

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
3.2.1	Tela 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 www.b3.com.br, 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 contratacao@b3.com.br.

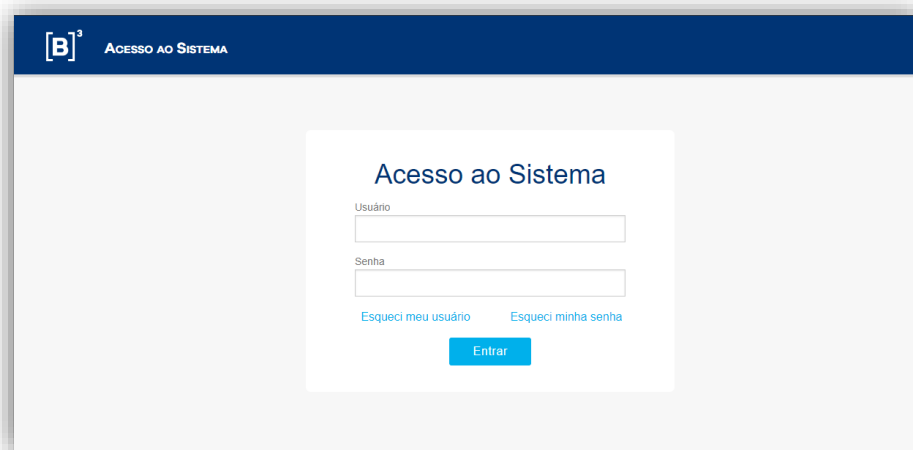
Após a finalização das devidas etapas e habilitação do usuário será disponibilizado um login para autenticação na plataforma.

3 MODULO RCF

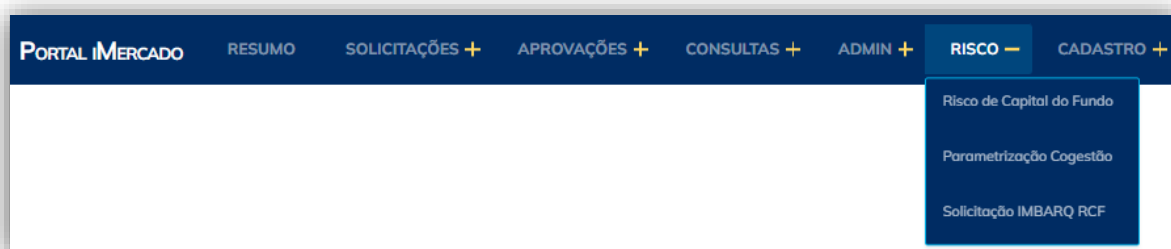
O uso da tela é somente para consulta e de acesso exclusivo para gestores, administradores e controladores.

3.1 Acesso ao portal

- a. O acesso ao ambiente de certificação (homologação) deverá ser feito pelo link <https://imercado-cert.b3.com.br/>
- 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.



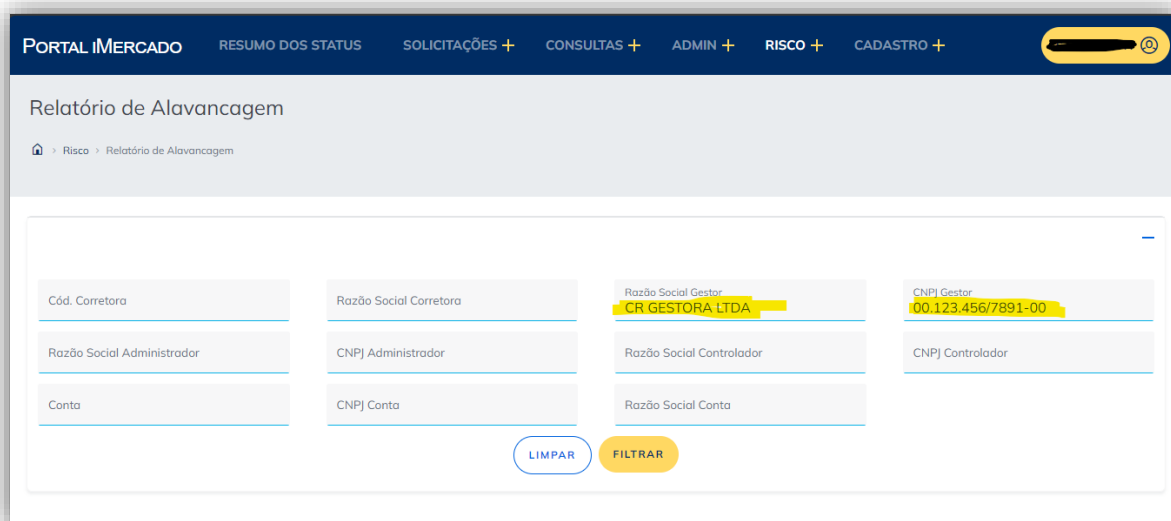
3.2 Navegando pelo portal – Módulo RCF



3.2.1 Tela de filtros

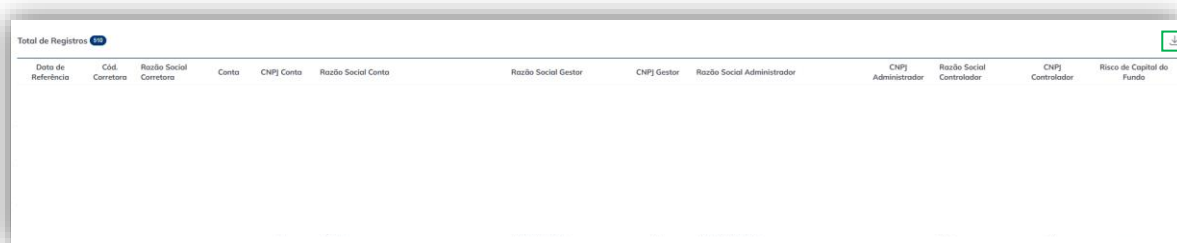
Quando o gestor, administrador ou controlador acessar a tela, a Razão Social e CNPJ virão preenchidos.

Exemplo Gestor:



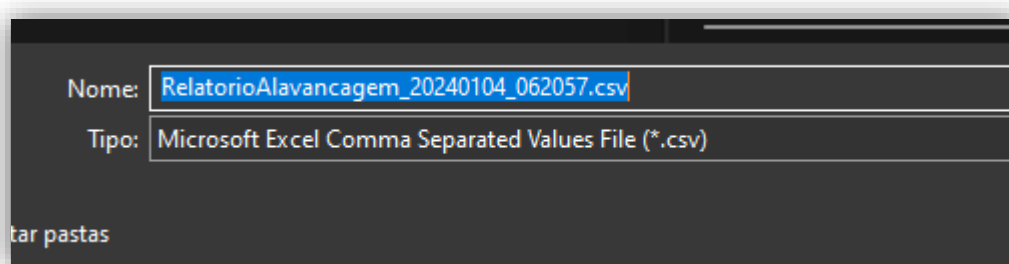
Ao ser identificado, a lista de fundos ao qual o gestor tem permissão de visualização será disponibilizada na tela.

Para visualizar os fundos, clique em “Filtrar”:



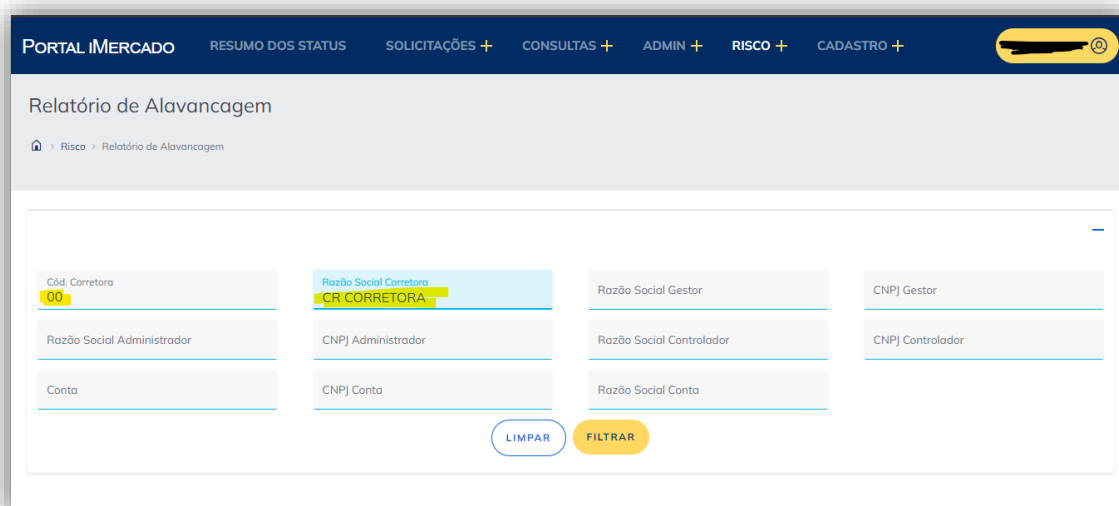
The screenshot shows a table with the following columns: Data de Referência, Cód. Corretora, Razão Social Corretora, Conta, CNPJ Conta, Razão Social Conta, Razão Social Gestor, CNPJ Gestor, Razão Social Administrador, CNPJ Administrador, Razão Social Controlador, CNPJ Controlador, and Risco de Capital do Fundo. A green download icon is located in the top right corner of the table area.

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



The screenshot shows a file download dialog box with the following fields: Nome: RelatórioAlavancagem_20240104_062057.csv and Tipo: Microsoft Excel Comma Separated Values File (*.csv). There is a 'tar pastas' option at the bottom left.

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



The screenshot shows the 'Relatório de Alavancagem' form in the iMercado portal. The form has the following fields: Cód. Corretora (00), Razão Social Corretora (CR CORRETORA), Razão Social Gestor, CNPJ Gestor, Razão Social Administrador, CNPJ Administrador, Razão Social Controlador, CNPJ Controlador, Conta, and CNPJ Conta. There are 'LIMPAR' and 'FILTRAR' buttons at the bottom.

3.3 Arquivo CSV

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

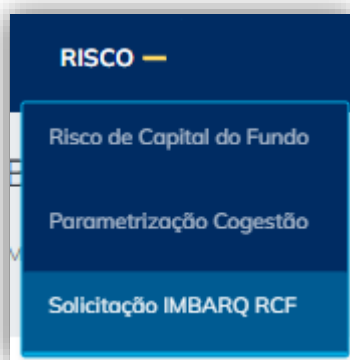
CAMPO	TIPO	FORMATO/TAMANHO
Data de Referência	Data	DD/MM/AAAA
Cod. Corretora	Numérico	6
Razão Social da Corretora	Texto	100
Conta	Numérico	15
CNPJ Conta	Texto	18
Razão Social da Conta	Texto	100
Gestor	Texto	100
CNPJ Gestor	Texto	18
Administrador	Texto	100
CNPJ Administrador	Texto	18
Controlador	Texto	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 liquidacao.imercado@b3.com.br.

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 [API do iMercado](#), tela do iMercado (menu Solicitações > Download de Arquivos) ou pela infraestrutura [RCB](#). 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.

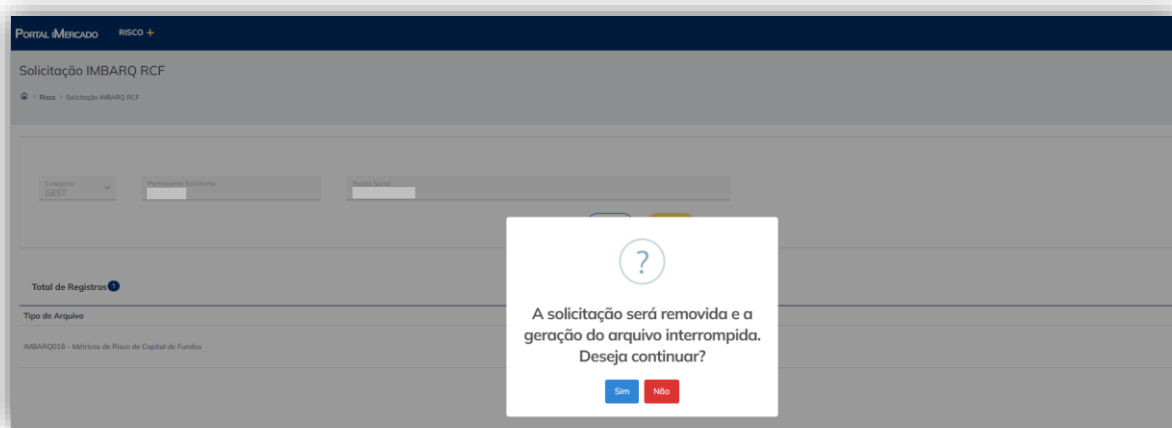


Na tela, o usuário deve marcar a opção IMBARQ016 e clicar em “Salvar”.

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.



3.6 Layout do arquivo IMBARQ016

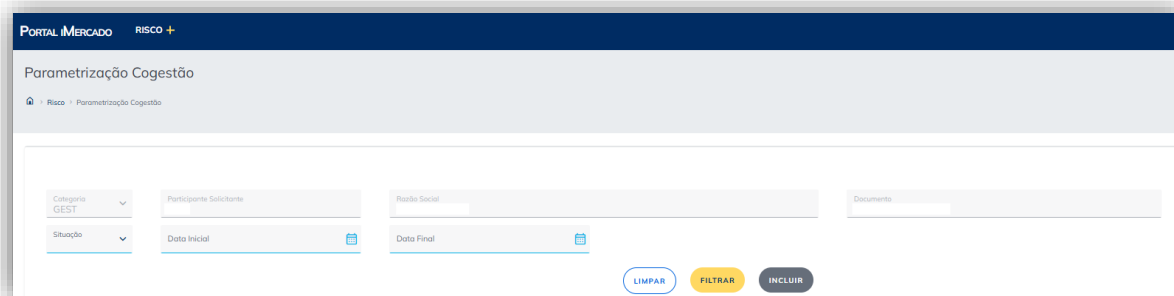
O layout do arquivo IMBARQ016 é idêntico ao arquivo extraído diretamente do grid (item 3.4 deste manual).

3.7 Parametrização Cogestão

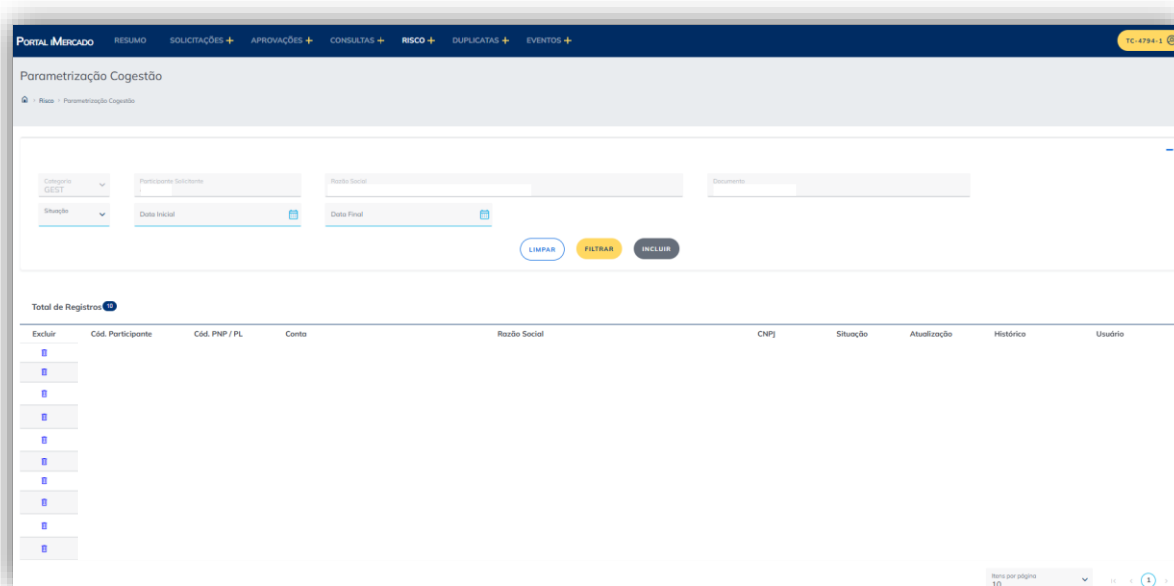
A tela Parametrização Cogestão é destinada para aprovar a visualização de fundos que possuem cenários de Cogestão. Este menu é disponibilizado apenas para gestores.



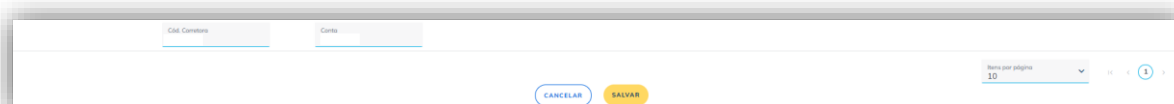
Ao abrir os menus Risco > Parametrização Cogestão, serão exibidos os campos de filtro “Categoria”, “Participante Solicitante”, “Razão Social” e “Documento” que já estarão preenchidos de acordo com o usuário do cliente, os filtros de “Situação”, “Data Inicial” e “Data Final” que podem ser preenchidos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



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.



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



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

