

30 de junho de 2020

082/2020-PRE

OFÍCIO CIRCULAR

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

Ref.: **Monitoramento de Operações de Mesmo Comitente (OMC) em Leilão**

A B3, com o objetivo de dar transparência a procedimentos que possam alterar a rotina dos participantes de mercado, informa que, em convergência com a regra para operações de mesmo comitente (OMC) em leilão prevista em seu Manual de Procedimentos Operacionais de Negociação, realizará o monitoramento de tais operações conforme o fluxo a seguir.

- 1)** A Diretoria de Negociação Eletrônica da B3 identificará as operações de mesmo comitente (OMC), de acordo com os seguintes critérios:
 - a)** operações efetuadas após os primeiros 60 (sessenta) segundos do leilão, no caso de ativos e opções referenciadas em ações, Ibovespa, IBrX-50 e cotas de fundo de índice (ETF); e
 - b)** operações efetuadas após os primeiros 30 (trinta) segundos do leilão, no caso dos demais derivativos.
- 2)** Participantes de mercado serão notificados, semanalmente, por e-mail, sobre as OMC realizadas na semana anterior.
- 3)** Dentro de cinco dias úteis contados a partir do recebimento da notificação, os participantes deverão justificar cada operação à Diretoria de Negociação Eletrônica da B3, segundo as possíveis classificações:

082/2020-PRE

- a) operação oriunda de erro operacional;
 - b) operação efetuada em função de estratégias distintas realizadas pelo mesmo Investidor; ou
 - c) operação intencional não oriunda de erro operacional.
- 4)** Com base na justificativa apresentada pelo participante, a Diretoria de Negociação Eletrônica da B3 verificará se houve recorrência de OMCs intencionais não oriundas de erro operacional – por comitente, no caso de operações efetuadas via Acesso Direto ao Mercado (DMA), por operador, no caso de operações efetuadas via Mesa, e por assessor, no caso de operações efetuadas via conexão do tipo Assessor – e tomará as providências previstas no Manual de Procedimentos Operacionais de Negociação, também descritas abaixo:
- a) na primeira ocorrência em cada período de verificação, advertência;
 - b) na segunda ocorrência em cada período de verificação, multa no valor correspondente a 5 (cinco) vezes o emolumento padrão na ponta compradora e vendedora da OMC;
 - c) na terceira ocorrência em cada período de verificação, multa no valor correspondente a 10 (dez) vezes o emolumento padrão na ponta compradora e vendedora da OMC; e
 - d) a partir da quarta ocorrência em cada período de verificação, aplicam-se as penalidades previstas nos normativos da B3.
- 5)** A B3 aplicará, mensalmente, as eventuais multas que integrarão o saldo líquido multilateral do comitente – conta final alocada, caso a operação seja efetuada via DMA, e conta erro do participante executor, caso a operação seja efetuada via Mesa ou Assessor. O participante deverá destacar o caráter de multa por OMC dessa cobrança no detalhamento do extrato do cliente.

082/2020-PRE

As ocorrências passarão a ser comunicadas aos participantes a partir da data de publicação desse Ofício Circular, e terão caráter educativo até o mês de julho de 2020. As operações irregulares identificadas a partir do mês de agosto de 2020 estarão sujeitas às penalidades previstas.

Salienta-se que todas as operações serão comunicadas à BSM, que avaliará o cumprimento das regras, conforme regulamentação vigente.

A regra para operações de mesmo comitente em leilão pode ser consultada no Manual de Procedimentos Operacionais de Negociação da B3, disponível em www.b3.com.br, Regulação, Estrutura normativa, Regulamentos e manuais, Negociação, Acessar documentos.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Diretoria de Negociação Eletrônica, pelos telefones (11) 2565-5022/5023/5024 ou pelo e-mail negociacao@b3.com.br.

Gilson Finkelsztain
Presidente

Cícero Augusto Vieira Neto
Vice-Presidente de Operações,
Clearing e Depositária