



15 de outubro de 2024
058/2024-VNC

COMUNICADO EXTERNO

Participantes do Listado B3

Ref.: **Nova métrica agregada de Risco de Mercado para Negócios (RMKTN) no LiNe Clearing**

Em continuidade à evolução dos sistemas de risco de pré-negociação, informamos que o sistema LiNe Clearing contará com nova métrica agregada, o Risco de Mercado para Negócios (RMKTN).

O RMKTN tem como objetivo mitigar o incremento de risco gerado pelo conjunto de negócios realizados ao longo do dia em comparação ao risco da carteira de abertura de determinado comitente.

A atribuição de limites a essa nova métrica será obrigatória no nível do documento (CPF, CNPJ ou código CVM para investidores não residentes) e sua configuração é de responsabilidade do participante de negociação, participante de negociação pleno ou participante de liquidação por ele responsável. A violação da métrica, ou a ausência de definição de limite, implicará o acionamento do modo protegido e o cancelamento de todas as ordens em aberto no livro.

Como forma de explicar o funcionamento, bem como outras características dessa nova métrica, a B3 realizará, através da TV B3 (www.tvb3.com.br), workshop



058/2024-VNC

técnico em português e inglês, respectivamente, nos dias **24/10/2024** às 15h e **25/10/2024** às 11h, horário de Brasília.

Nessas datas, serão disponibilizadas informações técnicas, regras para monitoramento dos limites atribuídos à nova métrica, bem como os próximos passos para a implementação em produção. Essas informações também estarão disponíveis futuramente nos manuais disponibilizados pela B3 em data a ser oportunamente divulgada.

O RMKTN já está disponível para o mercado para testes no ambiente de certificação. A certificação não é obrigatória, porém é recomendável e poderá ser agendada com Certificação Listados, pelo telefone (11) 2565-5023 ou e-mail tradingcertification@b3.com.br.

As datas de lançamento em produção do Risco de Mercado para Negócios serão divulgadas oportunamente por meio de Ofício Circular.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Central de Atendimento de Riscos pelo telefone (11) 2565-5030 ou e-mail gmr@b3.com.br.

Mario Palhares

Vice-Presidente de Operações – Negociação Eletrônica e CCP