



ROADMAP B3

CARTA DE VERSÃO SINACOR – 23.3.0

21/09/2023

SUMÁRIO

INTRODUÇÃO	3
MÓDULO DE ORDENS	4
1.1. NOVAS FUNCIONALIDADES	4
1.1.1. NOVO TICKER DE OPÇÕES SEMANAIS	4
MÓDULO FATURAMENTO DERIVATIVOS	4
2.1. NOVAS FUNCIONALIDADES	4
2.1.1. UDS – TARIFAÇÃO DIFERENCIADA DERIVATIVOS.....	4
2.1.2. <i>TRADING HOURS</i> – DEMONSTRAÇÃO DA NOTA.....	6
2.1.3. ALTERAÇÃO REGISTRO OPÇÃO FLEXÍVEL COM CCP	7
FATURAMENTO – EMPRÉSTIMO DE ATIVOS	7
3.1. NOVAS FUNCIONALIDADES	7
3.1.1. RELATÓRIO DOS DADOS ENVIADOS PARA O B3i.....	7
MÓDULO TESOURARIA	10
4.1. FUNCIONALIDADES ALTERADAS	10
4.1.1. CRIAÇÃO GRUPO DE COMPENSAÇÃO PARA TRATAMENTO NOVO HISTÓRICO DE TRANSAÇÃO PIX – BANCO B3	10

INTRODUÇÃO

O objetivo deste documento é apresentar aos contratantes, as funcionalidades e adequações relacionadas aos produtos B3, assim como as informações e orientações para utilizá-las.

MÓDULO DE ORDENS

1.1. NOVAS FUNCIONALIDADES

1.1.1. NOVO TICKER DE OPÇÕES SEMANAIS

Em atendimento a iniciativa da B3, que tem suas informações divulgadas na página do projeto do site B3/Clientes → [Opções semanais de ações](#).

Com a criação de vencimentos de opções semanais que visam trazer uma maior gama de possibilidades e customização para as estratégias e proteção de portfólio ao investidor, focados em eventos de curto prazo como divulgação de resultados e eventos corporativos, a um custo ainda menor devido aos valores dos prêmios dessas opções:

- Validamos a criação e especificação das operações de opção com vencimento semanal;
- Incluímos na rotina de vencimento de ordens VAC (Abertura do módulo), **a checagem de validade do instrumento**. Dessa forma, ordens que **estão inválidas** para negociação, terão a data de validade alterada, a fim de entrarem na rotina de movimentação de histórico.

MÓDULO FATURAMENTO DERIVATIVOS

2.1. NOVAS FUNCIONALIDADES

2.1.1. UDS – TARIFAÇÃO DIFERENCIADA DERIVATIVOS

Em atendimento a iniciativa da B3, que tem suas informações divulgadas na página do projeto do site B3/Clientes → [UDS – Tarifação diferenciada](#)

A partir da versão 23.2.0, o SINACOR estará apto a tratar as *legs* da UDS e aplicar a tarifação diferenciada.

UDS são estratégias de negociação definidas pelo usuário que possibilita a negociação de múltiplos instrumentos em uma única operação, mitigando o risco encontrado ao se negociar cada um dos instrumentos individualmente. A criação da UDS poderá ser elaborada pelo próprio participante ou pela B3, mediante solicitação.

A tarifação será diferenciada apenas para os instrumentos de opção de dólar, DOL, DS1, DS2, DS3, DS4 e WDO.

Não haverá quebra de estratégia no RTC nem no SINACOR. Ambos já recebem as *legs* quebradas, ou seja, para cada *leg* da UDS será enviado um negócio, cada um com seu número que será identificado através dos campos:

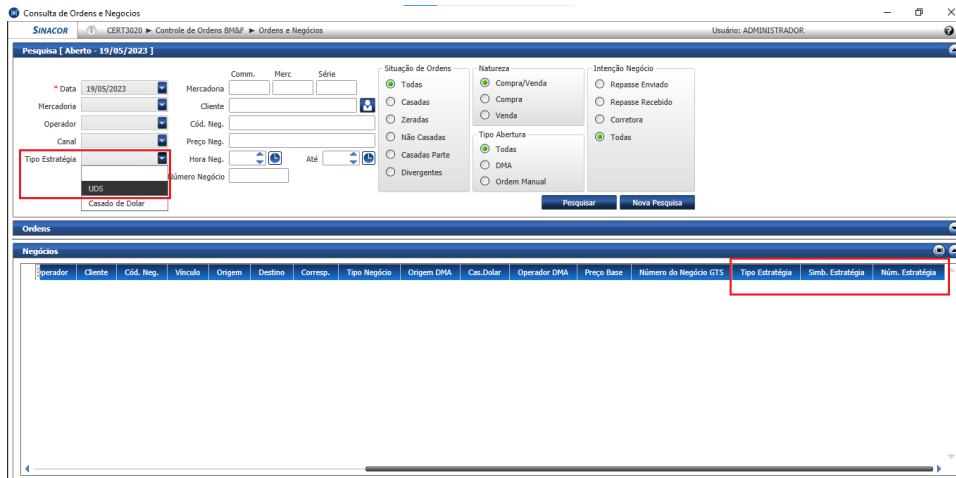
- *Strategy Type* = Tipo de estratégia;
- *Strategy Symbol* = Símbolo da estratégia;
- *SecondaryTradeMatchID* = Número da estratégia.

O custo unitário de uma UDS vai depender da quantidade de *legs*, que pode ser encontrada nos arquivos de tarifação BVBG.025 e BVBG.043 e cada faixa de *leg* terá um custo específico. Portanto, houve duas importantes implementações:

- Buscar o custo unitário dos negócios de UDS a partir da quantidade de *legs*;
- Casamento de *day trade* dos negócios de UDS com *outright* (perna seca).

Foi incluído filtro de tipo de estratégia UDS na tela “Consulta de Ordens e Negócios” no módulo Controle de Ordens BM&F para trazer apenas os negócios de UDS.

Além disso, incluímos três colunas no resultado da consulta que mostrará as informações da UDS, conforme imagem abaixo:



2.1.2. TRADING HOURS – DEMONSTRAÇÃO DA NOTA

A partir da versão 23.3.0, ao gerar a nota de corretagem - SINACOR será possível identificar de forma simples os negócios que foram operados no *Trading/After hours*.

Tanto na Nota de Corretagem - SINACOR, quanto na nota de corretagem histórica será exibido o símbolo ^a ao lado do vencimento do negócio operado no *Trading/After hours* e na legenda terá a seguinte mensagem: ^a Negócios After.

Segue exemplo:

Nota de Corretagem

Nota número: 8682 Data do pregão: 22/08/2023
Investidor Nacional Data de Liquidação: 23/08/2023
Data Inicial: Data Final:

Corretora: CERT3020 Número da Corretora: 8020-
C.N.P.J.: 82.672.800/0001-42 e-mail ouvidoria:
Ouvistoria: -

Taxa de Referência: 6,324 PTA: 6,1791 Código: 100983

Cliente: TESTE ALOCAÇÃO UNIFICADA MATI

C/V	Mercadaria	Vencimento	Quantidade	Preço/Ajuste	Tipo do Negócio	Vl. Operação/Ajuste	D/C	Taxa operacional	Cotação
C	WDO R26	1/2/2024 ^a	200	10,0000	NORMAL	10.404.704,00	C	2.800,00	6227,8630
V	WDO N24	7/31/2024	11	0,0000	AJUPOS	666.723,73	D	0,00	6142,8430
C	WDO N24	7/31/2024 ^a	200	10,0000	NORMAL	10.266.888,00	C	2.800,00	6142,8430
C	WIN 026	2/12/2026 ^a	200	11,0000	NORMAL	4.873.480,00	C	2.800,00	118648

Venda Disponível		Compra Disponível		Venda opções		Compra opções		Valor dos negócios	
0,00		0,00		0,00		0,00		24.808.348,27	C
IRRF (Projeção)		IRRF Day Trade (Projeção)		Taxa operacional		Taxa registro BM&F		Taxas BM&F (emolp-gar)	
0,00		0,00		6.000,00		214,00		172,00	D
IRRF e Corretagem		Taxa operacional Intermediação		Ajuste de posição		Ajuste day trade		Total das despesas	
80,00		0,00		24.808.348,27	C	0,00	C	6.488,00	D
Outros Custos		Total Conta Investimento		Total Conta Normal		Total líquido (R\$)		Total líquido da nota	
0,00		0,00	C	24.801.860,27	C	4.671.402,00	C	24.801.860,27	C
I.R.S.		Outros							
0,00		0,00							

^a Cotação Provisória
^a Negócios After

2.1.3. ALTERAÇÃO REGISTRO OPÇÃO FLEXÍVEL COM CCP

Será possível realizar liquidação antecipada de Opção Flexível em D+2.

Para isso, o SINACOR tratará o *layout* novo do arquivo MOVBALCAO que constará um campo novo no registro 4 de Data de Liquidação Antecipada. Nesse campo, virá informando se a liquidação antecipada será em D+1 ou D+2.

Foi criado um campo novo DT_LIQC_ANTC nas tabelas tmfposic_flx, tmfposic_flx_h, amfimp_arq_movbalcao. Além disso, implementamos uma nova tabela, a tmfposic_flx_d2, já com esse campo.

A rotina de cálculo financeiro respeitará a data que consta no novo campo para realizar a liquidação antecipada.

Também nessa versão, será possível realizar o pagamento do prêmio da Opção em D+2.

FATURAMENTO – EMPRÉSTIMO DE ATIVOS

3.1. NOVAS FUNCIONALIDADES

3.1.1. RELATÓRIO DOS DADOS ENVIADOS PARA O B3i

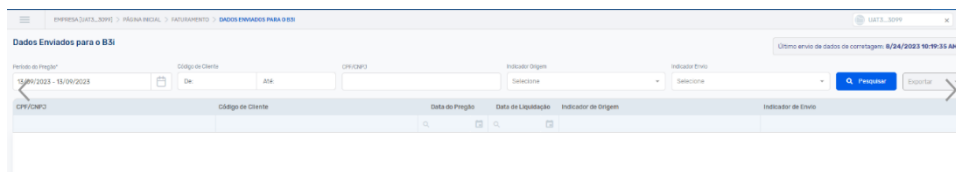
Em atendimento a iniciativa da B3, que tem suas informações divulgadas na página do projeto do site B3/Clientes → [REVAR](#).

A partir dessa versão, disponibilizaremos a interface que possibilita a visualização dos dados que estão sendo trafegados entre o SINACOR e Portal do Investidor (B3i) e que posteriormente, serão enviados para a Receita Federal.

Aprofundando mais na funcionalidade, a plataforma nos fornecerá a lista de investidores que autorizaram a entrega de informações ao B3i.

Após isso, coletamos as informações no SINACOR de Taxas Operacionais, Corretagem e Impostos dos módulos de Faturamento Equities e Derivativos, e os dados serão entregues ao portal em D+8 das operações, para evitar perda de alterações de corretagens que possam ocorrer no período.

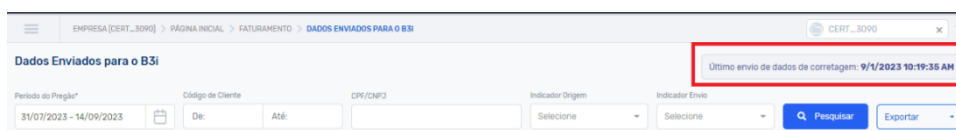
A tela de consulta de dados está presente no menu: Faturamento → Relatórios → Dados enviados para o B3i



Na interface temos o campo: Período do pregão como obrigatório. Importante dizer que os dados só podem ser consultados em D-1 justamente pela rotina de envio ocorrer sempre no dia anterior.

Campo indicador de origem: Será possível escolher entre BOL representando as notas de Equities e BM&F sendo as notas de Derivativos.

Indicador de envio: Será possível filtrar por S (notas que já foram enviadas para o B3i ou N (notas que estão aguardando a liberação).



Foi incluído também, o visor onde conseguimos monitorar quando foi a última vez que as notas foram enviadas para o Portal do Investidor.

Último envio de dados de corretagem: 9/1/2023 10:19:35 AM

Período do Pregão* 31/07/2023 - 14/09/2023

Código de Cliente De: Até:

CPF/CNPJ

Indicador Origem Seleciona

Indicador Envio Seleciona

🔍 Pesquisar 📄 Exportar

CPF/CNPJ	Código de Cliente	Data do Pregão	Data de Liquidação	Indicador de Origem	Indicador de Envio
123.456.789-01	12345754	01/09/2023	05/09/2023	BMF	N
932.562.830-98	564534	01/09/2023	05/09/2023	BMF	N
758.948.630-23	56775	01/09/2023	05/09/2023	BMF	N
319.179.720-32	224533	01/09/2023	05/09/2023	BMF	N
556.036.520-39	12345	01/09/2023	05/09/2023	BMF	N
333.301.970-13	4321345	01/09/2023	05/09/2023	BMF	S
907.578.960-22	989876	01/09/2023	05/09/2023	BMF	N

Mostrar 10 resultados Total de 7 resultados

Primeiro Anterior Próximo Último

Na tela, quando efetuamos a pesquisa, conseguimos visualizar a *grid* simplificada, que tem como objetivo demonstrar se de fato as notas que estão pendentes para envio foram enviadas ou estão esperando os 8 dias de liberação.

Caso o usuário tenha a necessidade de ter uma visão mais detalhada dos dados que estão sendo enviados, é possível exportar esses dados tanto em Excel quando em PDF:

Último envio de dados de corretagem: 9/1/2023 10:19:35 AM

Período do Pregão* 03/07/2023 - 14/09/2023

Código de Cliente De: Até:

CPF/CNPJ

Indicador Origem Seleciona

Indicador Envio Seleciona

🔍 Pesquisar 📄 Exportar

CPF/CNPJ	Código de Cliente	Data do Pregão	Data de Liquidação	Indicador de Origem	Indicador de Envio
123.456.789-01	12345754	01/09/2023	05/09/2023	BMF	N

Excel (Relatórios)
PDF (Relatórios)

O relatório ficará disponível no canto superior direito no *card* "Relatórios":

Relatórios

Último envio de dados de corretagem: 9/1/2023 10:19:35 AM

A	B	C	E	F	G	H	I	M	N	O	
1	CPF Investidor	Conta Investidor	Data Pregão	Indicador Origem	Data Liquidação	Valor IR Base Day Trade	Valor IR Sobre Day Trade	Valor IR Sobre Operações	Código Mercado	Valor Taxa	Valor Corretag.
2	556.036.520-39	12345	09/01/2023	BMF	09/05/2023	0	0	0	0 VIS	22.2	23.34
3	758.948.630-23	56775	09/01/2023	BMF	09/05/2023	0	0	0	0 FUT	22.2	23.34
4	319.179.720-32	224533	09/01/2023	BMF	09/05/2023	0	0	0	0 FUT	22.2	23.34
5	932.562.830-98	564534	09/01/2023	BMF	09/05/2023	0	0	0	0 FUT	22.2	23.34
6	907.578.960-22	989876	09/01/2023	BMF	09/05/2023	0	0	0	0 FUT	22.2	23.34
7	333.301.970-13	4321345	09/01/2023	BMF	09/05/2023	0	0	0	0 VIS	22.2	23.34
8	123.456.789-01	12345754	09/01/2023	BMF	09/05/2023	0	0	0	0 MULTIPLOS MERCADOS	44.4	46.68

Após a exportação, conseguimos ver as corretagens de cada cliente que aceitaram enviar os seus dados para a Receita Federal. Outro ponto importante, caso o cliente opere em mais de um mercado, no relatório será demonstrado esse ponto com a sigla MULTIPLOS MERCADOS e caso seja necessário verificar quais mercados de fato esse cliente operou, é preciso acessar os relatórios de nota de corretagem presentes no SINACOR.

MÓDULO TESOURARIA

4.1. FUNCIONALIDADES ALTERADAS

4.1.1. CRIAÇÃO GRUPO DE COMPENSAÇÃO PARA TRATAMENTO NOVO HISTÓRICO DE TRANSAÇÃO PIX – BANCO B3

Em atendimento à forte demanda para tratamento de lançamentos via PIX, a partir dessa versão, será possível recepcionar no módulo Tesouraria, esse tipo de lançamento, por meio da **Integração com o Banco B3**.

Menu: SINACOR Web → Tesouraria → Processos → Integração Banco B3.

O lançamento PIX será vinculado ao Grupo de Compensação 89 – PIX.