



Pós negociação de Renda Fixa

Apresentação do Produto



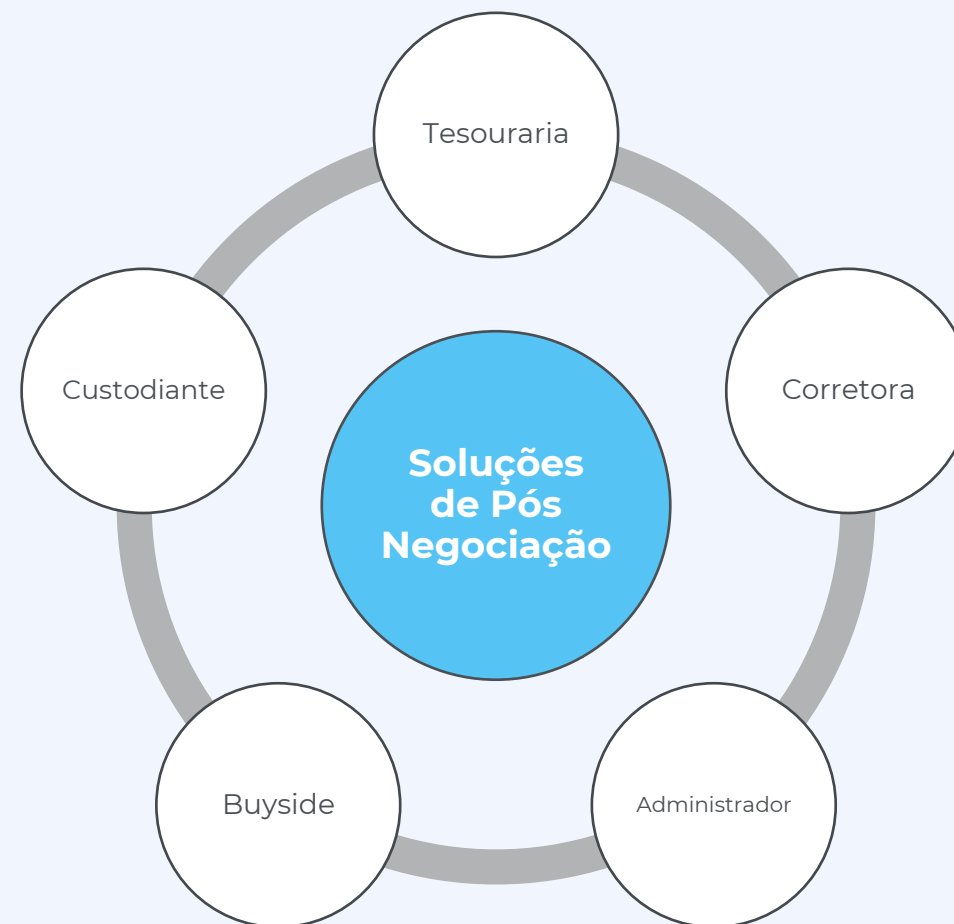
Resumo do Produto

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

Solução de Pós negociação Renda fixa

Resumo do Produto (cont.)

Fluxo I	<p>Plataforma B3 TRADER</p> <p>Pós Negociação B3 (RTC)</p> <p>SELIC</p> <p>TÍTULOS PÚBLICOS</p>	<p>Volume do Mercado (dia)</p> <p>R\$ 14bi +400 trades</p>	<p>Status</p> <p>Concluído</p>	<p>Data de Entrega</p> <p> 14/dez/20</p>
Fluxo II	<p>Plataforma B3 TRADER</p> <p>Pós Negociação B3 (RTC)</p> <p>Depositária B3 (NoMe)</p> <p>TÍTULOS PRIVADOS (Debêntures, CRI, CRA, CFF)</p>	<p>Volume do Mercado (dia)</p> <p>R\$ 3,5bi +9.000 trades</p>	<p>Status</p> <p>Concluído</p>	<p>Data Data de Entrega</p> <p> 04/mai/22</p>
Fluxo III	<p>Balcão</p> <p>Pós Negociação B3 (iMercado)</p> <p>SELIC</p> <p>TÍTULOS PÚBLICOS</p>	<p>Volume do Mercado (dia)</p> <p>R\$ 90bi +6.000 trades</p>	<p>Status</p> <p>Concluído</p>	<p>Data de Entrega</p> <p> 27/set/21</p>
Fluxo IV	<p>Balcão</p> <p>Pós Negociação B3 (iMercado)</p> <p>Depositária B3 (NoMe)</p> <p>TÍTULOS PRIVADOS (LF, LFSC, LFSN)</p>	<p>Volume do Mercado (dia)</p> <p>R\$ 1bi +500 trades</p>	<p>Status</p> <p>Em estudo</p>	<p>Data Prevista</p> <p> TBD</p>

[B]³

Fluxo II

(Debenture, CRI, CRA, CFF)

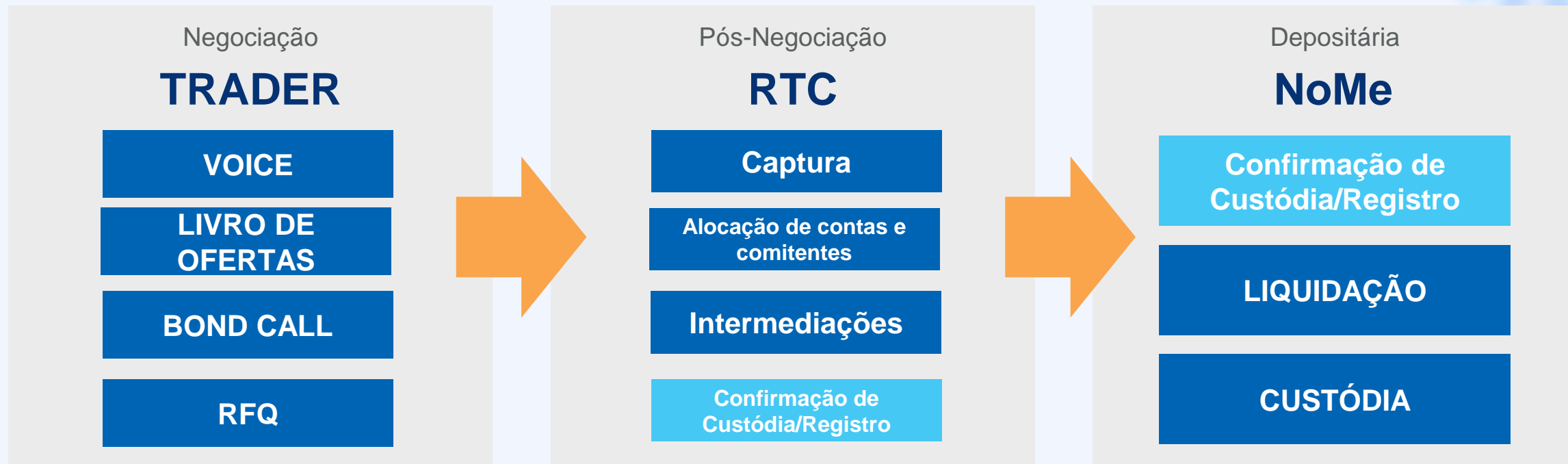
Fluxo II – Títulos Privados

Premissas do Produto

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).

Resumo do Produto



Operação	Banco Liquidante Distinto	Banco Liquidante Igual/ Operação a termo
Alocação da Operação	17:40	19:15
Confirmação de Custódia	17:40	19:15
Liquidação	17:45	19:20

[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

Formas de Conexão

Mensageria



ISO 20022

Tela RTC



Extranet

HUB Balcão



Internet

Plataforma B3
TRADER

Pós Negociação

Depositária
B3 (NoMe)

TÍTULOS PRIVADOS

(Debêntures, CRI, CRA, CFF)

PARTICIPANTES



BANCOS



CORRETORAS



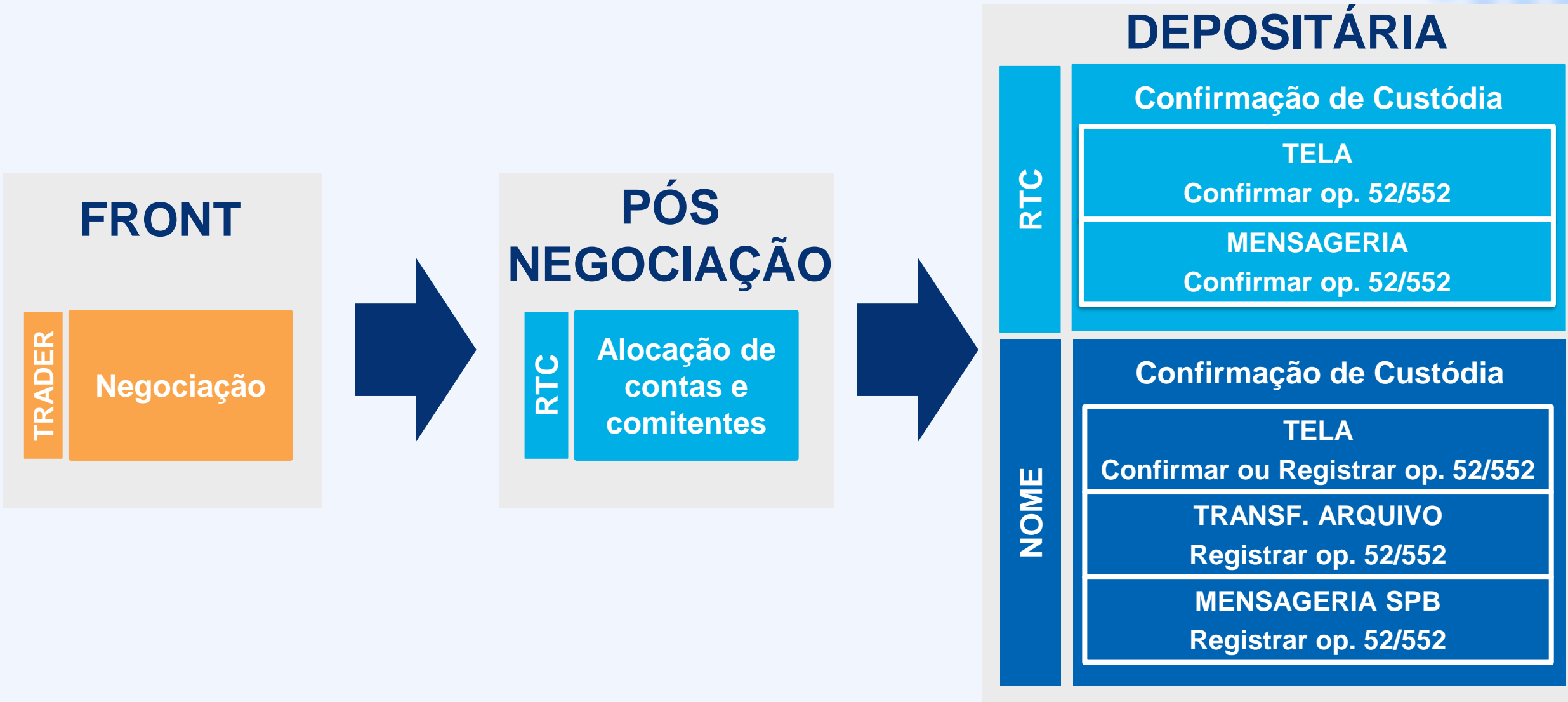
**BUY SIDE –
GESTORES/ASSETS/FUNDAÇÕES E
SEGURADORAS**



CUSTODIANTES

[B]³

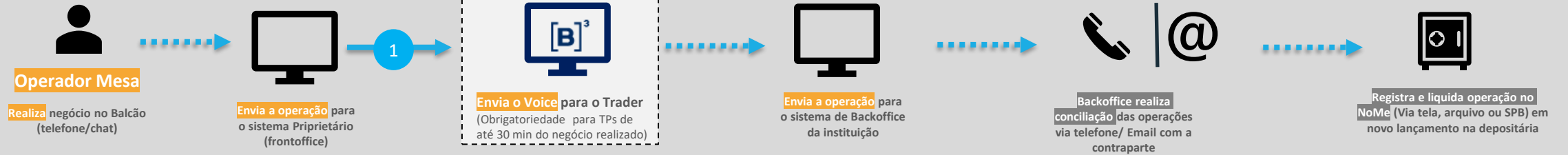
Formas de Conexão (cont.)



[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

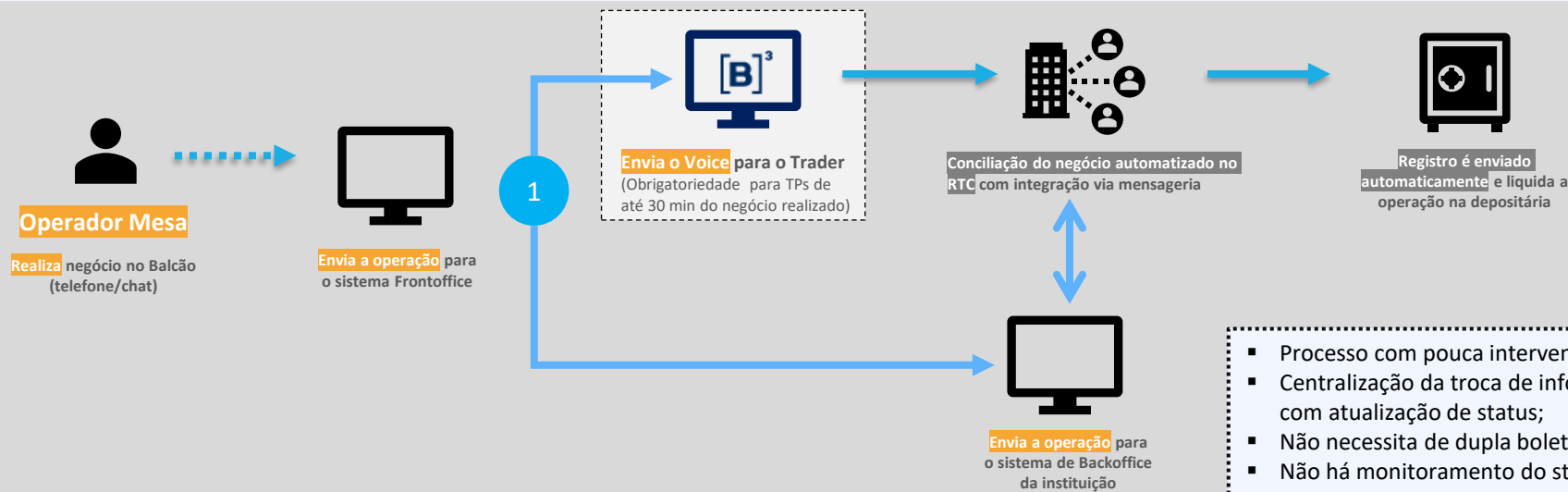
Processos de alocação: atual x proposto pela ferramenta

Operacional Atual



- Intervenção manual dos participantes: batimento da operação, quebra da boleta, alocação e dupla boletagem (negociação e depositária);
- Suscetível a erro durante o processo de quebra de alocação e registro;
- Não há monitoramento do status da operação.

Operacional com Fluxo II



- Processo com pouca intervenção manual e possibilidade de 100% automatização;
- Centralização da troca de informação entre participantes numa ferramenta e com atualização de status;
- Não necessita de dupla boletagem: porta de entrada será sempre o Trader;
- Não há monitoramento do status da operação.

[B]³

Fluxo II – Títulos Privados

Processos de alocação: atual

VENDEDOR | Banco A

Send

To |

Cc

Subject

Prezados, bom dia.

Segue dados da operação realizada hoje.

Vendedor: Banco A
Comprador: Gestor X
Papel: VALE28
Quantidade: 10
PU: R\$ 300,00
Financeiro: R\$3.000,00
Liquidação: D0

Poderia especificar a quebra?

COMPRADOR | GESTORA A

Confirmado.

Segue quebra.

Fundo Master C: 5 quantidades (conta 12345.00-1)
Fundo Master Y: 5 quantidades (conta 33333.00-2)

VENDEDOR | Banco A

Ok.

Operação 100% na minha conta própria (00123.00-9)



Registra e liquida operação no
NoMe (Via tela, arquivo ou SPB) em
novo lançamento na depositária

Com estes dados em mãos, são realizados os lançamentos na depositária:

- Banco A faz duas operações 52;
- Adm/Cust do Gestor X faz duas operações 52.

[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

Processos de alocação: proposto pela ferramenta (por tela)

TRADER | Registro de operação via Voice na plataforma Trader

Boleta de novo negócio

Voice

Ativo: QIKH4723

ISIN: BRBITAABC197 CETIP ID: QIKH4723

Liquidação: T+0

Auto Alocar Passagem Fundos Direto Generico Cpy

Compra/Venda	Contraparte	Participante	Título Privado/Público			Montante de L
			Quantidade	Taxa	Preço	
Compra	RTC 1512A2 (RTC1512ABM)	rtc1512abm_rtc1512abm	10	%	2,371234	23,71
Venda	RTC 10281 (RTC1028BM)	rtc1028bm_rtc1028bm	10	%	2,371234	23,71

Confirmar Título

Tem certeza de que deseja prosseguir?

Comprador: RTC 1512A2
Vendedor: RTC 10281
Taxa: %, Preço: 2,371234
Quantidade: 10
Montante de Liquidação: 23,71

Preço: 2,371234
Montante de Liquidação: 23,71

Sim Não

Operações Hotline: +55 11 2565 5022
Tecnologia Hotline: +55 11 2565 5021

10:59 AM

[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

Processos de alocação: proposto pela ferramenta (por tela)

TRADER | Voice confirmado por parte e contraparte: operação é enviada automaticamente para alocação no RTC

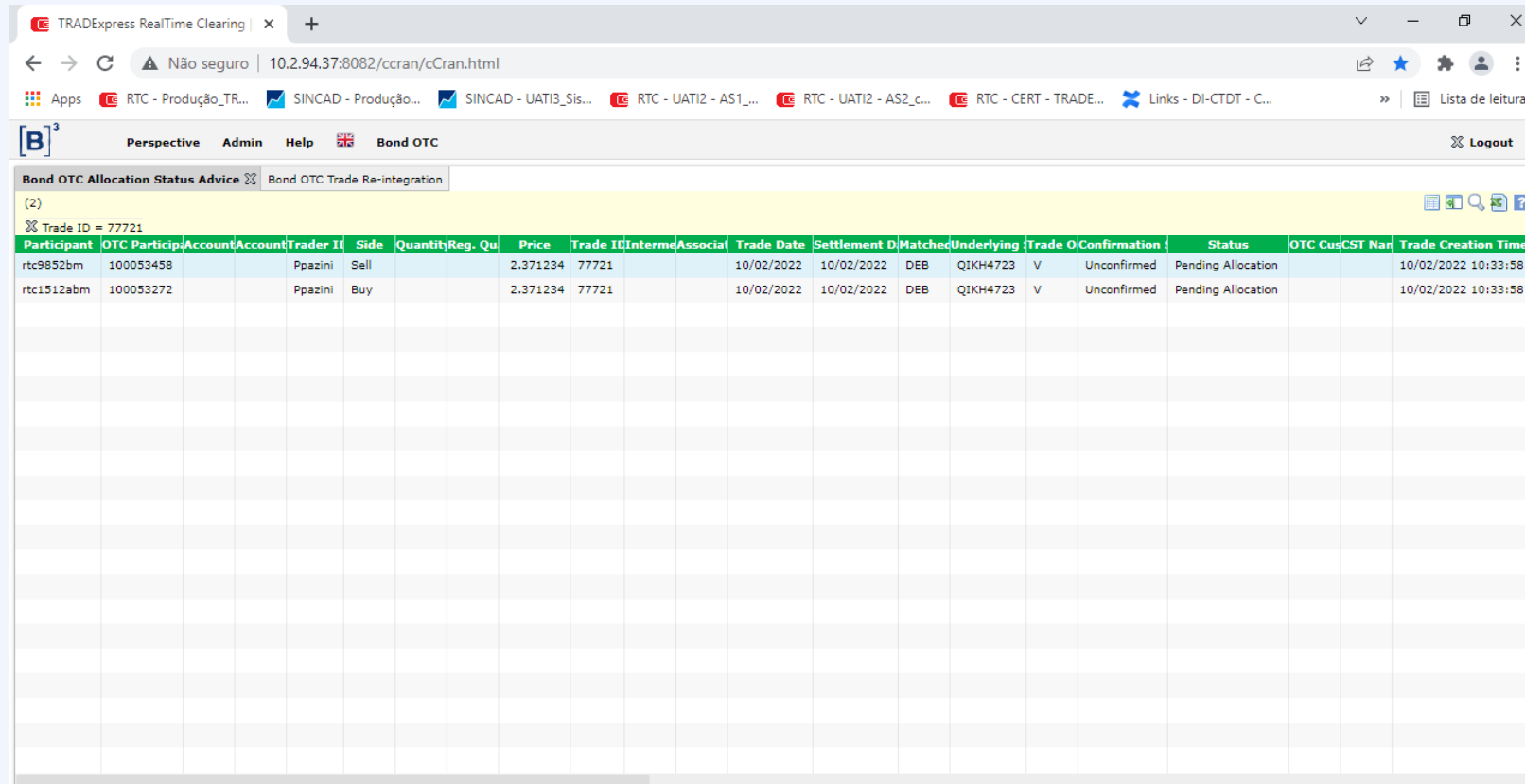
The screenshot shows the Trader application interface. At the top, there are navigation buttons like 'Todo o dia', 'Cancelar Todos', 'Live+', 'Visualização', 'Voice', and 'Route'. The main area displays a list of securities with columns for 'Título', 'Cpn', 'Prazo', 'Quantidade', 'Compra', 'Venda', 'Negócio', and 'Quantidade'. Below the list, there is a detailed view of a transaction for 'QIKH4723 2,5 Nov-22' at a price of 2,371234. The interface also shows a status bar at the bottom with contact information and system icons.

The screenshot shows the 'Blotter de Negócios' window. It displays a list of transactions with columns for 'Data', 'Título', 'Nível', 'Quantidade', 'Montante de Liquidação', 'Comprador', 'Vendedor', 'Comentário', 'STP', 'Mercado', 'Negócio ID', 'Prazo do Negócio', 'Preço', and 'Taxa'. A specific transaction is highlighted: '11:02 AM QIKH4723 2,5 Nov-22 2,371234 10 23,71 RTC1512ABM - R- RTC1028BM - R- 10282 151282 / 10282'. Below the list, there is a detailed view of the transaction, including the 'Bilhete de negócio' and 'Comentário'.

[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

Processos de alocação: proposto pela ferramenta (por tela)

RTC | Negócio é capturado pelo RTC e cada participante verá apenas o lado correspondente da sua operação



The screenshot displays a web browser window with the URL 10.2.94.37:8082/ccran/cCran.html. The interface includes a navigation bar with 'Perspective', 'Admin', 'Help', and 'Bond OTC' options. Below this, there are tabs for 'Bond OTC Allocation Status Advice' and 'Bond OTC Trade Re-integration'. The main content area shows a table with the following data:

Participant	OTC Particip	Account	Account	Trader ID	Side	Quantity	Reg. Qu	Price	Trade ID	Interme	Associa	Trade Date	Settlement D	Matched	Underlying	Trade O	Confirmation	Status	OTC Cus	CST Nar	Trade Creation Time
rtc9852bm	100053458			Ppazini	Sell			2.371234	77721			10/02/2022	10/02/2022	DEB	QIKH4723	V	Unconfirmed	Pending Allocation			10/02/2022 10:33:58
rtc1512abm	100053272			Ppazini	Buy			2.371234	77721			10/02/2022	10/02/2022	DEB	QIKH4723	V	Unconfirmed	Pending Allocation			10/02/2022 10:33:58

[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

Processos de alocação: proposto pela ferramenta (por tela)

RTC | Alocação - Participante comprador clica com o botão direito do mouse e seleciona a opção **OTC Trade Allocations**

The screenshot displays the TRADExpress RealTime Clearing interface. The main window shows a table titled "Bond OTC Allocation Status Advice (1)" with a context menu open over the first row. The table columns include Participant, OTC Participant, Trader ID, Account, Account, Side, Quantity, Reg. Qu, Price, Trade ID, Interme, Associa, Matched, Trade Date, Trade Creation Time, Settlement D, and Underlyin. The first row contains: rtc1512abm, 100053272, Ppazini, Buy, 2,371234, 77721, DEB, 10/02/2022, 10/02/2022 10:33:58, 10/02/2022, QIKH472.

The context menu options are:

- Bond OTC Allocation Status Advice Details
- OTC Trade Allocations
- Include Intermediation - Single Trade
- Re-allocate...
- Update Open Text Values
- Filter by Value

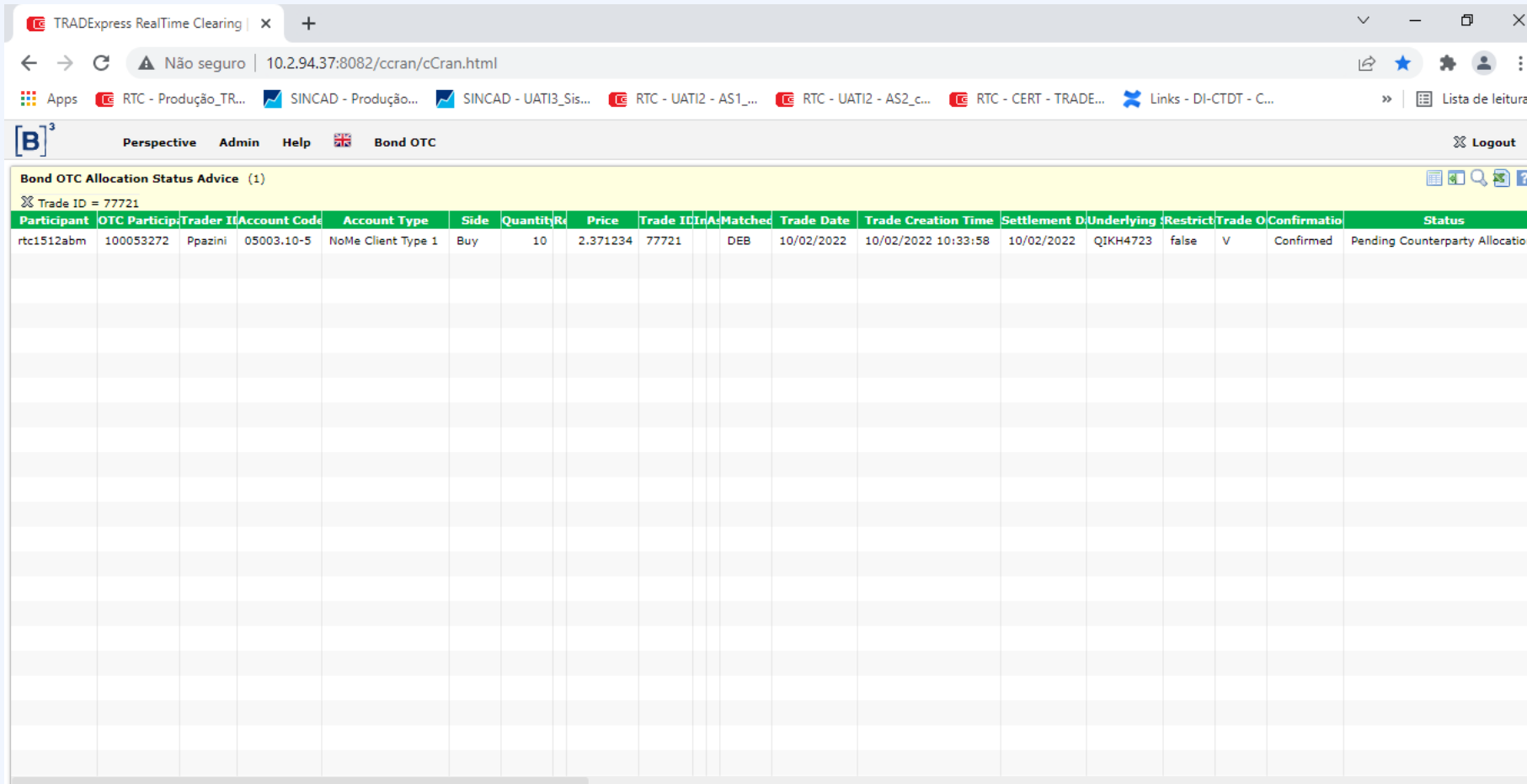
The "OTC Trade Allocations" modal window is open, showing the following details:

- Allocation Context:** Allocation ID: 77721, Trade Date: 10/02/2022, Buy (selected), Allocation Type: Inclusion, Allocations are final:
- Open Text:** Open Text Message 1, 2, 3, 4 (empty text boxes)
- Allocation Entries:** Account Code: 05003.10-4, Allocated Quantity: 10, Link Type, Link Date of Origin, Link Id, Firm Guarantee, Blocked Asset, Blocked Asset Id, Buyer Type CBIO, Buyer descr. CBIO, Final Investor Allocations: Empty...

[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

Processos de alocação: proposto pela ferramenta (por tela)

RTC | Será possível visualizar o status da alocação. Se a operação está confirmada, alocada e o status da contraparte do negócio



The screenshot displays a web browser window with the URL 10.2.94.37:8082/ccran/cCran.html. The browser's address bar shows "NÃO seguro" (Not secure). The page title is "TRADEExpress RealTime Clearing". The interface includes a navigation menu with "Perspective", "Admin", "Help", and "Bond OTC". A "Logout" button is visible in the top right corner. The main content area is titled "Bond OTC Allocation Status Advice (1)" and displays a table with the following data:

Participant	OTC Participant	Trader ID	Account Code	Account Type	Side	Quantity	Price	Trade ID	In Arrears	Matched	Trade Date	Trade Creation Time	Settlement Date	Underlying	Restricted	Trade Order	Confirmation	Status
rtc1512abm	100053272	Ppazini	05003.10-5	NoMe Client Type 1	Buy	10	2.371234	77721		DEB	10/02/2022	10/02/2022 10:33:58	10/02/2022	QIKH4723	false	V	Confirmed	Pending Counterparty Allocation

[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

Processos de alocação: proposto pela ferramenta (por tela)

RTC | Após a alocação e confirmação de alocação de ambos os lados da operação, esta operação é enviada para a depositária (NoMe)

TRADEExpress RealTime Clearing | x +

Não seguro | 10.2.94.37:8082/ccran/cCran.html

Apps RTC - Produção_TR... SINCAD - Produção... SINCAD - UAT13_Sis... RTC - UAT12 - AS1... RTC - UAT12 - AS2_c... RTC - CERT - TRADE... Links - DI-CTDT - C... Lista de leitura

[B]³ Perspective Admin Help Bond OTC Logout

Bond OTC Allocation Status Advice (1)

Trade ID = 77721

Account Code	Account Type	Side	Quantity	Reg. Qu	Price	Trade ID	Interme	Associa	Matched	Trade Date	Trade Creation Time	Settlement D	Underlying	Restrict	Trade O	Confirmatio	Status	OTC Custodia	Interest Ra
05003.10-5	NoMe Client Type 1	Buy	10	10	2.371234	77721			DEB	10/02/2022	10/02/2022 10:33:58	10/02/2022	QIKH4723	false	V	Confirmed	Allocation Complete	100043280	104.12300%

Bond OTC Allocation Status Advice (1)

Trade ID = 77721

Confirmatio	Status	OTC Custodia	Interest Rate	Control Number	Associa	Original	Open Te	Open Te	Open Te	Open Te	Counter	Counter	Counterpart - Participa	Counterpart	Counterpart	Underly	Final Inv Docume	Final In	Econom	Orig
Confirmed	Allocation Complete	100043280	104.12300%	40001							9852	57	rtc9852bm_rtc9852bm	100053458	05086.00-5	0	405.831.848-12	10	PJ	

Trade ID = 77721

Final In	Econom	Original	Maturity	Settlem	Traded	Self Allo	Desk ID	Desk Pa	Desk Pa	Desk Party ID	Text	Account	Account Name	CST Name	CST Par	CST Par	Document ID	Reg. Status
10	PJ	10	24/11/2022	1	23.71	No	rtc1512abm	1512	PBAL	rtc1512abm_rtc1512abm		NoMe	cadastro-api-participante_2021	rtc1512abm	CUSB	1512	25335604000110	Pending CST Confirmation

[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

Processos de alocação: proposto pela ferramenta (por tela)

NoMe | Consulta da operação alocada pelo RTC na tela de Alocação e Registro RTC

Browser: Não seguro | https://nomeint.cetip.net.br/menu/ctp/TelaPrincipalCetip21

[B] NoMe - Novo Mercado

CETIP, PP1527 Saír

TAXA DI 10,64 (21/10)

ÍNDICE DI 12.028,05 (08/09)

HORÁRIO 09:32:30

Títulos e Valores Mobiliários > Cadastramento de Operações > Alocação e Registro - RTC

INTEGRAÇÃO

Alocação e Registro - RTC

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)
Data e Hora da Consulta: 02/02/2022 - 09:32:26

i Critério de pesquisa

Ação	Código IF	Tipo IF	Data da Liquidação	Código Operação	PU da Negociação	Parte Tipo Comprador/Vendedor	Código da Conta	Quantidade da Alocação	Meu Número	Status	CPF/CNPJ	Contraparte Tipo Comprador/Vendedor	Código da Conta
▼	QIKH4723	DEB	02/02/2022	52	2,37123400	COMPRADOR	05003.10-5	10,00000000	40002	PENDENTE CONF. CUSTODIA PARTES	405.831.848-12	VENDEDOR	05086.00-5
▼	QIKH4723	DEB	02/02/2022	52	2,37123400	VENDEDOR	05086.00-5	10,00000000	40002	PENDENTE CONF. CUSTODIA PARTES		COMPRADOR	05003.10-5

Atualizar Voltar

« 1 Exibir página »

Obter no formato: Excel

b.220201.1839

[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

Processos de alocação: proposto pela ferramenta (por tela)

RTC | Aprovação da custódia pelo RTC (pode ser feita pelo NoMe também)

The screenshot displays a web application interface for Bond OTC Allocation Status Advice. The browser address bar shows the URL 10.2.94.37:8082/ccran/cCran.html. The application header includes the [B]³ logo and navigation links for Perspective, Admin, Help, and Bond OTC. A 'Logout' button is also present.

The main content area features a table with columns: Participant, OTC Participant, Trade Account Code, Account Type, Side, In/As, Quan, Reg., Price, Trade ID, Match, Trade Date, Trade Creation Time, Settlement D, Underlying, Restrict, Tra, Confirmation, Status, Reg. Status, OTC Custodia, and Control IA. Two rows of trade data are visible, both with Trade ID 77721.

An 'Approve...' modal dialog box is open, displaying the following details:

- Common:**
 - Allocation ID: 77721
 - Trade Date: 02/02/2022
 - Control Number: 40002
 - Account Code: 05003.10-5
 - Trade Side: * Buy and Sell
- Instrument:**
 - Security ID: 101
 - Security Exchange: BVMF
 - Security ID Source: 8
 - Maturity: 24/11/2022
 - Restriction: -
 - Instrument Code: 0






The dialog box includes 'Submit' and 'Cancel' buttons at the bottom.


The footer of the application shows: Bond OTC Management - User: P-VALERISILVA BVMF CH - Business Date: 2022-02-02 - System Version: 2.22.1. The time is 09:36:40 and the Cinnober logo is visible.




[B]³ Fluxo II – Títulos Privados

Processos de alocação: proposto pela ferramenta (por tela)

NoMe | Consulta da operação após a confirmação pelo RTC

← → ↻ Não seguro | <https://nomeint.cetip.net.br/menu/ctp/TelaPrincipalCetip21>     

[B]³ NoMe - Novo Mercado  Contato

 CETIP, PP1527 [Sair](#) \$ TAXA DI 10,64 (21/10)  ÍNDICE DI 12.028,05 (08/09)  HORÁRIO 09:39:18

☰ > Operações > Consultas > Operações INTEGRAÇÃO

o	Tipo Operação	CV	Tipo Compra/Venda	Título	Código IF Anterior	Tipo Título	Tipo de Regime	Eventos Cursados pela Cetip?	Data Emissão	Data Vencimento	Quantidade	PU	Valor	Tx Colocação	Sistema	Modalidade Liquidação	Status	Número Operação
	COMPRA/VENDA DEFINITIVA/CESSAO	COMPRADOR	PROPRIA LIVRE	QIKH4723		DEB	DEPOSITADO	SIM	18/10/2021	24/11/2022	10,00000000	2,37123400	-23,71		CETIP21	Bruta STR	PENDENTE DE LIQUIDACAO FINANCEIRA	40002
	COMPRA/VENDA DEFINITIVA/CESSAO	VENDEDOR	PROPRIA LIVRE	QIKH4723		DEB	DEPOSITADO	SIM	18/10/2021	24/11/2022	10,00000000	2,37123400	23,71		CETIP21	Bruta STR	PENDENTE DE LIQUIDACAO FINANCEIRA	40002



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