



Workshop BSM

Monitoramento Conjunto Contínuo
Indireto de Dados - Principais
atualizações do Manual de *Layout*
BSM Versão 2.0

Outubro 2023



Programação



1. Abertura
2. Monitoramento Conjunto Contínuo Indireto de Dados
3. Manual de *Layouts* BSM 2.0
4. Cronograma de entrega dos *Layouts*
5. Sessão de Q&A





2. Monitoramento Conjunto Contínuo Indireto de Dados

Monitoramento Conjunto Contínuo Indireto de Dados

Propostas



- Identificação de exceções de forma mais tempestiva;



- Manutenção de bases íntegras;



- Otimização do tempo dos envolvidos – O tempo é investido na solução, automação e identificação de problemas e não se perde tempo com geração de dados, validação e integridade;



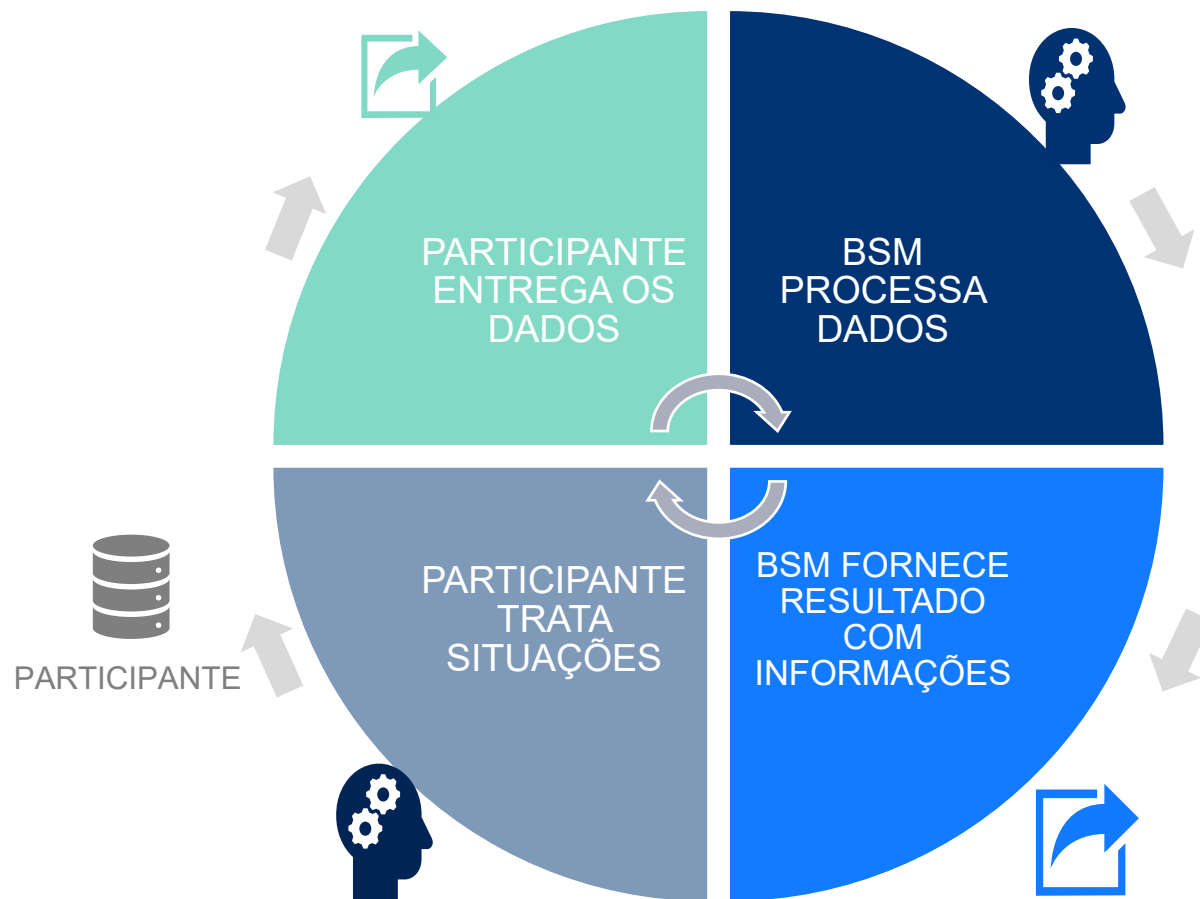
- Integridade das informações e do processo de forma contínua (Monitoramento por filme);



- Proximidade com autorregulador para alcançarmos a melhoria dos processos.

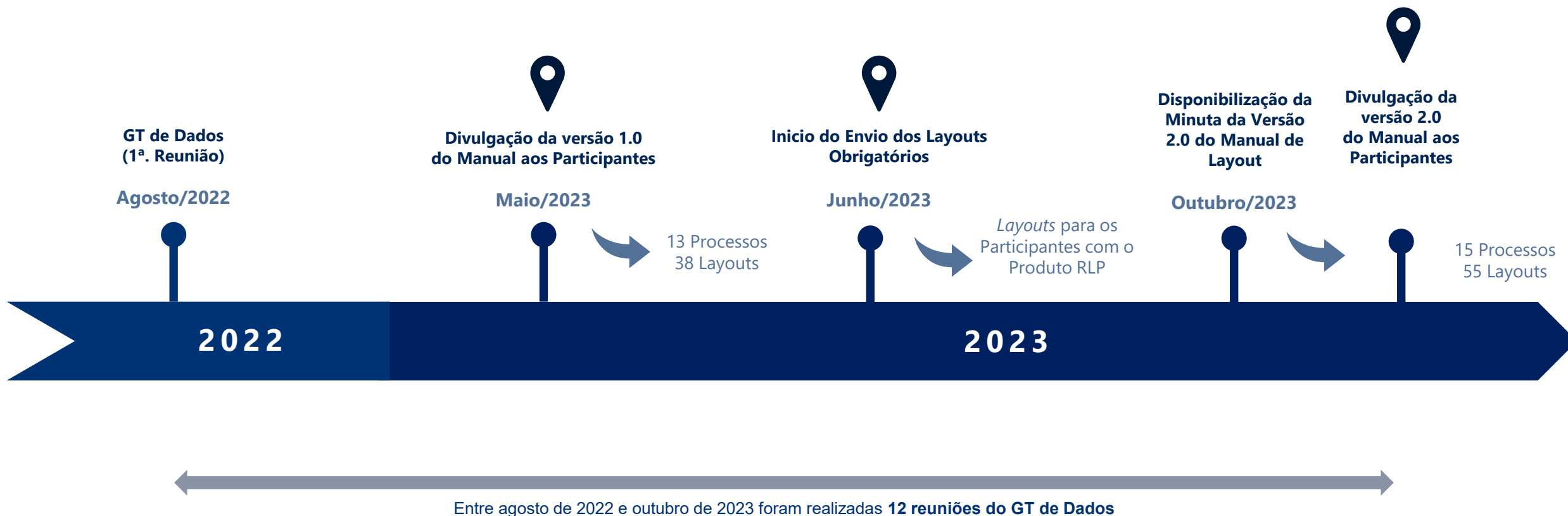
Monitoramento Conjunto Contínuo Indireto de Dados

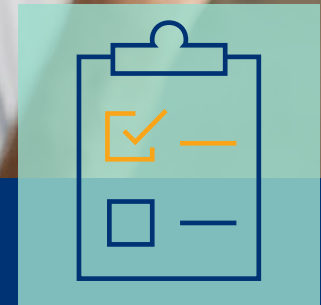
Fluxo



Monitoramento Conjunto Contínuo Indireto de Dados

Timeline





3. Manual de Layouts BSM 2.0



Manual de Layouts BSM 2.0

Aprimoramentos

55 layouts de 15 processos

Distribuídos:

40 layouts para entrega conforme prazo previsto no Manual; e



15 layouts para entrega sob demanda.

- **Abrangência** do Manual - Participantes do **Mercado de Listado**
- **Objetivos** de cada *layout*
- Redefinição da **frequência de entrega e período** base
- Descrição do processo de **descarte de informações**
- **Cronograma** contendo as datas de entrega dos *layouts*
- **Cumprimento dos prazos** de entrega



Manual de Layouts BSM 2.0

Processos

1. *Retail Liquidity Provider (RLP)*
2. *Suitability*
3. Liquidação Compulsória
4. Prevenção à Lavagem de Dinheiro, ao Financiamento do Terrorismo e a Proliferação de Armas de Destrução em Massa
5. Supervisão de Operações e Ofertas 
6. Administrar Custódia de Ativos e Posições
7. Liquidar Negócio 
8. Assessor de Investimento (AI's)
9. Cadastro de Clientes
10. Conta Margem
11. Executar Ordens
12. Gerenciar Riscos
13. Tesouraria/Conta Corrente
14. Segurança da Informação
15. Suporte à Infraestrutura




Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts - Retail Liquidity Provider (RLP)



5 Layouts

- **Acionamento dos Gatilhos Educacionais.**
- **Envio do Material Educacional.**
- **Trilha de parametrização da Margem Mínima.**
- **Autorização (*Opt-in*) e Descontinuação (*Opt-out*).**
- **Lista de clientes aderentes ao uso do RLP.** 



Monitoramento:

- **Envio do material educacional após acionamento dos gatilhos.**
- **Parametrização correta da margem mínima.**
- **Operações antes do *Opt-in* ou após o *Opt-out*.**



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts - Retail Liquidity Provider (RLP)

Prazos em 2023:

- Acionamento dos Gatilhos Educacionais – **junho de 2023** - Periodicidade: Mensal
- Envio do Material Educacional – **junho de 2023** - Periodicidade: Mensal
- Trilha de parametrização da Margem Mínima – **julho de 2023** - Periodicidade: Mensal
- Autorização (*Opt-in*) e Descontinuação (*Opt-out*) – **agosto de 2023** - Periodicidade: Trimestral
- Lista de clientes aderentes ao uso do RLP – **novembro de 2023** - Periodicidade: Trimestral






Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts - Suitability



6 Layouts

- Perguntas e Respostas do Questionário de *Suitability*.
- Pontuação do questionário *Suitability*. 
- Perfil do questionário *Suitability*. 
- Base de Perfil de Investimento de Clientes.
- Produtos Oferecidos por Perfil de Investimento.
- Termo de risco de operações desenquadradas. 



Monitoramento:

- Atribuição do perfil de investimento de acordo com o questionário definido pelo Participante.
- Comunicações aos clientes referente a desenquadramento do perfil.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts - Suitability

Prazos em novembro de 2024:


- Perguntas e Respostas do Questionário de *Suitability* – Periodicidade: Trimestral
- Pontuação do questionário *Suitability* – Periodicidade: Trimestral
- Perfil do questionário *Suitability* – Periodicidade: Trimestral
- Base de Perfil de Investimento de Clientes – Periodicidade: Trimestral
- Produtos Oferecidos por Perfil de Investimento – Periodicidade: Trimestral
- Termo de risco de operações desenquadradas – Periodicidade: Trimestral

Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Liquidação Compulsória



6 Layouts

- Comunicações aos Investidores.
- Bloqueio e Desbloqueio de Liquidação Compulsória.
- Alocação de Garantias.
- Controle de Posição.
- Liquidação Compulsória.
- Parametrizações de liquidação compulsória. 



Monitoramento:

- Comunicação antes e após ao procedimento de liquidação compulsória.
- Bloqueio de negociação antes do procedimento de liquidação compulsória.
- Registro de alocação de garantia de clientes.
- Garantia exigida X garantia alocada no momento da abertura da posição.
- Liquidação compulsória de acordo com as regras definidas pelo Participante.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Liquidação Compulsória

Prazos em agosto de 2024:

- Comunicações aos Investidores – Sob demanda
- Bloqueio e Desbloqueio de Liquidação Compulsória – Sob demanda
- Alocação de Garantias – Sob demanda
- Controle de Posição – Sob demanda
- Liquidação Compulsória – Bimestral
- Parametrizações de liquidação compulsória – Sob demanda




Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – PLD/FTP



2 Layouts

- Alertas e Registros das Conclusões das Análises dos Alertas de PLD/FTP.
- Clientes com as alterações de perfis de riscos. 



Monitoramento:

- Monitoramento das análises geradas e do prazo das conclusões das análises após o acionamento do alerta.
- Monitoramento contínuo do perfil ABR do cliente.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – PLD/FTP

Prazos em maio de 2024:

- Alertas e Registros das Conclusões das Análises dos Alertas de PLD/FTP – Bimestral
- Clientes com as alterações de perfis de riscos – Bimestral



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Supervisão de Operações e Ofertas



1 *Layout*

- Alertas e Registros das Conclusões das Análises dos Alertas de Supervisão de Operações e Ofertas. 



Monitoramento:

- Monitoramento das análises geradas e do prazo das conclusões das análises após o acionamento do alerta.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Supervisão de Operações e Ofertas

Prazo em maio de 2024:

- Alertas e Registros das Conclusões das Análises dos Alertas de Supervisão de Operações e Ofertas – Bimestral



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Administrar Custódia de Valor Mobiliário e Posições



1 *Layout*

- Solicitação de Transferência de Custódia pelo Investidor.



Monitoramento:

- Avaliar se as transferências foram realizadas dentro do prazo definido em norma.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Administrar Custódia de Valor Mobiliário e Posições

Prazo em setembro de 2024:

- Solicitação de Transferência de Custódia pelo Investidor – Bimestral



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Liquidar Negócio



2 Layouts

- Extrato da conta corrente dos clientes.
- Saldo projetado do cliente de acordo com as operações realizadas.



Monitoramento:

- Monitoramento de saldo devedor de clientes.
- Monitoramento de operações fraudulentas.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Liquidar Negócio

Prazos em janeiro de 2025:


- Extrato da conta corrente dos clientes – Trimestral
- Saldo projetado do cliente de acordo com as operações realizadas – Trimestral

Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Assessor de Investimento (AI's)



2 Layouts

- Assessor de Investimento não exclusivo. 
- Clientes atendidos pelo Assessor de Investimento.



Monitoramento:

- Monitoramento de operações de pessoas vinculadas.
- Monitoramento de operações fraudulentas.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Assessor de Investimento (AI's)

Prazos em abril de 2024:











- Assessor de Investimento não exclusivo – Mensal
- Clientes atendidos pelo Assessor de Investimento – Mensal

Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Cadastro de Clientes



11 Layouts

- Dados cadastrais de clientes.
- Procurador. 
- Controlador. 
- Administrador. 
- Controladora. 
- Controlada. 
- Coligada. 
- Dados INR. 
- Relação de Pessoa Vinculada. 
- Nível de Risco para Atualização Cadastral. 
- Emissores autorizados. 



Monitoramento:

- Monitoramento da completude dos dados cadastrais entre os sistemas do Participante versus Sistema B3 (Sincad).
- Monitoramento de operações de pessoa vinculada em outro participante.
- Monitoramento de clientes que operaram com cadastro desatualizado, conforme Política de Classificação de Risco do Participante (ABR).
- Monitoramento dos emissores autorizados que emitem ordens em nome dos comitentes.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Cadastro de Clientes

Prazos em abril e julho de 2024:

- Relação de Pessoa Vinculada – **abril** de 2024 - Mensal
- Dados cadastrais de clientes (mais *layouts* complementares), Nível de Risco para Atualização Cadastral e Emissores autorizados – **julho** de 2024 - Trimestral



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Conta Margem



4 Layouts

- Adesão ao produto Conta Margem.
- Clientes que operam Conta Margem.
- Relação de financiamentos e garantias dos clientes que operaram na conta margem.
- Operações realizadas por intermédio de Conta Margem.



Monitoramento:

- Monitoramento de adesão ao Produto Conta Margem.
- Monitoramento de operações com o Produto Conta Margem.
- Monitoramento dos ativos financiados e utilizados como garantia.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Conta Margem

Prazos em janeiro de 2025:




- Adesão ao produto Conta Margem – Quadrimestral
- Clientes que operam Conta Margem – Quadrimestral
- Relação de financiamentos e garantias dos clientes que operaram na conta margem – Quadrimestral
- Operações realizadas por intermédio de Conta Margem – Quadrimestral

Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Executar Ordens



6 Layouts

- Relação dos códigos de categoria por conta.
- Carteiras geridas pelo Participante.
- Trilha de Inclusão, alteração e cancelamento de ordens de clientes.
- Trilha Resumo de Ordens. 
- Finalidade Sessão. 
- Registro de ocorrência das operações lançadas na Conta Erro. 



Monitoramento:

- Monitoramento do uso da sessão e origem das ofertas.
- Controle de registro de ocorrência (motivo) de todas as operações lançadas na Conta Erro.
- Monitoramento de operações fraudulentas.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Executar Ordens

Prazos em outubro de 2024 e janeiro de 2025:

Outubro de 2024

- Relação dos códigos de categoria por conta – Sob demanda
- Carteiras geridas pelo Participante – Sob demanda
- Trilha de Inclusão, alteração e cancelamento de ordens de clientes – Sob demanda
- Registro de ocorrência das operações lançadas na Conta Erro – Sob demanda

Janeiro de 2025

- Trilha Resumo de Ordens – Trimestral
- Finalidade Sessão – Trimestral



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Gerenciar Riscos



2 Layouts

- Risco Pré-Operacional – Inclusão e alteração de limites.
- Risco Pós-Operacional – Inclusão e Alteração de Limites (somente clientes Institucionais).



Monitoramento:

- Monitoramento das Atividades Executadas por Profissionais Certificados.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Gerenciar Riscos

Prazos em setembro de 2024:

- Risco Pré-Operacional – Inclusão e alteração de limites – Sob demanda
- Risco Pós-Operacional – Inclusão e Alteração de Limites (somente clientes Institucionais) – Trimestral



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Tesouraria / Conta Corrente



1 *Layout*

- Inclusão e manutenção de valores financeiros lançados manualmente nas contas dos clientes.



Monitoramento:

- Identificar lançamentos realizados indevidamente na conta de clientes.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Tesouraria / Conta Corrente

Prazo em setembro de 2024:

- Inclusão e manutenção de valores financeiros lançados manualmente nas contas dos clientes – Sob demanda



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Segurança da Informação



4 Layouts

- Atividades administrativas nos sistemas.
- Listas de usuários dos sistemas escopo.
- Trilha de registros dos acessos de entrada e saída aos sistemas de negociação.
- Relação de colaboradores (Ativos, desligados e terceiros).



Monitoramento:

- Monitoramento de conflito dos acessos aos sistemas, vínculo e certificação.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Segurança da Informação

Prazos em abril e outubro de 2024:

Abril de 2024

- Listas de usuários dos sistemas escopo – Trimestral
- Relação de colaboradores (Ativos, desligados e terceiros) – Trimestral

Outubro de 2024

- Trilha de registros dos acessos de entrada e saída aos sistemas de negociação – Sob demanda
- Atividades administrativas nos sistemas – Sob demanda



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Suporte à Infraestrutura



2 Layouts

- Inventário de gravação de voz / Relação de ramal por emissor.
- Registros de Indisponibilidade dos Sistemas de Gravação de Ordens (Voz e Mensageria).



Monitoramento:

- Monitoramento da integridade do inventário de gravador de voz.
- Monitoramento do registro de indisponibilidades nos sistemas de gravação de ordens.



Manual de Layouts BSM 2.0

Layouts – Suporte à Infraestrutura

Prazos em dezembro de 2024

- Inventário de gravação de voz / Relação de ramal por emissor – Sob demanda
- Registros de Indisponibilidade dos Sistemas de Gravação de Ordens (Voz e Mensageria) – Sob demanda



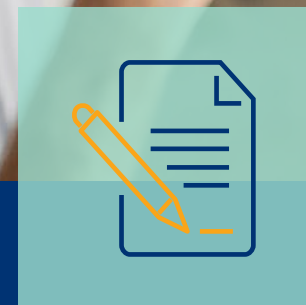
4. Cronograma de entrega dos *Layouts*



Manual de Layouts BSM 2.0

Cronograma de entrega dos *Layouts*

Cronograma	2024												2025
	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	jan
Suitability											6		
Liquidação Compulsória								6					
PLD/FTP					2								
SOO					1								
Custódia									1				
Liquidar Negócio													2
AI				2									
Cadastro de Clientes				1			10						
Conta Margem													4
Ordens										4			2
Gerenciar Risco									2				
Tesouraria									1				
Segurança da Informação				2						2			
Suporte a Infraestrutura												2	
				5	3		10	6	4	6	6	2	8



5. Sessão de Q&A



Monitoramento Conjunto Contínuo Indireto de Dados

Contato



bsm@bsmsupervisao.com.br



O CAMINHO CERTO É SEMPRE
O MELHOR CAMINHO

