

MANUAL OPERACIONAL IMERCADO RISCO DE CAPITAL DE FUNDO

CONTEÚDO

1	IMERCADO RISCO DE CAPITAL DE FUNDO	.3
2	CONTRATAÇÃO DO MÓDULO	. 3
3	MODULO RCF	.3
3.1	Acesso ao portal	. 3
3.2	Navegando pelo portal – Módulo RCF	4
3.2	.1Tela de filtros	4
3.3	Arquivo CSV	6
3.4	Solicitação do arquivo IMBARQ016	.7
3.5	Exclusão da solicitação do arquivo IMBARQ016	8
3.6	Layout do arquivo IMBARQ016	8
3.7	Parametrização Cogestão	8



1 IMERCADO RISCO DE CAPITAL DE FUNDO

O módulo Risco de Capital do Fundo (RCF) foi desenvolvido com o objetivo de viabilizar o monitoramento da exposição ao risco de capital dos fundos por gestores, administradores e controladores.

A métrica RCF é disponibilizada diariamente no Portal iMercado – Conciliação, cuja metodologia está descrita em <u>www.b3.com.br</u>, Produtos e Serviços, Compensação e Liquidação, Clearing B3, Administração de riscos.

2 CONTRATAÇÃO DO MÓDULO

O módulo RCF está contido no iMercado-Conciliação. Para contratar o serviço deve-se enviar o formulário disponível na página do iMercado para o e-mail <u>contratacao@b3.com.br</u>.

Após a finalização das devidas etapas e habilitação do usuário será disponibilizado um login para autenticação na plataforma.

3 MODULO RCF

O uso da tela é somente para consulta e de acesso exclusivo para gestores, administradores e controladores.

3.1 Acesso ao portal

- a. O acesso ao ambiente de certificação (homologação) deverá ser feito pelo link <u>https://imercado-cert.b3.com.br/</u>
- b. O acesso ao ambiente de produção deverá ser feito pelo link https://imercado.bmfbovespa.com.br/
 - d. c. O acesso utiliza duplo fator de autenticação da B3 (token). A configuração pode ser feita seguindo as orientações na tela ou no manual do duplo fator de autenticação disponível neste link. Após passar pelo segundo fator de autenticação, será necessário adicionar o login e senha, em seguida selecionar o código da instituição e a categoria.



Acesso ao Sistema	
Esqueci meu usuário Esqueci minha senha Entrar	

3.2 Navegando pelo portal – Módulo RCF

PORTAL IMERCADO	RESUMO	Solicitações 🕂	APROVAÇÕES 🕂	CONSULTAS +	ADMIN +	RISCO —	CADASTRO +
						Risco de Capit	al do Fundo
						Parametrizaçã	io Cogestão
						Solicitação IM	BARQ RCF

3.2.1Tela de filtros

Quando o gestor, administrador ou controlador acessar a tela, a Razão Social e CNPJ virão preenchidos.

Exemplo Gestor:

elatório de Alavanças	em						
Risco > Relatório de Alavancagem							
Cód. Corretora	Razão S	iocial Corretora		Social Gestor		CNP] Gestor 00.123.456/7	891-00
Razão Social Administrador	CNPJ Ad	Iministrador	Razã	o Social Controlac	or	CNPJ Controlad	or
Conta	CNPJ Co	inta	Razã	o Social Conta			
		(

Ao ser identificado, a lista de fundos ao qual o gestor tem permissão de visualização será disponibilizada na tela.

Para visualizar os fundos, clique em "Filtrar":

Clicando na seta sinalizada em verde ao lado direito, será realizado o download de todos os fundos apresentados em formato CSV.

Nome: Kelat	
	onomavaricageni_20240104_002057.csv
Tipo: Micro	osoft Excel Comma Separated Values File (*.csv)
ar nastas	

Caso deseje filtrar algum fundo específico, preencha os dados da corretora, ao lado esquerdo da tela:

Portal iMercado	RESUMO DOS STATUS	SOLICITAÇÕES +	CONSULTAS +	ADMIN +	risco +	CADASTRO +	
Relatório de Alavar	ncagem						
A → Risco → Relatório de Alavanca	agem						
							-
Cód. Corretora	Rozão So CR CO	cial Corretora RRETORA	Razã	o Social Gestor		CNPJ Gestor	
Razão Social Administrador	CNPJ Ad	ministrador	Razã	o Social Controlad	lor	CNPJ Controlador	
Conta	CNPJ Co	nta	Razã	o Social Conta			
		(LIMPAR FILTRA	R			
				_			

3.3 Arquivo CSV

O arquivo extraído da tela apresenta a extensão CSV, com caractere separador ";" e no padrão brasileiro.

САМРО	TIPO	FORMATO/TAMANHO
Data de Referência	Data	DD/MM/AAAA
Cod. Corretora	Numérico	6
Razão Social da Corretora	Texto	100
Conta	Numérico	15
CNPJ Conta	Texto	18
Razão Social da Conta	Texto	100
Gestor	Texto	100
CNPJ Gestor	Texto	18
Administrador	Texto	100
CNPJ Administrador	Texto	18
Controlador	Texto	100
CNPJ Controlador	Texto	18
Risco de Capital do Fundo	Numérico	17 Inteiros – 10 casas decimais

Caso seja necessário suporte direto pela B3, o atendimento é feito pelo número (11) 2565-5016 ou por <u>liquidacao.imercado@b3.com.br</u>.



3.4 Solicitação do arquivo IMBARQ016

O arquivo IMBARQ016 foi criado com o intuito de viabilizar a distribuição automatizada das informações de risco de capital do fundo. As opções de transmissão do arquivo são via <u>API do iMercado</u>, tela do iMercado (menu Solicitações > Download de Arquivos) ou pela infraestrutura <u>RCB</u>. Ambos os serviços são disponibilizados pela B3 aos participantes, mediante contratação.

A solicitação de geração do arquivo se dá pelo menu Risco > Solicitação IMBARQ RCF e estará disponível para as categorias de clientes gestores, administradores e controladores.



Na tela, o usuário deve marcar a opção IMBARQ016 e clicar em "Salvar".

olicitação IMBARQ	RCF	
> Risco > Solicitação IMBARQ RCF		
GEST	Participante Solicitante	Razão Social
		LIMPAR
lotal de Registros		
ipo de Arquivo		
	Canital de Eurodos	
/IBARQ016 - Métricas de Risco de	capital de l'allada	•



3.5 Exclusão da solicitação do arquivo IMBARQ016

A exclusão da solicitação do IMBARQ016 é realizada também no menu Risco > Solicitação IMBARQ RCF.

Ao entrar nesta tela, o gestor, administrador ou controlador clicará no botão "Filtrar" e aparecerá em tela o registro do IMBARQ016 com o *check*. Para excluir a solicitação, é necessário retirar o *check* e, em seguida, aparecerá uma janela para confirmar a remoção e interrupção de geração do arquivo. Ao clicar em "Sim", a solicitação de exclusão é efetuada com sucesso.

Solicitação IMBARQ RCF	
A > Rose > Salicitoção 8/BARQ RCF	
Comparie Castante Participante Solicitor te	
Tatel de Benjamer	?
Tipo de Arquivo	A solicitação será removida e a
IMBARQ016 - Métricos de Risco de Capitol de Fundos	geração do arquivo interrompida. Deseja continuar?

3.6 Layout do arquivo IMBARQ016

O layout do arquivo IMBARQ016 é idêntico ao arquivo extraído diretamente do grid (item 3.4 deste manual).

3.7 Parametrização Cogestão

A tela Parametrização Cogestão é destinada para aprovar a visualização de fundos que possuem cenários de Cogestão. Este menu é disponibilizado apenas para gestores.





Ao abrir os menus Risco > Parametrização Cogestão, serão exibidos os campos de filtro "Categoria", "Participante Solicitante", "Razão Social" e "Documento" que já estarão preenchidos de acordo com o usuário do cliente, os filtros de "Situação", "Data Inicial" e "Data Final" que podem ser preenchidos e os botões "Limpar", "Filtrar" e "Incluir".

rametrização C	ogestão			
Risco -> Parametrização Cog	estão			
Categoria	Participante Solicitante	Razão Social		Documento
Categoria GEST	Participante Solicitante	Razão Social		Documenta

Ao clicar em "Filtrar", aparecerão todos os PNP's/PL's e contas que o gestor autorizou para visualizar os fundos na tela Risco de Capital do Fundo em cenário de Cogestão.

ITAL IMERCADO	RESUMO	SOLICITAÇÕES 🕂	APROVAÇÕES 🕂	CONSULIAS +	RISCO +	DUPLICATAS +	EVENTOS +						
rametrização	o Cogestão												
Risco - Porometrizopi	io Cogestião												
GEST													
Shuqdo	P Dota la	nicial	6	Data Final									
							LIMPAR	INCLUIR					
otal de Registros	10												
Total de Registros Excluir Cór	10 I. Participante	Cód. PNP / PL	. Conta			Razõ	io Social		CNPJ	Situação	Ατυσίιzαção	Histórico	Usuário
Total de Registros Excluir Cór B	19	Cód. PNP / PL	. Conta			Rază	io Social		CNPJ	Situação	Atualização	Histórico	Usuário
Fotal de Registros Excluir Cór B B	10	Cód. PNP / Pi	. Conta			Rozō	io Social		CNPj	Situoção	Ατυοίεzαção	Histórico	Usudrio
Total de Registros	19 I. Participante	Cód, PNP / PL	. Conta			Rozô	io Social		CNPJ	Situação	Ατυσίιχαςδο	Histórico	Usudirie
Fotol de Registros	Participante	Cód. PNP / PL	. Conto			Raző	io Social		CNPJ	Situoção	Ατυσίεχαςδο	Histórico	Usudrio
Total de Registros	9) I. Participante	Cád, PNP / PL	. Conto			Razõ	io Social		CNPJ	Situoção	Ατυσίεσοςδο	Histórico	Usudrio
Total de Registros Excluir Cód 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	10 I. Participante	Cód, PNP / Pl	. Conto			Razō	io Sociol		CNPj	Situeção	Atusiização	Histórico	Usudirlo
Total de Registros Excluir Cód 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	B	Cód. PNP / PL	. Conto			Razô	io Social		CNPj	Situeção	Atuslização	Histórico	Usudrio
Total de Registros Excluir Có 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	B I. Participante	Cdd. PNP / PI	. Conto			Razð	e Secial		CNPj	Situeção	Αλυσίϊzοςδο	Histórico	Usudrio
fotal de Registros Sociair de Registros D D D D D D D D D D D D D D D D D D D	1. Participante	Cód. PNP / Pl	. Conto			Rozō	ie Sector		CMPj	Situação	Ατυσίεσοζου	Motórico	Usudirio

Para incluir um registro, clicar no botão "Incluir", inserir o código da corretora, a conta e clicar em "Salvar".

Cdd. Constore	Conto	
		hers por página → IC C (1 → D)
	CANCELAR	

Para excluir um registro, clicar na lixeira do canto direito de cada registro.

Total de Registros 🔟		
Excluir	Cód. Participante	
0		