



Pós negociação de Renda Fixa

Principais mensagens do Fluxo II



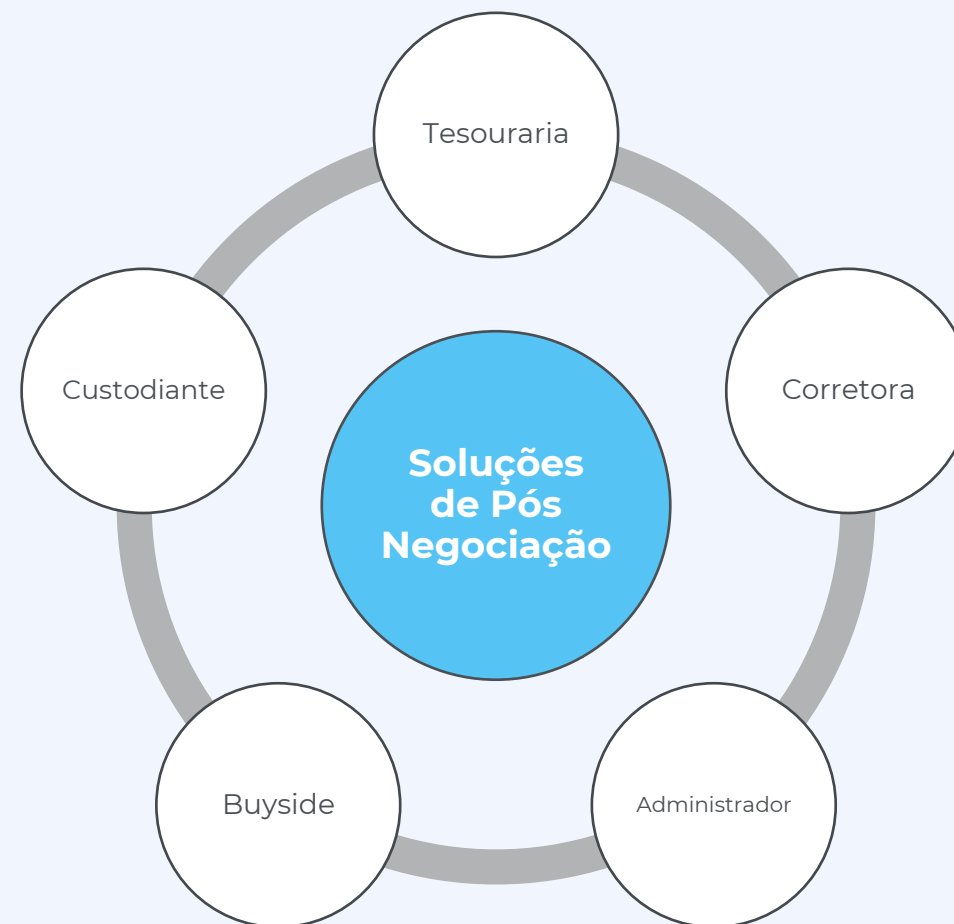
Resumo do Produto

O que é?

Serviço de automação e modernização dos processos de pós negociação de Renda Fixa

Objetivos

1. **Eletronificação** da pós negociação de Renda Fixa Privada (hoje e-mail/telefone)
2. **Eficiência operacional**, não dependendo de diversos times para batimento
3. Ferramenta viabiliza **extensão do horário de corte plataformas** (negociação D0)
4. Acompanhamento de **status real time** da operação



[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

O Fluxo II

O Solução de Pós negociação **Fluxo II** consiste na padronização da troca de informação entre os participantes, a partir da integração dos módulos de negociação do Trader com os sistemas da Clearing (RTC) e de Registro e Depósito (NoMe) para os ativos: Debênture, Certificado de Recebível do Agronegócio (CRA), Certificado de Recebível Imobiliário (CRI) e Cota de Fundo Fechado (CFF).

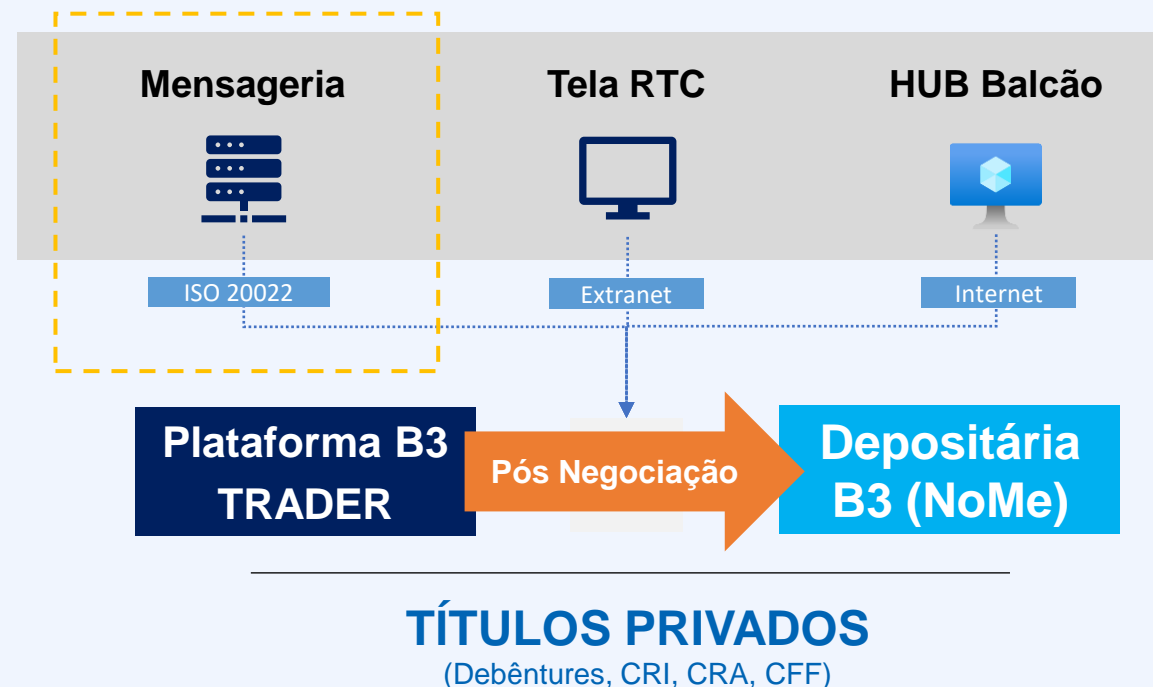
- RTC captura os negócios realizados na plataforma de negociação automaticamente;
- Participantes devem fazer toda a parte de alocação centralizada na plataforma, antes feito por telefone ou e-mail;
- Os dados das alocações do RTC serão transformados em um registro de uma operação de Compra/Venda no NoMe (operação 52/552);
- A modalidade de liquidação será definida automaticamente no NoMe baseada nas partes/contas envolvidas da operação;
- A liquidação seguirá as grades e processos já definidos pela depositária (NoMe).

[B]³

Fluxo II – Títulos Privados

O Fluxo II (cont.)

- Esse material foi elaborado para auxiliar os participantes que utilizarão a mensageria para fazer a comunicação com a B3 envolvendo o RTC;
- Este fluxo contém somente as mensagens básicas, desde mensagens de status até alocação e confirmação de custódia. Caso queira ver todas as mensagens, colocamos os catálogos no site de clientes;
- Lembrando: a ferramenta se comunica indiferente do input utilizado (mensageria, tela)



Captura do negócio

Captura do negócio

Alocação

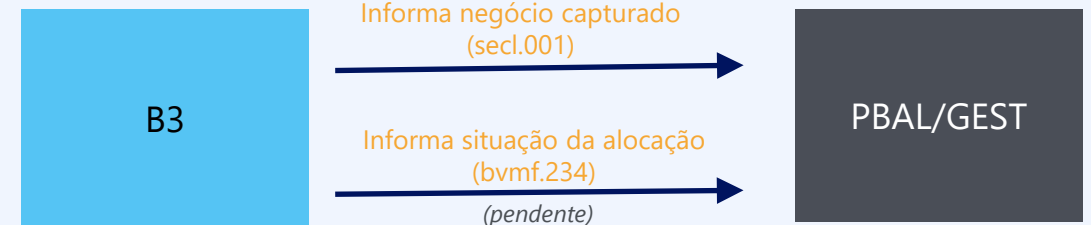
Realocação

Conciliação

Confirmação de Custódia

B3 Informa Negócio de Renda Fixa de Balcão Realizado - Com auto-alocação

- B3 envia a mensagem **TradeLegNotificationV03** <secl.001.001.03> ao participante executor informando a captura do negócio realizado e seu detalhamento.
- B3 envia a mensagem **AllocationInstructionStatus** <bvmf.234.01> ao participante executor/custodiante informando situação da alocação.



Neste exemplo

- Predecessor: Participante A e Participante realizaram um negócio na plataforma de negociação (Voice, Tela, RFQ, etc)
- B3 envia duas mensagens: uma informando o negócio capturado e outra com o status. Fica a critério do participante ler uma (bvmf.234) ou as duas

Alocação

Inclusão/Exclusão de Alocação de Negócios de Renda Fixa de Balcão com Confirmação – Títulos Privados

- O participante responsável pela alocação envia a mensagem **OTCFixedIncomeAllocationInstruction <bvmf.233.01>** à B3 para solicitar a inclusão/exclusão de alocação do negócio e informa todos os detalhes pertinentes à alocação;
- B3 envia a mensagem **AllocationInstructionStatus <bvmf.234.01>** informando ao participante responsável pela alocação/custodiante a situação da alocação solicitada;
- O Custodiante poder informar à B3 a aprovação ou reprovação da indicação de custódia via RTC ou NoMe
 - RTC: **OTCFixedIncomeAllocationAcceptanceOr Rejection <b3.270.01>**
 - NoMe: **CTP0052**

Neste exemplo:

- Participante A fez a alocação;
- Participante B fez a alocação;
- Custodiante Y aprovou a alocação do participante A;
- Custodiante Z aprovou a alocação do participante B.

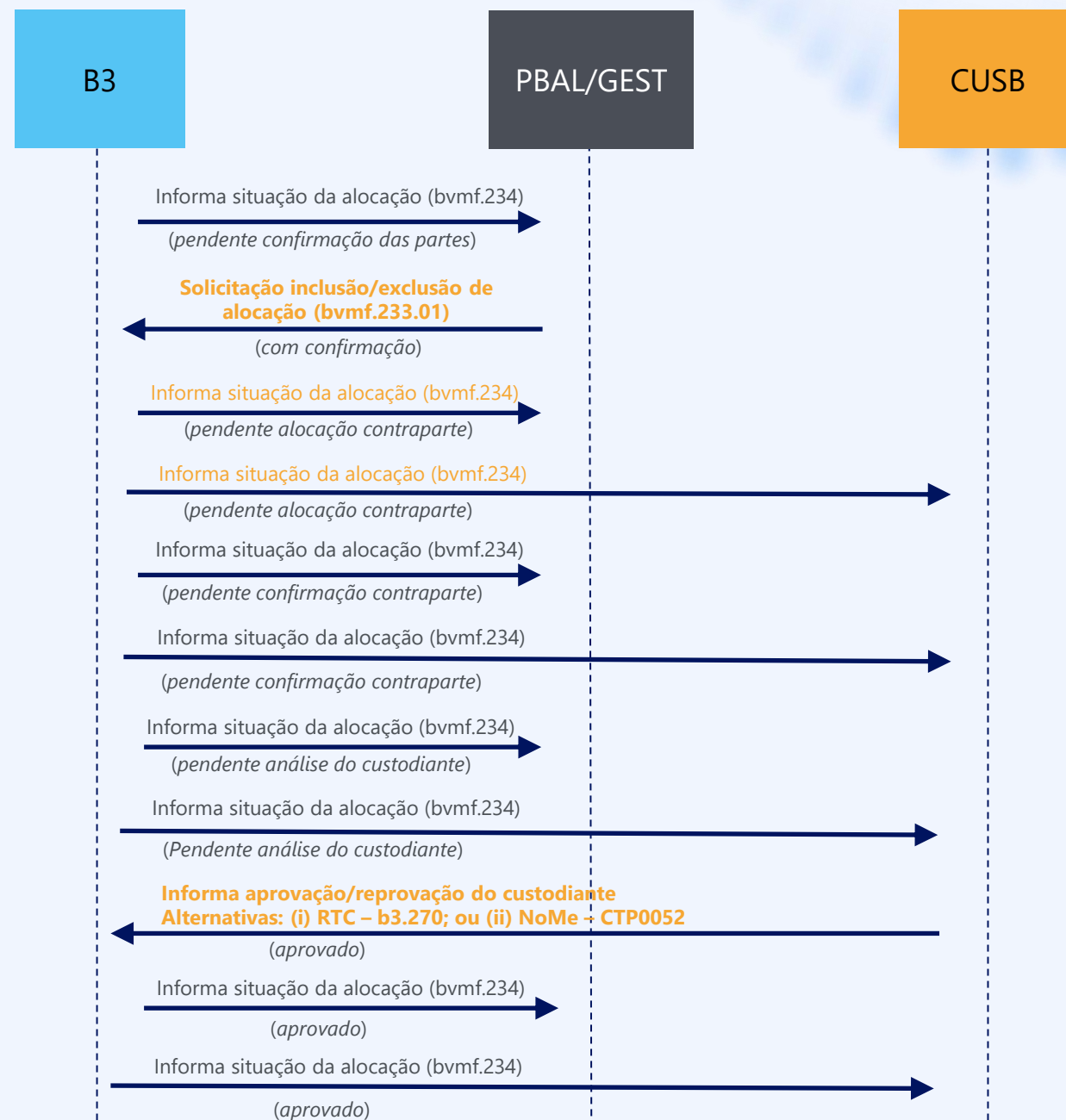
Captura do negócio

Alocação

Realocação

Conciliação

Confirmação de Custódia



Realocação

Inclusão/Exclusão de Alocação de Negócios de Renda Fixa de Balcão com Reprovação e Realocação – Títulos Privados

- O participante responsável pela alocação envia a mensagem **OTCFixedIncomeAllocationInstruction <bvmf.233.01>** à B3 para solicitar a inclusão/exclusão de alocação do negócio e informa todos os detalhes pertinentes à alocação;
- B3 envia a mensagem **AllocationInstructionStatus <bvmf.234.01>** informando ao participante responsável pela alocação/custodiante a situação da alocação solicitada;
- O Custodiante envia a mensagem **OTCFixedIncomeAllocationAcceptanceOrRejection <b3.270.01>** ou **CTP0052** informando à B3 a aprovação ou reprovação da indicação de custódia;
- O participante responsável pela alocação envia a **OTCFixedIncomeRelocationInstruction <b3.271.01>** à B3 solicitando a realocação do negócio.

Neste exemplo:

- Participante A fez a alocação;
- Participante B fez a alocação;
- Participante A faz a realocação;
- Custodiante Y aprovou a alocação do participante A;
- Custodiante Z aprovou a alocação do participante B.

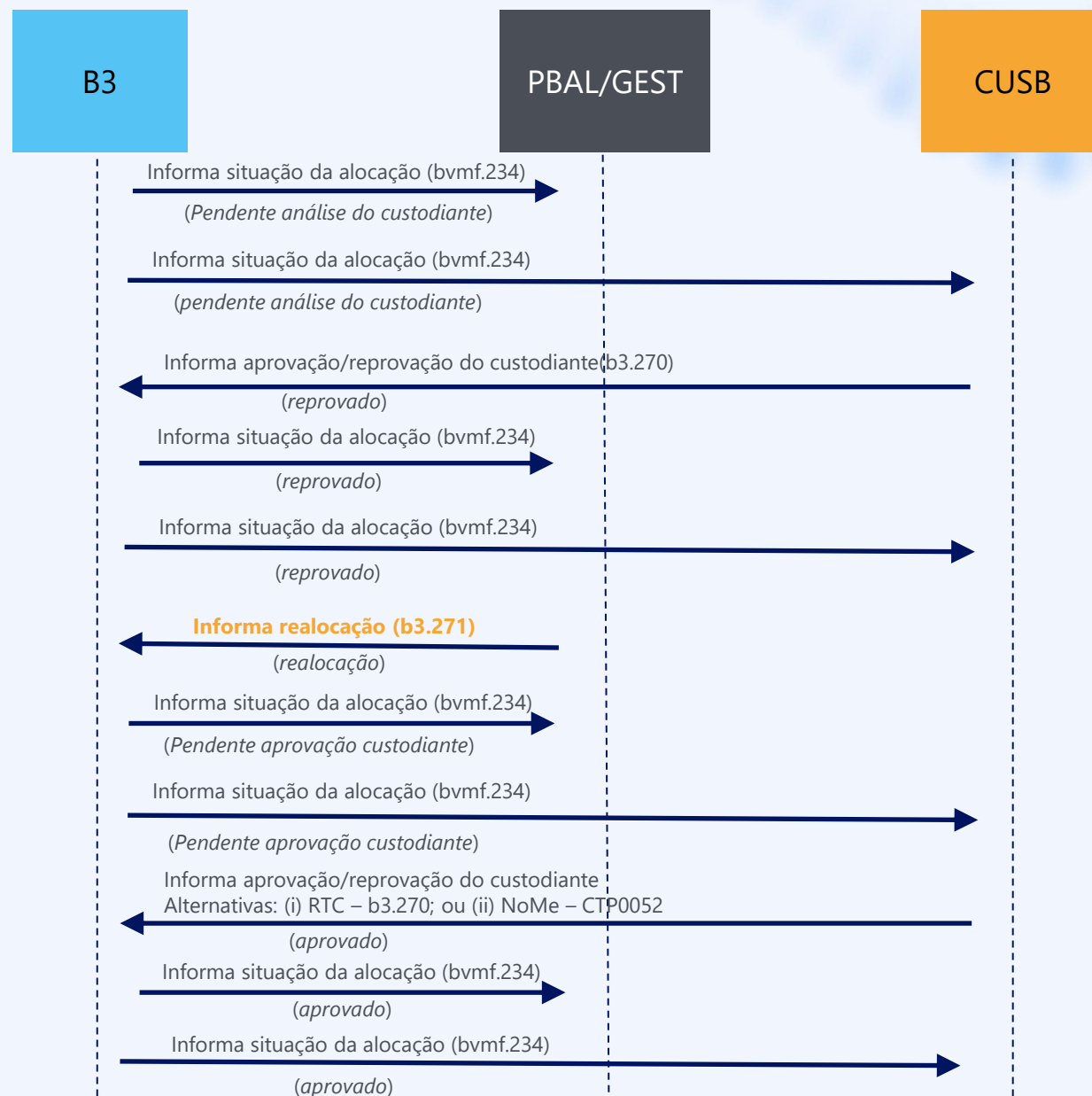
Captura do negócio

Alocação

Realocação

Conciliação

Confirmação de Custódia



Conciliação

Captura do negócio

Alocação

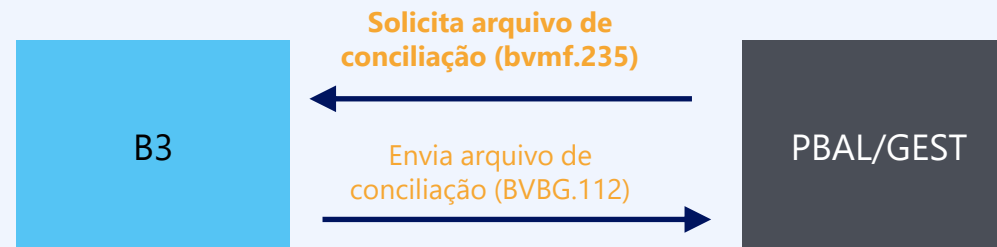
Realocação

Conciliação

Confirmação de Custódia

Participante solicita arquivo de conciliação

- O participante responsável pela alocação ou Custodiante envia a mensagem **OTCFixedIncomeReconciliationAllocationRequest <bvmf.235.02>** requisitando o arquivo de conciliação;
- B3 envia o arquivo **OTCFixedIncomeAllocationDetailsReport <bvbg.112.01>** ao participante responsável pela alocação ou Custodiante.

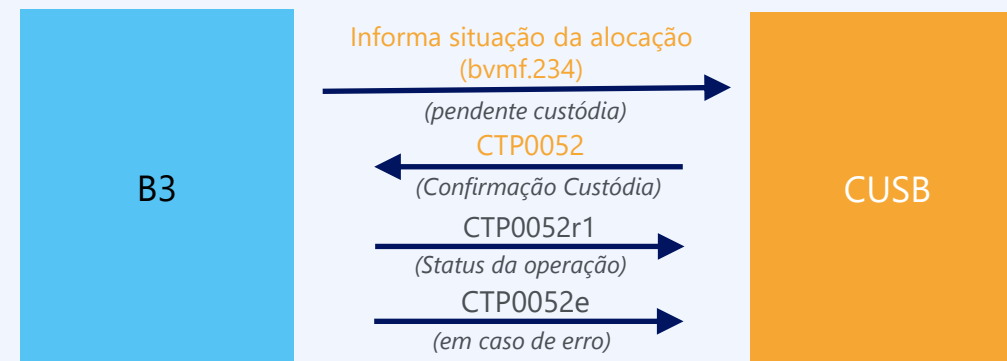


Confirmação da Custódia via Depositária – NoMe

Alternativa 1

Participante confirma a custódia via Depositária (NoMe)

- O participante responsável pela alocação (PBAL) ou Custodiante (CUSB) necessitarão capturar o número de controle da mensagem **bvmf.234** para aceitar ou rejeitar a custódia
- O participante responsável pela alocação ou Custodiante envia a mensagem **CTP0052** para solicitar o registro da operação, com o número gerado pelo RTC (**bvmf.234**)
- O Participante pode também confirmar a operação através do arquivo LCOP ou pelo Conecta
- Caso opte pela **CTP0052**, o participante receberá atualização do status da operação via **CTP0052r1**, onde conseguirá acompanhar a operação até a liquidação (o que não é possível com a bvmf.234)



Captura do negócio

Alocação

Realocação

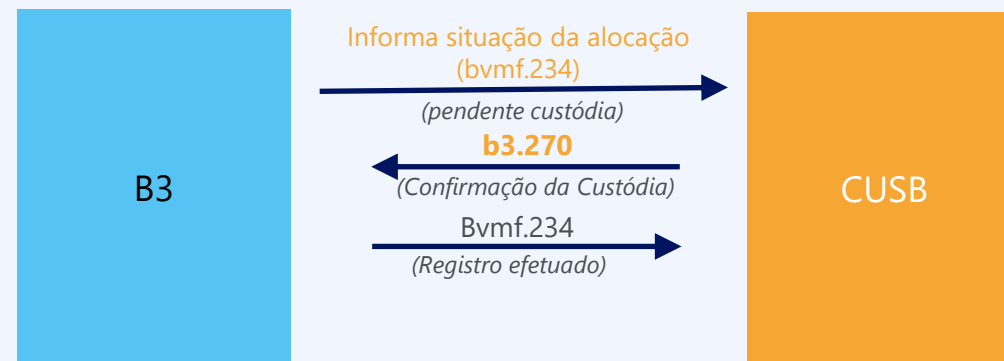
Conciliação

Confirmação de Custódia

Confirmação da Custódia via RTC

Participante confirma a custódia via RTC

- O participante responsável pela alocação (PBAL) ou Custodiante (CUSB) necessitarão capturar o número de controle da mensagem **bvmf.234** para aceitar ou rejeitar a custódia
- O participante responsável pela alocação ou Custodiante envia a mensagem **b3.270** para solicitar o registro da operação, com o número gerado pelo RTC (**bvmf.234**)
- Caso opte pela **b3.270**, o participante receberá atualização do status da operação via **bvmf.234**, onde conseguirá acompanhar que a operação está "disponível para registro", mas não consegue acompanhar se teve algum tipo de falha na liquidação ou mesmo se o contrato foi liquidado



Captura do negócio

Alocação

Realocação

Conciliação

Confirmação de Custódia



Obrigado

Vendas Especializadas

Tel: (11) 2565 7464

Produtos de Renda Fixa

produtosrendafixa@b3.com.br

Site clientes B3

https://clientes.b3.com.br/pt_br/roadmap/sobre/solucao-de-pos-negociacao-de-renda-fixa-fluxo-titulos-privados.htm