

[B]³

Workshop

- **Captura em Bloco**
- **Soluções para Netting na Conta Erro**

DO - GACP

10.05.22

.

[B]³

Captura em Bloco – RTC



Captura em Bloco

Características Gerais

Agregação de negócios similares, através de uma chave básica, em certos intervalos de tempo a serem parametrizados, gerando um bloco de negócios com a informação consolidada de quantidade.

- ✓ Escopo inicial:
 - Mini Contratos
 - Conexão automatizada
 - Alocação em cliente final

- ✓ Solução será flexível o bastante para parametrizar participantes, contas e instrumentos que poderão participar do processo de agregação de negócio.

- ✓ Chave básica:
 - Participante
 - Data do Pregão
 - Conta informada na negociação
 - Instrumento
 - Origem do negócio (Sender Location)
 - Natureza da operação
 - Preço

- ✓ Criação do bloco será determinada por tempo ou quantidade máxima de negócios.

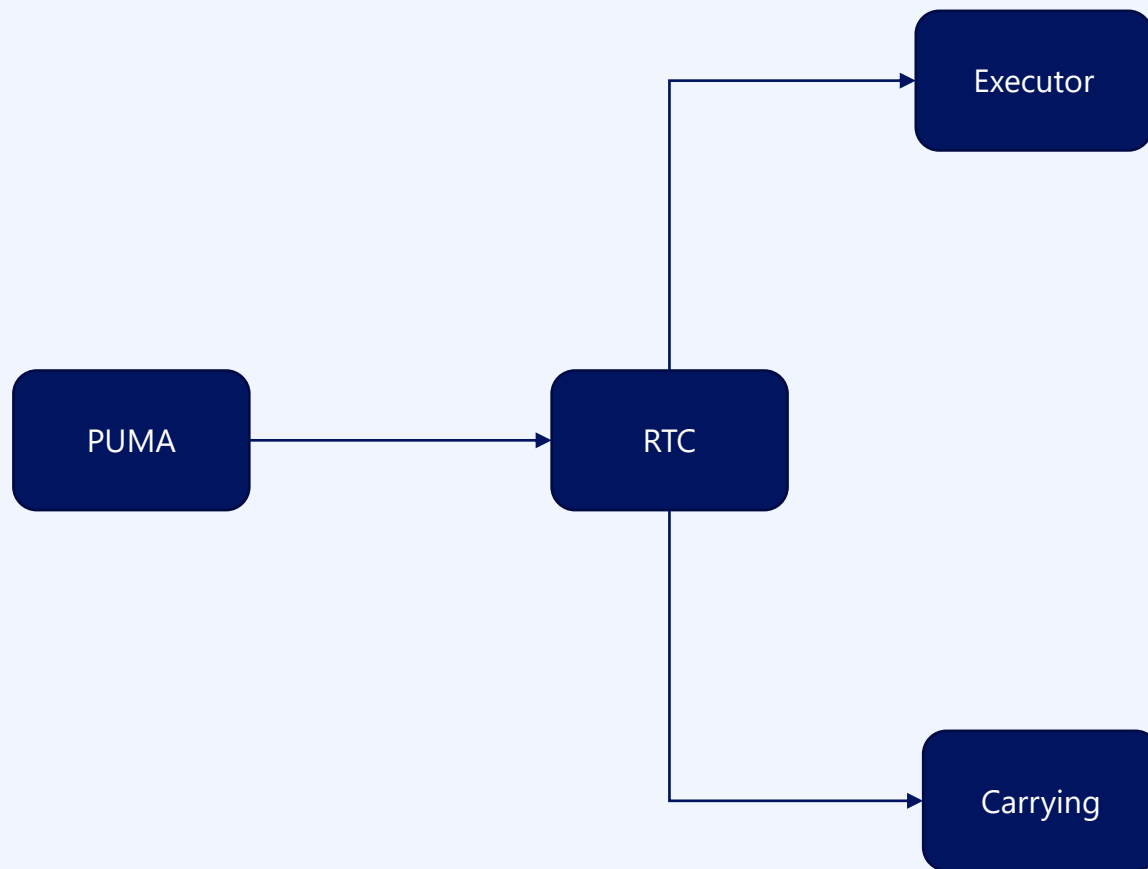
Características Gerais

Um bloco de negócios será transformado em um único negócio consolidado e será tratado de forma semelhante a qualquer outro negócio da plataforma, não gerando alterações mandatórias em mensagens e arquivos existentes, apenas com a criação de uma nova mensagem de captura com o detalhamento dos negócios no bloco.

- ✓ Mensagens e arquivos atuais não sofrerão alterações mandatórias.
- ✓ Dentro do RTC o negócio será tratado da mesma forma que um negócio regular.
- ✓ Uma nova mensagem de bloco será disponibilizada e então o participante poderá fazer sua conciliação.
- ✓ Como não haverá informação de negócio a negócio, a conciliação será feita no nível de bloco.
- ✓ O bloco terá um ID para identificação. O range desse ID não será o mesmo utilizado para os negócios individuais.

Captura em Bloco

Fluxo



- RTC continua enviando a mensagem de captura e de repasse negócio a negócio para os negócios não agrupados e para blocos.
- RTC envia msg. de bloco com a informação de neg. a neg. para os participantes manterem a rastreabilidade de negócios em blocos.

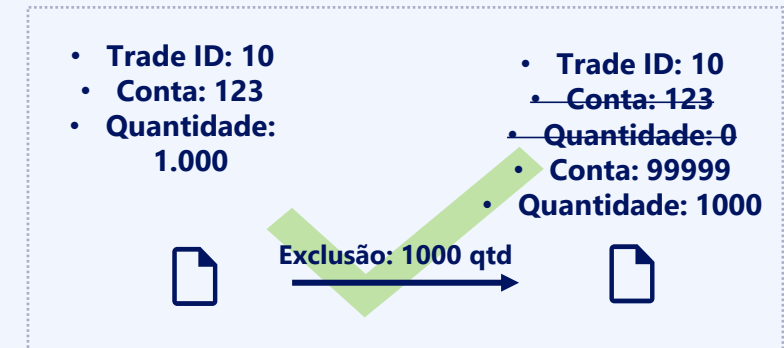
Captura em Bloco

Alocação de Negócios

✓ Como qualquer negócio oriundo de sessão automatizada, a troca entre contas de mesma titularidade não é permitida.



✓ Uma nova inclusão de alocação somente é permitida se for troca entre contas de mesma titularidade.



✓ O bloco alocado em conta final poderá ser excluído para conta erro padrão, porém não é permitido excluir parcialmente.

Captura em Bloco

Cancelamento de Negócios

- ✓ PUMA envia cancelamento de negócio para o RTC.
- ✓ O RTC identifica o bloco que contém o negócio e realiza o cancelamento do bloco. A mensagem bvmf.017 é enviada para todos os participantes envolvidos no cancelamento.
- ✓ Bloco é refeito desconsiderando o negócio que foi cancelado.
- ✓ Um novo número de bloco será gerado. Nas informações do novo bloco, será enviado o número do bloco antigo e o número do novo bloco, para que seja possível associar.

Captura em Bloco

Arquivos e Mensagens

✓ Criação de uma nova mensagem:

- Modelo FIX
- TradeCaptureCompression

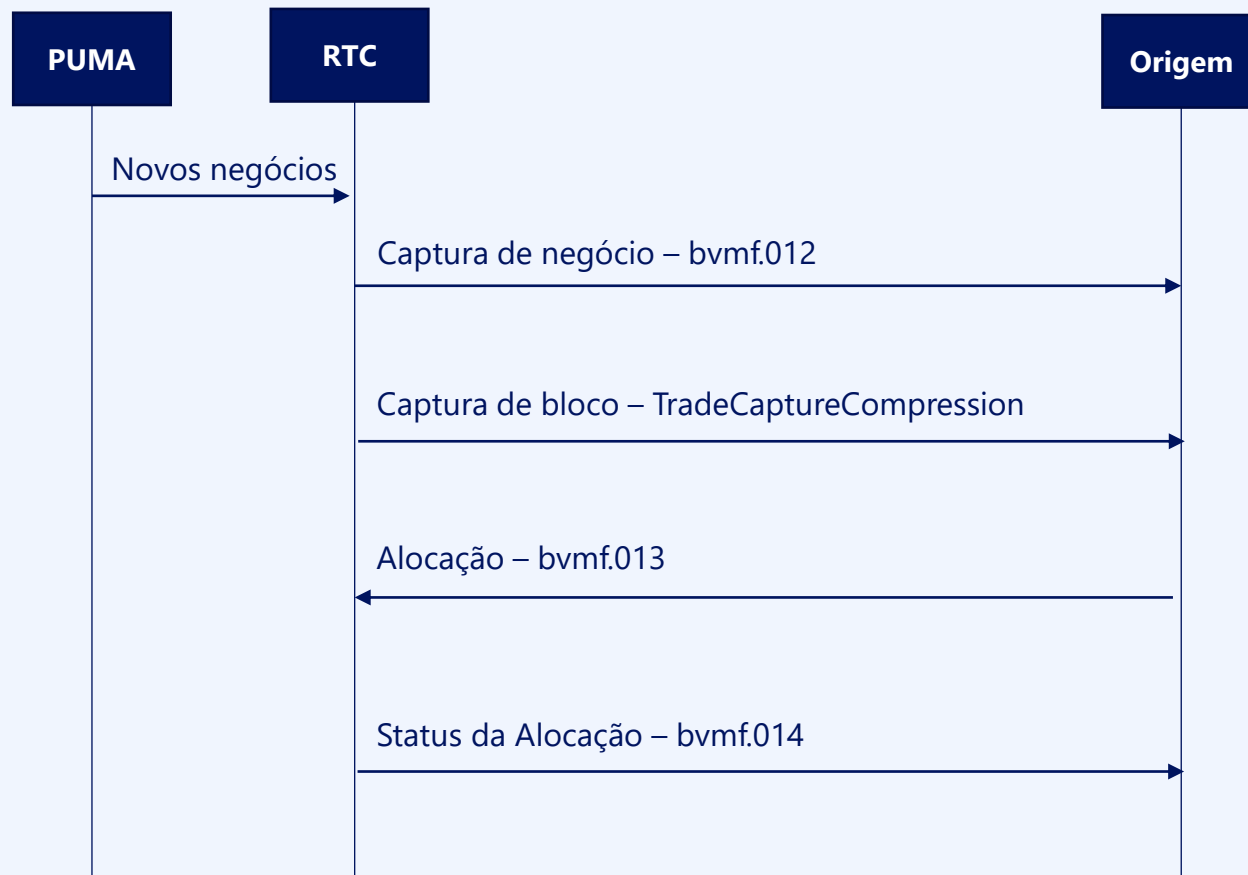
✓ Criação de um novo arquivo:

- Modelo ISO
- BVBG.139.01 (b3.277.01)

✓ Alteração, campo opcional, nas mensagens e arquivos:

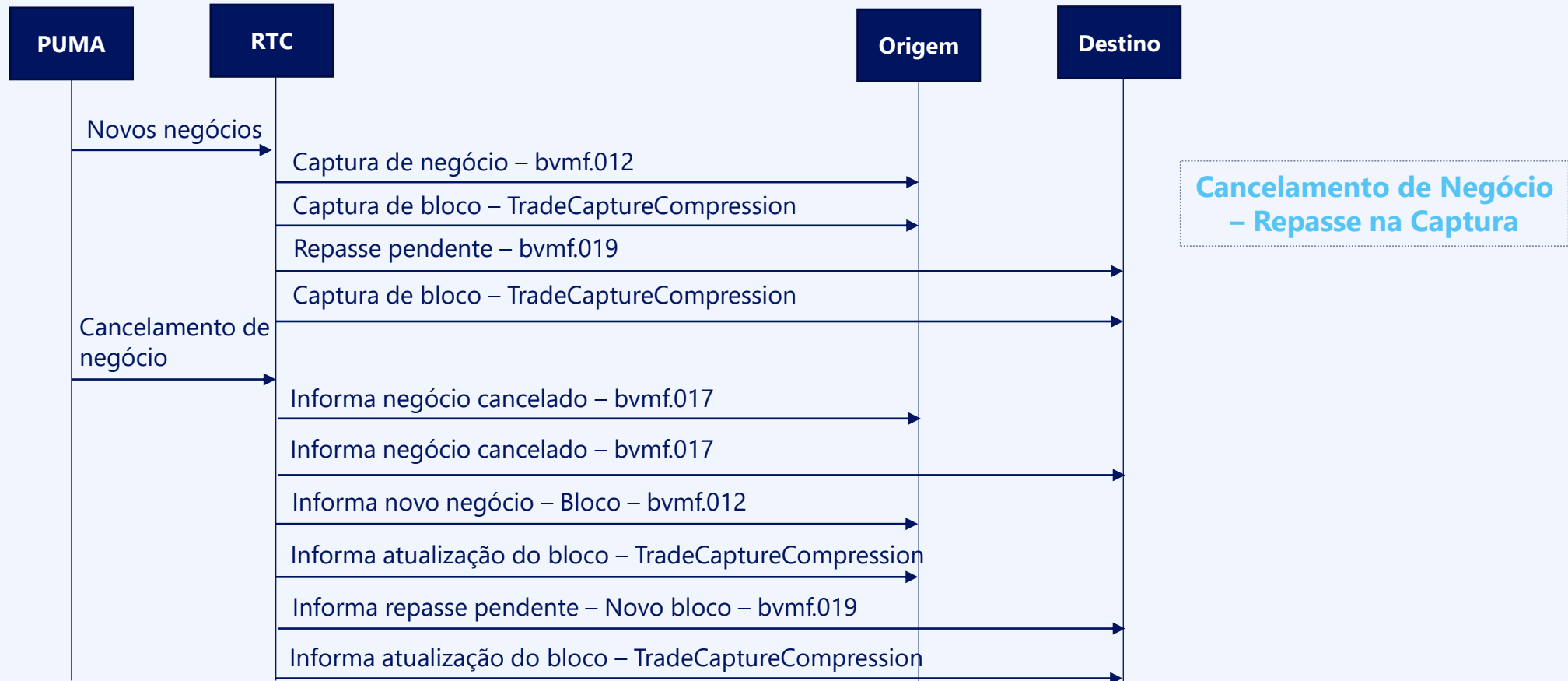
- BVBG.012 – CompressionGroupIndicator
- bvmf.012 – CompressionGroupIndicator
- bvmf.014 – CompressionGroupIndicator
- bvmf.017 – CompressionGroupIndicator
- Bvmf.018 – Inclusão de domínio – 5-Compression Trades
- bvmf.019 – CompressionGroupIndicator
- BVBG.013 – CompressionGroupIndicator
- BVBG.014 – CompressionGroupIndicator
- BVBG.015 – CompressionGroupIndicator
- BVBG.045 – CompressionGroupIndicator

Exemplos



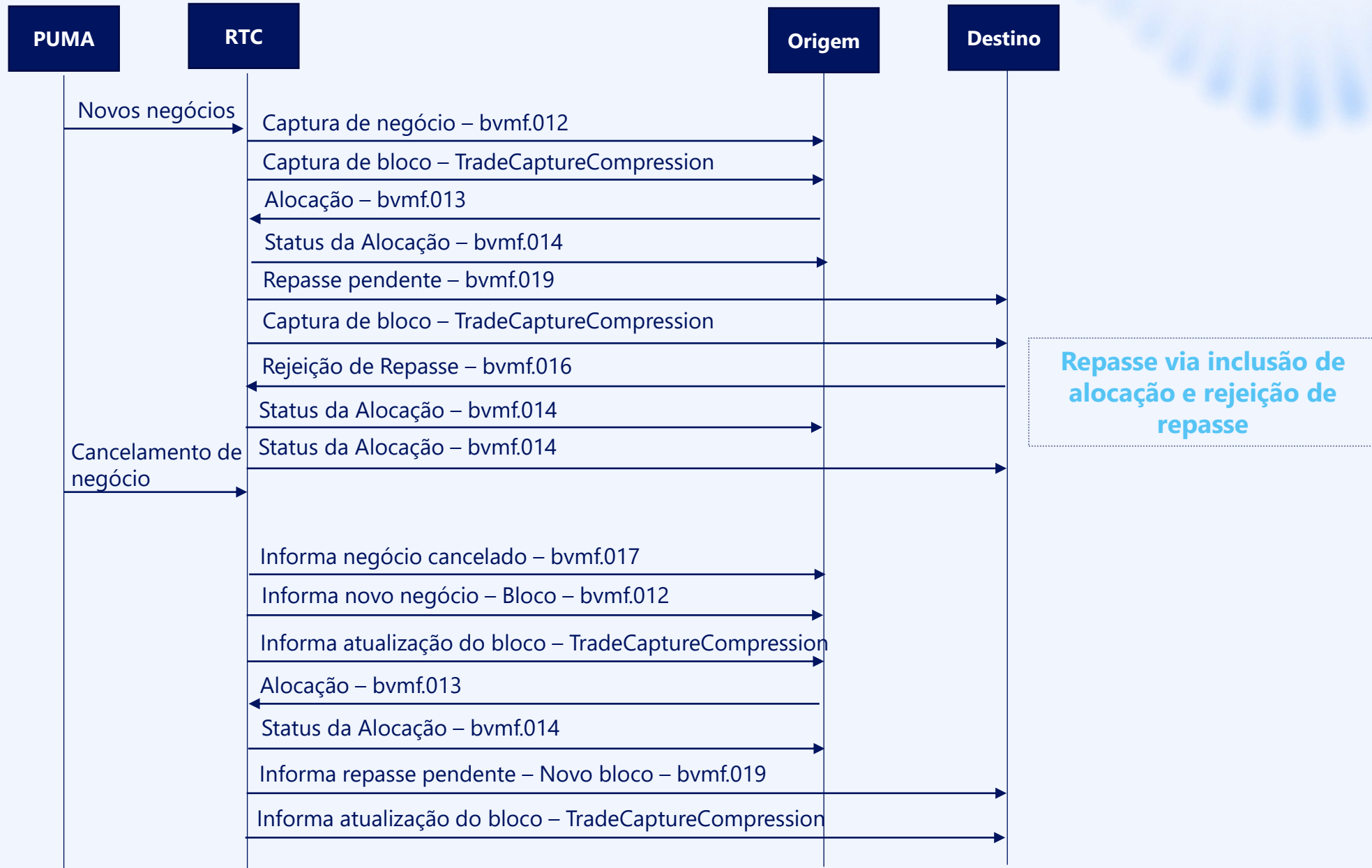
Alocação Simples

Exemplos



Captura em Bloco

Exemplos



Repasse via inclusão de alocação e rejeição de repasse

[B]³

Captura em Bloco – SINACOR



SINACOR

Características Gerais

O negócio consolidado será tratado de forma semelhante a qualquer outro negócio da plataforma, apenas com o adendo do batimento do detalhamento dos negócios com o negócio consolidado.

- ✓ Identificar o negócio que faz referencia a um bloco.
- ✓ Realizar a recepção da nova mensagem que conterà os detalhes do bloco.
- ✓ Realizar a conciliação entre o bloco e os detalhes do bloco (Batimento da quantidade).
- ✓ Caso seja identificado inconsistências na conciliação será realizado uma nova conciliação.
- ✓ Importação do arquivo de detalhes do bloco para realizar a conciliação entre o negócio e os detalhes do bloco.

[B]³

Soluções para Netting da Conta Erro – RTC



Soluções para Netting na Conta Erro

Alocação Automática

Atualmente

Derivativos Fungíveis

Negócios alocados em contas transitórias são **movimentados automaticamente para a conta erro padrão** no final do período de alocação.

Posições dessas operações são compensadas.

Alteração

(opcional)

Derivativos Fungíveis

Negócios que estiverem alocados em contas transitórias serão **movimentados automaticamente para a conta erro de compra e para a conta erro de venda.**

*A movimentação só ocorrerá após a criação das contas.

Posições dessas operações não serão compensadas.

Soluções para Netting na Conta Erro

Objetivo

Contas serão criadas para que as posições das operações de derivativos fungíveis não sejam compensadas.

Contas

- Criação das contas será feita na área de Cadastro da B3, sob demanda dos participantes.

- ID das contas:

9999900 – Compra

9999901 – Venda

- Aplicável para PNP e PL.

PL: Atentar-se para operações de exercício, pois precisam estar com toda a cadeia de cadastro em conformidade.

Funcionamento

Alocação

- O que estiver em conta transitória no final do período de alocação será encaminhado para as contas erro compra e erro venda.
- O que estiver pendente também irá para as contas erro. Por exemplo:
Pendente de aprovação de quebra de regra,
pendente de aprovação do risco.

Encerramento da Alocação – Derivativos 19:30

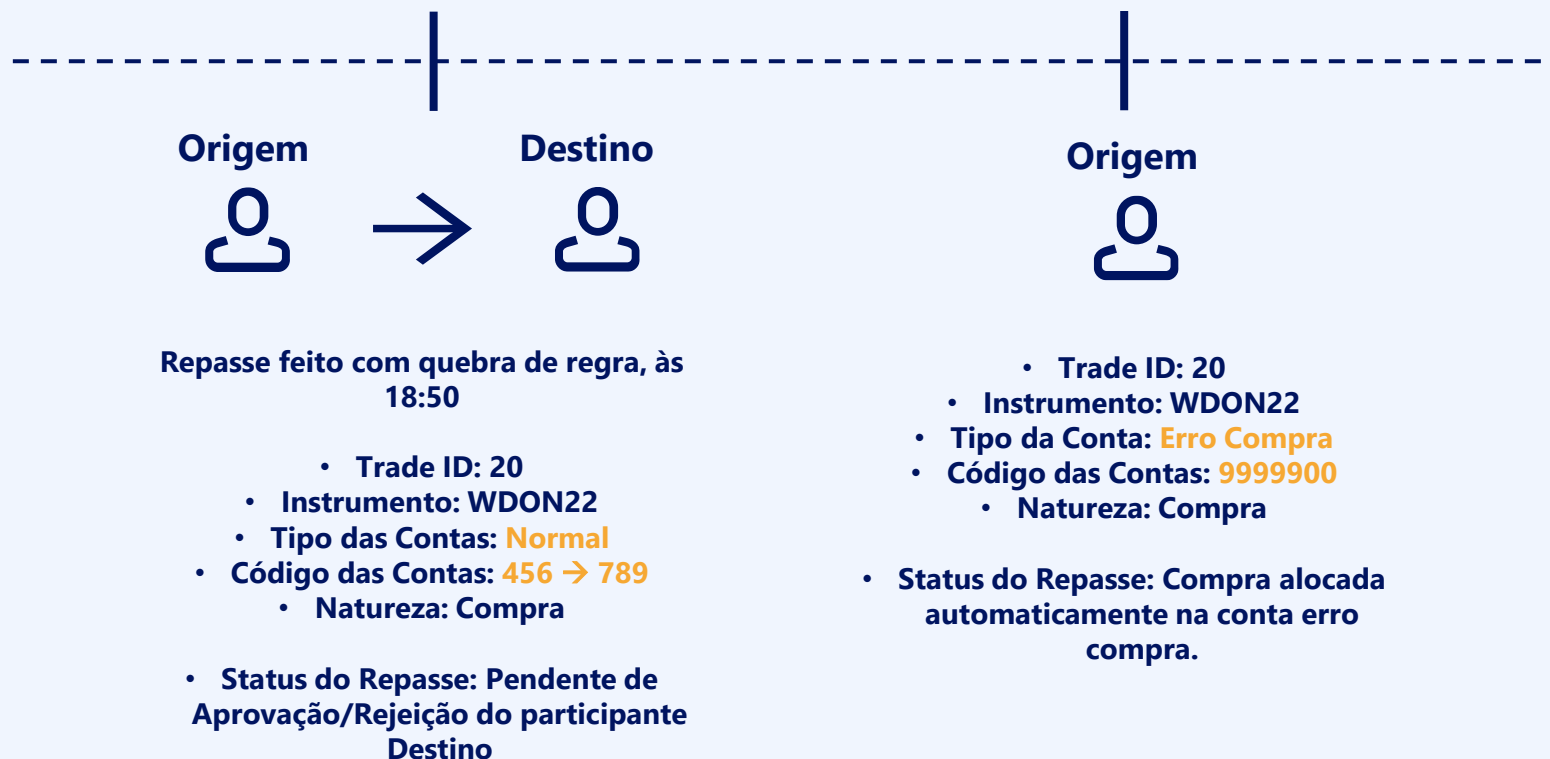


Funcionamento

Repasse

- Operações que estiverem pendentes de aceite/rejeição, que no final do período de repasse **seriam encaminhadas para a conta erro padrão**, serão encaminhadas para as contas erro compra e erro venda.

Encerramento de Repasse – Derivativos 19:00



Soluções para Netting na Conta Erro

Mercados Aplicáveis

Descrição	Mercado	Sec Category
Futuro	2	
Opção sobre Disponível	3	
Opção sobre Futuro	4	
Derivativos de Ações	70 – Call 80 – Put	7 – Opções de Ações 8 – Opções em Índices
Estratégias	2 – Futuro 3 – Opção sobre Disponível 4 – Opções sobre Futuro	4 – FRP 5 – FRA 10 – ROL 15 – VOL 61 – TAS 93 – Neutral DV01 94 – Neutral PU
Swap Cambial	5	20

Deadlines

Alocação		
2 – Derivativos de Ações	20:30	D+0
2 – Derivativos de Ações - Opções que vencem na data do negócio (opções de exercício automático)	16:00	
4 – Agronegócio 5 – Financeiro 6 – Metal (Mercados 2 e 3)	19:30	
4 – Agro com entrega física no período de entrega física.	18:00	
4 – Agro não residente (2687)	17:30	



Soluções para Netting da Conta Erro – Cadastro



[B]³

TKS!

