplo com a cobrança de corretagem, disponível no [Site Clientes](#) > Material de Apoio > [Tarifação e Tributação – BTB \(pdf\)](#)



Bloqueio judicial na nova tela do BTB

- Não há mudança em relação ao modelo atual.
- Ações emprestadas e os contratos em aberto não são bloqueados.

2. Temas do call de 02/10

Risco

- Não há consumo de limite agregado de risco de pré-negociação para contratos doadores (Saldo Potencial Doador Agregado - SPDA) quando são inseridas ofertas doadoras certificadas. Apenas ofertas não-certificadas consumirão o limite SPDA.
- O valor do risco não-aloçado de um PNP/PL (CORE1) será impactado por contratos doadores não certificados com liquidação em D+1. Estas posições impactarão o saldo operacional do participante.
- Após a alocação, o valor do risco não-aloçado do PNP/PL (CORE1) deixa de ser impactado pela posição doadora não certificada.
- Posições doadoras não certificadas podem, no entanto, continuar impactando o saldo operacional do participante caso o risco residual do comitente que recebeu a posição esteja entre os dois maiores riscos residuais do PNP/PL. O direcionamento do ativo doado para a carteira de garantias é uma opção para zerar o impacto no saldo operacional do PNP/PL.
- Documento com exemplos de cálculo de risco disponível na página do projeto.
Site Clientes > Material de Apoio > [Procedimentos de Cálculo de Risco \(v1.1\) - BTB \(pdf\)](#)

3. Implantação 26/10 (1/2)



Últimos comunicados e ofício sobre o projeto

- [CE 126/2020-VOP](#), que trata dos procedimentos de implantação
- [OC 125/2020-PRE](#), que formaliza as regras necessárias para a implantação do projeto
- [CE 039/2020-VOP](#), informando que os contratos de empréstimos de ativos serão tarifados de acordo com as tarifas vigentes na data de início até o seu encerramento



Comunicação de implantação

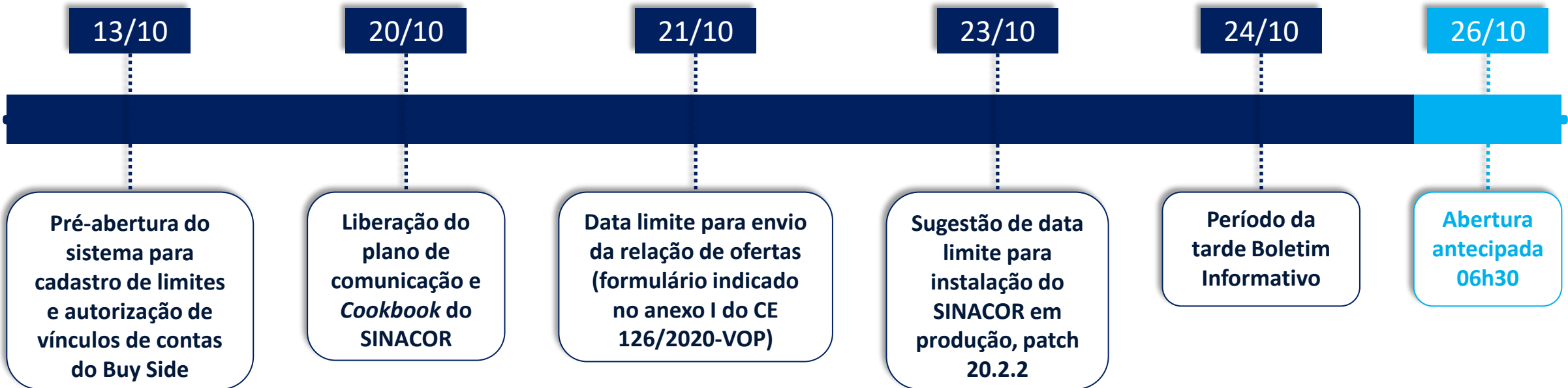
- Boletim do dia 24/10



Mobilização das equipes da B3 para atendimento na abertura antecipada e acompanhamento diário

- Horário de atendimento – 06h30
- Liquidação – (11) 2565-5012 (liquidacao@b3.com.br)
- Risco – (11) 2565-5031 (risco@b3.com.br)
- Sinacor – (11) 2565-5050 (sinacor@b3.com.br)

3. Implantação 26/10 (2/2)



4. Espaço aberto para Perguntas e Respostas

 Testes ambiente de certificação e SINACOR

 Preparação para implantação

 Outros assuntos

[B]³