

CONSELHO DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS DE NEGOCIAÇÃO DE INSTRUMENTOS FINANCEIROS

PARECER DE ORIENTAÇÃO Nº 01, DE 26 DE DEZEMBRO DE 2013.

Esclarecimentos acerca do art.10, Inciso IX do Código ANBIMA
de Negociação de Instrumentos Financeiros.

O Conselho de Regulação e Melhores Práticas de Negociação de Instrumentos Financeiros (“Conselho de Negociação”), no exercício das atribuições a ele conferidas pelo Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas de Negociação de Instrumentos Financeiros (“Código”), em consulta aos seus membros realizada em 12 de dezembro de 2013;

CONSIDERANDO QUE:

As Instituições Participantes devem elaborar normas e procedimentos internos relacionados à negociação de instrumentos financeiros, contribuindo para a segurança das operações tratadas no Código;

INFORMA que para cumprimento do art. 10 inciso IX do Código, as normas e procedimentos internos elaborados pelas Instituições Participantes relacionados à negociação de Instrumentos Financeiros devem abarcar os seguintes itens mínimos:

1. Indicação dos produtos negociados;
2. Segmentação e atribuição de cada uma das mesas;
3. Descrição do processo para negociação de cada produto, devendo conter minimamente:
 - 3.1 Boletamento;
 - 3.2 Batimento com a contraparte;

3.3 Registro e liquidação nas *clearings*;

3.4 Sistemas (internos e externos) e plataformas de negociação envolvidas;

3.5 Forma de verificação:

- i. Dos limites de crédito e de mercado; e
 - ii. Das disponibilidades de liquidez e lastro;
4. Pontos de controle, devendo contemplar, minimamente, a metodologia para gerenciamento das etapas dos processos de negociação descritos, bem como os horários-limite de registro e liquidação previstos nos regulamentos de cada um dos sistemas/câmaras;
5. A Instituição Participante deve definir responsabilidade quanto à elaboração, à implantação, ao cumprimento, e a reavaliação das normas e procedimentos internos elaborados.

Este Parecer de Orientação entra em vigor na data da sua publicação.

São Paulo, 26 de dezembro de 2013.

Alfredo Menezes

**Presidente do Conselho de Regulação e Melhores Práticas de Negociação de Instrumentos
Financeiros**