



NÚCLEA

Relatório Divulgação
PFMI CPSS - IOSCO

Autoavaliação de aderência aos
Princípios para Infraestrutura
do Mercado Financeiro

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

Sumário

1. OBJETIVO.....	3
2. INSTITUIÇÃO	3
3. SUMÁRIO EXECUTIVO	3
4. VISÃO GERAL DA NÚCLEA	4
5. CONTEXTO - AUTOAVALIAÇÃO DOS PRINCÍPIOS	6
5.1. AUTOAVALIAÇÃO DOS PRINCÍPIOS	7
Principle 1 – Legal Basis	7
Principle 2 – Governance	8
Principle 3 – Framework for the comprehensive management of Risks	14
Principle 8 – Settlement finality	17
Principle 9 – Money settlement	18
Principle 12 – Exchange-of-value settlement systems	18
Principle 13 – Participant-default rules and procedures	19
Principle 15 – General Business Risk	21
Principle 16 – Custody and investment risks	23
Principle 17 – Operational Risk	24
Principle 18 – Access and participation requirements	28
Principle 19 – Tiered participation arrangements	29
Principle 20 – FMI links	31
Principle 21 – Efficiency and effectiveness	32
Principle 22 – Communication procedures and standards	33
Principle 23 – Disclosure of rules, key procedures, and market data	34
Principle 24 – Disclosure of Data	36
6. CONSIDERAÇÕES ADICIONAIS	37
7. CONTROLE DO DOCUMENTO.....	37

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

1. OBJETIVO

O presente documento tem o objetivo de divulgar a autoavaliação de aderência da CIP S.A. (Nome Fantasia: Núclea) aos Princípios para Instituições Operadoras de Sistema do Mercado Financeiro (IOSMFs) do *Committee on Payment and Settlement Systems* (CPSS) e *Technical Committee of the International Organization of Securities Commissions* (IOSCO).

Esta versão da autoavaliação do PFMI, elaborada em 2026, objetiva incorporar as atualizações nas atividades reguladas e visa a aplicação das práticas estabelecidas no Princípio 23, o qual trata de divulgação de regras, procedimentos chave e informações ao mercado.

Oportunamente, informamos que os princípios 4 (*Credit Risk*), 5 (*Collateral*) 6 (*Margin*), 7 (*Liquidity risk*), 10 (*Physical deliveries*), 11 (*Central Securities Depositories*) e 14 (*Segregation and Portability*), não são aplicáveis à Núclea, pois são princípios aplicáveis às contrapartes centrais e/ou para depositárias centrais de ativos. Atividades não desempenhadas pela Núclea.

2. INSTITUIÇÃO

Instituição respondente: CIP S.A. (Nome Fantasia: Núclea)

Órgão Regulador: Banco Central do Brasil (BCB)

Para maiores informações, por favor, contate a área de Relações com Investidores da Núclea, pelo endereço eletrônico ri@nuclea.com.br ou pelo telefone (11) 4632-7320.

3. SUMÁRIO EXECUTIVO

Os Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro (*Principles for Financial Market Infrastructures* – PFMI), atualmente constituídos por 24 (vinte e quatro) princípios, são normas internacionais para infraestruturas de mercado financeiro, sistemas de pagamentos, depósitos centrais de títulos, sistemas de liquidação de títulos, contrapartes centrais e repositórios de transações, publicados pelo Comitê de Sistemas de Liquidação e Pagamentos do Banco de Compensações Internacionais (CPSS/BIS) e o Comitê Técnico da Organização Internacional de Comissões de Valores (TC/IOSCO) do *Bank for International Settlement* (BIS).

Conforme estabelecido nos Comunicados nº 25.097, de 10 de janeiro de 2014, e nº 29.078, de 4 de fevereiro de 2016 e na Resolução CMN nº 4.952, de 30 de setembro de 2021, o BCB passou a utilizar os Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro do CPSS/BIS e IOSCO no monitoramento e na avaliação da segurança, eficiência, integridade e confiabilidade dos Sistemas de compensação e de liquidação integrantes do Sistema de Pagamentos Brasileiro, bem como dos registros e depósitos centralizados de ativos financeiros e de valores mobiliários. Importante ressaltar que os referidos princípios serviram de referência para a Resolução BCB nº 304/2023, a qual aprova o Regulamento que disciplina, no âmbito do Sistema de Pagamentos Brasileiro, o funcionamento dos sistemas de liquidação, o exercício das atividades de registro e de depósito centralizado de ativos

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

financeiros e a constituição de ônus e gravames sobre ativos financeiros registrados ou depositados, e consolida normas sobre a matéria.

A Núclea por possuir 2 (duas) Câmaras de Compensação e Liquidação (SITRAF e SILOC) e 1 (um) Sistema de Liquidação e Registro de Ativos (C3 Registradora), deve observar os PFMIs, bem como publicar em seu website, no mínimo, a cada dois anos o Relatório Divulgação PFMI CPSS-IOSCO, sendo que a publicação da última autoavaliação ocorreu em 2024, sendo o presente relatório de 2026, portanto, resultado da avaliação e atualização periódica.

4. VISÃO GERAL DA NÚCLEA

A CIP nasceu como associação civil sem fins lucrativos para integrar o Sistema de Pagamentos Brasileiro (SPB). Com isonomia e neutralidade, por mais de 20 (vinte) anos, desenvolveu soluções que promovem a evolução do mercado financeiro e o desenvolvimento da sociedade.

Sabendo ser possível ir além, criou a Núclea, possibilitando a expansão do leque de produtos. A Núclea é uma *Tech Company Digital* com capacidade de orquestrar dados, alavancando negócios em seu *core business* no setor financeiro e expandindo as fronteiras para outros setores, buscando, assim, maior competitividade, exercendo contínua transparência na condução de suas atividades, maior inclusão a partir de soluções digitais inovadoras e contribuindo para uma economia mais sustentável e moderna.

A Núclea tem como propósito construir conexões que geram valor e tem como visão ser reconhecida por ser a primeira escolha dos clientes no ecossistema de soluções de infraestrutura em transações digitais e inteligência de dados para empresas no Brasil.

As soluções e serviços oferecidos pela Núclea estão elencados a seguir, sendo as câmaras SITRAF, SILOC e C3 Registradora, consideradas infraestruturas de mercado financeiro segundo definição do BIS:

a) Na estrutura de Instituição Operadora de Sistema do Mercado Financeiro (IOSMF):

1. SITRAF – Sistema de Transferência de Fundos
 - i. Processo de compensação e liquidação das operações de transferências eletrônicas disponíveis (TED).
2. SILOC – Sistema de Liquidação Diferida das Transferências Interbancárias de Ordens de Crédito
Operacionalização do fluxo de dados para compensação e liquidação de boletos de pagamento, operação dos caixas eletrônicos (Tecban) e operações com cartão de crédito, cartão de débito e antecipação de recebíveis.
3. C3 Registradora – Sistema de registro de Contratos de Créditos Pessoal, Crédito Direto ao Consumidor (CDC) outros Bens, Financiamento de Veículos e Crédito Consignado para controle das operações de cessão e bloqueio, além da liquidação das cessões realizadas.

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

- i. Registradora Núcleo - Registro e Consulta de Recebíveis de Arranjo de Pagamento, Contratos de Antecipação Pré e Pós Contratada, Contrato de Ônus, Gravame e Cessão Definitiva, Registro e Baixa de Anuência, Conciliação de Registros, Gestão de Garantias, além de transacionar e auxiliar no efetivo funcionamento da Interoperabilidade.

b) Na estrutura de Negócios:

1. CTC – Central de Transferência de Crédito (Operações de Portabilidade de Contratos de Crédito);
2. Cheque Legal – Portal de Consulta para informações sobre cheques;
3. SCC – Serviço de Controle de Consignação (Centralização on-line do cálculo, Controle e Gestão da Consignação);
4. STD – Crédito da Nota Fiscal (Serviço de Transporte de Dados, Processamento e/ou Adequação de Arquivos Eletronicamente e Padronizado);
5. SLC – Serviço de Liquidação de Cartões (Destinado centralizar as informações necessárias para realização do crédito das operações de cartões na conta do usuário final);
6. PCR – Plataforma Centralizada de Recebíveis (Base Centralizada de Dados dos Boletos de Pagamentos);
7. PCPS – Plataforma Centralizada de Portabilidade de Salário (Operações de Portabilidade de Salário entre Instituições);
8. PCPO – Plataforma do Cadastro Positivo (Destinado a Transmissão e Processamento de Informações entre Fontes e GBD);
9. MCB – Monitoramento de Correspondente Bancário (Destinado a Monitorar os Correspondentes Bancários e Encaminhar às Instituições Consulentes Índice de Conformidade Atribuído);
10. SRCC – Serviço de Registro de Crédito Consignado (Destinado ao registro de eventos definidos pela Autorregulação do Crédito Consignado para consulta e subsídio na tomada de decisão para o comissionamento dos Correspondentes Bancários);
11. SECHUB (Destinado a prover serviços de cyber segurança aos participantes);

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

12. *Open Finance*; e

13. PCA – Plataforma Centralizada de Arrecadação (Tem como objetivo permitir que clientes de Bancos Digitais ou Instituições de Pagamentos façam pagamentos de guias de Arrecadação das concessionárias de água, luz, telefone e tributos públicos).

Importante ressaltar que a Núclea é detentora de duas certificações internacionais:

- a) Certificação ISO/IEC 27001:2013: Em 31 de julho de 2006 a Núclea recebeu a certificação ISO 27001:2005 atribuída pelo BSI (*British Standard Institute*).

Desde 31 de julho de 2015 a Organização passou a ser certificada na versão ISO 27001:2013, que trouxe a evolução na estrutura de gestão, maior foco em riscos e processos organizacionais, além de alinhamento com outras normas ISO como, por exemplo, a ISO 22301.

Em 2024, a Núclea realizou a recertificação do seu Sistema de Gestão de Segurança da Informação já considerando a versão mais atual da norma, a ISO/IEC 27001:2022. Em 2026, foi concluída a manutenção da certificação, reforçando a aderência contínua aos requisitos normativos.

A ISO 27001 é referência internacional em Segurança da Informação e reflete o compromisso da Núclea com a excelência nos serviços prestados, assegurando a confidencialidade, integridade e disponibilidade das informações.

- b) Certificação ISO 22301:2019: Em 17 de junho de 2013 a Núclea foi certificada na norma internacional de Continuidade de Negócios ISO 22301:2012.

Posteriormente, a instituição evoluiu para a versão ISO 22301:2019, consolidando seu Sistema de Gestão de Continuidade de Negócios. Em 2025, a Núclea realizou a recertificação dessa norma e, em 2026, concluiu a manutenção da certificação.

A adoção do Sistema de Gestão de Continuidade de Negócios assegura que a Núclea possui mecanismos estruturados para minimizar impactos negativos decorrentes de incidentes, desastres ou situações inesperadas, preservando vidas humanas e garantindo a continuidade dos serviços essenciais das Câmaras.

5. CONTEXTO - AUTOAVALIAÇÃO DOS PRINCÍPIOS

Conforme estabelecido no Princípio 23 do BIS, as IOSMFs devem publicar, regularmente, suas autoavaliações dos Princípios do CPSS/BIS e IOSCO, atendendo diretrizes definidas no documento CPSS- IOSCO - *Disclosure*

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

Framework for Financial Market Infrastructure.

Para atendimento a essa diretriz, a seguir seguem as respostas para cada um dos princípios aplicados a cada uma das IOSMFs operadas pela Núclea, de acordo com sua natureza:

- SILOC – *Payment System* (PS);
- SITRAF – *Payment System* (PS); e
- C3 Registradora – *Securities Settlement System* (SSS) e *Trade Repository* (TR).

5.1. AUTOAVALIAÇÃO DOS PRINCÍPIOS

Principle 1 –Legal Basis

An FMI should have a well-founded, clear, transparent, and enforceable legal basis for each material aspect of its activities in all relevant jurisdictions.

KC 1 - The legal basis should provide a high degree of certainty for each material aspect of an FMI's activities in all relevant jurisdictions.

Os serviços prestados pela Núclea, regulamentados pelo BCB, são restritos ao território nacional e aos Participantes do Sistema Financeiro Nacional. As atividades das IOSMFs são regulamentadas pela Lei nº 10.214/2001, pela Resolução CMN nº 4.952/2021 e Resolução BCB nº 304/2023.

As infraestruturas e diferentes procedimentos para a prestação de serviços de compensação, liquidação interbancária, cessão de crédito e registro são definidos e revisados conforme as regulamentações supracitadas, Regulamentos, aprovados pelo BCB, bem como frente aos documentos correlatos para cada Sistema, mecanismos de interoperabilidade, além de passar por inspeções periódicas por parte do Órgão Regulador.

KC 2 - An FMI should have rules, procedures, and contracts that are clear, understandable, and consistent with relevant laws and regulations.

As regras da Núclea estão fundamentadas em leis federais e normativos expedidos pelo Conselho Monetário Nacional (CMN) e BCB, sendo regulamentada e auditada pelo BCB. Os Regulamentos das câmaras são aprovados pelo BCB e formalizam as responsabilidades e atribuições dos Participantes dos Sistemas, conforme exigido pela Resolução BCB nº 304/2023. Os Manuais de Operações detalham o funcionamento de cada Sistema e descrevem processos operacionais relevantes que devem ser observados, tanto pela Núclea como pelo Participante. Os Contratos e Termo de Adesão, assinados pelos Participantes e Núclea, são elaborados pelo setor Jurídico e auditados regularmente, os quais definem claramente os direitos e responsabilidades atreladas ao acesso, confidencialidade e divulgação de informações, inclusive no sentido de que os Participantes e a Núclea se comprometem a cumprir os ditames da Lei nº 13.709/2018 (LGPD).

Por fim, a Núclea firma ainda convenções e manuais técnicos, que visam estabelecer as regras específicas

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

que são observadas no caso de interoperabilidades entre as IOSMFs.

KC 3 - An FMI should be able to articulate the legal basis for its activities to relevant authorities, participants, and, where relevant, participants' customers, in a clear and understandable way.

Os Regulamentos, Manuais de Operações, Contratos, Termo de Adesão, Fluxos de Funcionamento, Requisitos, Elegibilidade dos Sistemas e responsabilidades das partes envolvidas, estão disponíveis no sítio eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br>, em seção específica de cada infraestrutura para o acesso pelo Órgão Regulador, Participantes e público em geral, sendo revisados periodicamente e, quando cabível, submetidos ao BCB para ciência e aprovação prévia, quando de suas atualizações.

Além disso, também estão disponíveis no sítio eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br>, as informações estatísticas de cada Sistema, comunicados operacionais e de tarifas, publicados pela Núclea e destinados aos Participantes.

KC 4 - An FMI should have rules, procedures, and contracts that are enforceable in all relevant jurisdictions. There should be a high degree of certainty that actions taken by the FMI under such rules and procedures will not be voided, reversed, or subject to stays.

As regras que suportam o negócio da Núclea estão fundamentadas em leis federais, em normativos expedidos pelo CMN, BCB e no Código Civil. Adicionalmente, os Manuais de Operações e Regulamentos das infraestruturas do mercado financeiro operadas pela Núclea, documentos avaliados e aprovados pelo BCB, detalham as atividades, responsabilidades e direitos das partes envolvidas, além de todo o processo operacional que envolve o funcionamento destes serviços.

Os Contratos e Termo de adesão com os Participantes são elaborados pela Núclea e tem como objetivo garantir o cumprimento das exigências regulamentares, sendo os documentos que formalizam o aceite do Participante a todas as regras e documentos do respectivo Sistema, inclusive as penalidades (até mesmo de suspensão/exclusão) por eventuais inadimplementos de obrigações. Não sendo identificadas circunstâncias nas quais a Núclea possa ter seus Contratos, regras e procedimentos anulados, revertidos ou sujeitos a sobrestamentos.

Principle 2 – Governance

An FMI should have governance arrangements that are clear and transparent, promote the safety and efficiency of the FMI, and support the stability of the broader financial system, other relevant public interest considerations, and the objectives of relevant stakeholders.

KC 1 - An FMI should have objectives that place a high priority on the safety and efficiency of the FMI and explicitly support financial stability and other relevant public interest considerations.

A Núclea possui objetivos que buscam priorizar sua segurança, eficiência e estabilidade financeira bem como

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

outros interesses públicos relevantes. Com efeito, seu Estatuto Social dispõe que os membros do Conselho de Administração da Núclea devem exercer suas atribuições objetivando garantir a segurança, a estabilidade e a credibilidade da Núclea. Da mesma forma, cumpre ressaltar que o próprio objeto social da Núclea, conforme previsto no Estatuto Social, determina as relevantes funções da Núclea para o mercado financeiro nacional, demonstrando se tratar de empresa de relevante interesse público.

Para garantir o cumprimento dos objetivos da Núclea, são definidas e aprovadas no Conselho de Administração, anualmente, metas corporativas elegíveis para todos os funcionários. Além das metas corporativas, existem metas de equipes, aprovadas anualmente pela Diretoria, e avaliações de desempenho individuais, conduzidas entre gestores e cada integrante das equipes. As metas corporativas são organizadas em dimensões, de acordo com a sua relevância para o negócio.

Os objetivos estratégicos foram definidos com base na visão que a Núclea visa atingir: Somos reconhecidos por sermos a PRIMEIRA ESCOLHA DOS CLIENTES no ecossistema de soluções de infraestrutura em transações digitais e inteligência de dados para empresas do Brasil.

A partir do objeto social descrito no Estatuto, a Núclea define, formaliza e acompanha indicadores, metas corporativas e de equipes, de curto e longo prazo, aprovados anualmente pelo Conselho de Administração e Diretoria Estatutária, respectivamente, como forma de garantir que seu desempenho atenda os objetivos principais da Núclea.

A C3 Registradora, por ser considerada sistemicamente importante, segue regras e requisitos de processamento claramente definidos pelo BCB. Sendo assim, a Núclea prioriza a eficiência e segurança no processamento deste sistema. No que tange aos Sistemas SITRAF e SILOC, ainda que apresentem pouca relevância de mercado e baixo risco de impacto na estabilidade financeira, recebem o mesmo tratamento de prioridade na eficiência e segurança no processamento destinado a C3 Registradora. Esta prioridade está claramente definida nos indicadores de disponibilidade de Sistemas, satisfação dos clientes e manutenção das certificações de Segurança da Informação e Continuidade de Negócios.

Adicionalmente, como parte relevante das metas da organização e da avaliação de performance dos funcionários, a Núclea promove o pilar de Gestão de Riscos, que considera, dentre diversos outros fatores e métricas, a manutenção do nível de segurança da Organização e a alta disponibilidade dos serviços IOSMF.

KC 2 - An FMI should have documented governance arrangements that provide clear and direct lines of responsibility and accountability. These arrangements should be disclosed to owners, relevant authorities, participants, and, at a more general level, the public.

A Núclea mantém uma estrutura de governança robusta baseada nas melhores práticas do mercado e em conformidade com as normas dos órgãos reguladores: (i) Conselho de Administração; (iii) Diretoria Estatutária; e (iv) Comitês de Assessoramento ao Conselho que podem ser: (i) estatutários - Auditoria; Riscos, Controles Internos e Compliance; Transações com Partes Relacionadas; e Pessoas e Cultura; e (ii) não estatutários - Tecnologia; e Negócios e Inovação. As regras de governança corporativa da Núclea, estão previstas essencialmente nos seguintes documentos: (i) Estatuto Social; (ii) Regimento Corporativo; (iii) Regimento do

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

Conselho de Administração; (iv) Regimento das Diretorias; (v) Regulamento de Auditoria Interna; (vi) Regimentos Internos de cada Comitê; e (vii) Política de Governança Corporativa. Estes documentos estão disponíveis para consulta do público em geral, através do sítio eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br>.

A administração da Companhia cabe ao Conselho de Administração e à Diretoria Estatutária. O Conselho de Administração define as diretrizes e estratégias da Companhia, incluindo, mas não se limitando àquelas relacionadas à gestão de pessoas, riscos, monitoramento do desempenho da Núclea, continuidade de negócios e segurança da informação e cibernética, entre outras relacionadas no Estatuto Social. Já a Diretoria Estatutária é o órgão de representação e direção executiva da Companhia, cabendo-lhe, dentro da orientação traçada pelo Conselho de Administração, a condução dos negócios sociais, podendo e devendo praticar os atos necessários a tal fim. Todas as disposições referentes aos órgãos citados, tais como funções, responsabilidades e composição dos órgãos estão devidamente estabelecidos no Estatuto Social da Companhia e nos respectivos regimentos internos, com diretrizes balizadas nas boas práticas de governança corporativa (os documentos citados encontram-se no website da Núclea).

Deste modo, considerando que as responsabilidades estão descritas nos documentos supracitados, conclui-se que o arranjo de governança se encontra formalizado nestes documentos, definindo claramente as linhas de responsabilidades diretas e *accountability*, com publicação aos acionistas, às autoridades relevantes, aos clientes e ao público em geral.

Adicionalmente, as deliberações do Conselho de Administração são registradas em atas que ficam arquivadas na sede da Núclea, sendo que seus extratos registrados na JUCESP (Junta Comercial de São Paulo) e publicados em jornal de grande circulação, conforme previsão legal.

A Companhia realiza a prestação de contas aos seus acionistas, que são também clientes, através do Relatório da Administração e Demonstrações Financeiras. Tais documentos são levados à apreciação da Assembleia, publicados em jornal de grande circulação e registrados na JUCESP (Junta Comercial de São Paulo), dando visibilidade a todas as partes interessadas relevantes. As alçadas e responsabilidades na IOSMF, dos acionistas, clientes e de outros públicos de interesse relevantes estão documentadas formalmente no Estatuto Social, no Regimento Corporativo, nos Contratos mantidos entre Núclea e clientes (participantes nas convenções), nas Convenções, nos Regulamentos Operacionais e nos Manuais de Operações dos Sistemas, todos atualmente vigentes e já disponibilizados ao BCB quando assim exigido.

KC 3 - The roles and responsibilities of an FMI's board of directors (or equivalent) should be clearly specified, and there should be documented procedures for its functioning, including procedures to identify, address, and manage member conflicts of interest. The board should review both its overall performance and the performance of its individual board members regularly.

Os papéis e as responsabilidades do Conselho de Administração, do Presidente e Vice-Presidente do Conselho de Administração da Núclea estão pormenorizadamente especificados no Estatuto Social e no Regimento do Conselho de Administração, assim como os procedimentos para seu funcionamento.

O Estatuto Social da Núclea estabelece que os membros do Conselho de Administração e da Diretoria

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

Estatutária que estejam em situação de interesse pessoal conflitante deverão cientificar os demais membros do Conselho de Administração ou da Diretoria Estatutária sobre seu impedimento e fazer consignar, em ata de reunião do Conselho de Administração ou da Diretoria Estatutária, a natureza e a extensão do seu impedimento.

Quanto à avaliação dos órgãos de governança, há um processo aplicável ao Conselho de Administração e outro processo aplicável individualmente aos seus membros. Além disso, há mecanismos de avaliação dos Comitês de Assessoramento ao Conselho de Administração como um todo e de avaliação individual dos seus membros.

Os Regimentos Internos dos Comitês de Assessoramento dispõem sobre os procedimentos e diretrizes que norteiam a verificação de conflito de interesses. As informações pormenorizadas sobre este tema, poderão ser encontradas na Política de Governança Corporativa, disponível no sítio eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br>.

KC 4 - The board should contain suitable members with the appropriate skills and incentives to fulfil its multiple roles. This typically requires the inclusion of non-executive board member(s)

A Núclea é uma empresa referência em tecnologia e inteligência de dados. Ela é parte fundamental do maior ecossistema de soluções de infraestrutura em transações digitais do Brasil, com três sistemas autorizados pelo BCB (SITRAF, SILOC e C3 Registradora), tornando-a uma Companhia com desafios únicos. A participação em órgãos de governança de uma empresa como a Núclea garante ao membro oportunidade única de desenvolvimento profissional e intercâmbio de conhecimento permitindo-o transitar por diversos mercados que vão além do sistema financeiro nacional. Adicionalmente, os membros independentes do Conselho de Administração possuem remuneração competitiva, em linha com a prática de mercado, fixada nos termos da Política de Remuneração dos Administradores.

O Conselho de Administração é formado por membros que comprovam ser residentes no País, de ilibada reputação, reconhecida competência profissional, e declaram sua elegibilidade e desimpedimento nos termos dos normativos aplicáveis. Eles são eleitos pela Assembleia de acionistas, órgão soberano da Companhia. As habilidades profissionais e acadêmicas dos membros eleitos são confirmadas através de análise dos currículos disponibilizados.

Conforme definido no Estatuto Social, a eleição dos membros do Conselho de Administração dar-se-á pelo sistema de chapas, indicadas por qualquer acionista ou conjunto de acionistas. Na composição da chapa encaminhada para votação na Assembleia Geral, procura-se identificar pessoas com competências e experiências distintas, para que haja diversidade e o Conselho de Administração possa deliberar sobre os mais diversos assuntos inerentes à atividade da Núclea. Além dos membros indicados pelos acionistas, o Conselho de Administração ainda é composto por no mínimo 25% (vinte e cinco por cento) de membros independentes, cuja escolha visa selecionar os candidatos para os cargos de Conselheiros Independentes que não tenham relacionamento comercial com a Companhia e que tenham habilidade de exercer suas funções de forma objetiva e independente após justa consideração de todas as informações e visões relevantes e sem influência indevida de executivos ou de partes ou interesses externos inapropriados nos termos definidos na regulamentação e

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

legislação aplicável. Os candidatos são apresentados ao Conselho de Administração e, posteriormente, submetidos à eleição pela Assembleia Geral.

KC 5 - The roles and responsibilities of management should be clearly specified. An FMI's management should have the appropriate experience, a mix of skills, and the integrity necessary to discharge their responsibilities for the operation and risk management of the FMI.

As atribuições e responsabilidades da Diretoria Estatutária encontram-se pormenorizadamente descritas no Estatuto Social da Núclea e no Regimento das Diretorias, que estão publicados no sítio da Núclea. Todas as deliberações deste órgão são registradas em atas que ficam arquivadas na sede da Núclea.

Os papéis e responsabilidades são definidos através de metodologia de avaliação de cargos por pontos de acordo com a sua complexidade, habilidade e experiência necessária, e formalizados nas descrições de cargos dos funcionários da Núclea. A estrutura organizacional, representada pelo organograma, traz a composição das áreas dentro de toda a organização. O Conselho de Administração aprova o orçamento e o custo do *headcount* (HC) anual.

As metas corporativas de curto prazo são aplicáveis a todos os funcionários e são aprovadas pelo Conselho de Administração, no início de cada ano, com apuração e avaliação geral no início do ano seguinte. A Diretoria Estatutária, os Executivos e alguns gestores elegíveis, possuem, ainda, metas de longo prazo, que também são aprovadas pelo Conselho de Administração. As metas de equipes, aprovadas pela Diretoria Estatutária, permitem que ações específicas, desenvolvidas no âmbito das áreas corporativas, possam ser medidas e apuradas, e com base no resultado obtido, incrementam a bonificação de curto prazo.

A Diretoria Estatutária e os demais executivos da Núclea possuem o mix e a diversidade de competências e experiência necessárias para o gerenciamento operacional e de risco da IOSMF. Deliberações sobre o organograma administrativo-operacional da Núclea cabe à Diretoria Estatutária, conforme previsto no Regimento da Diretoria. Com relação à integridade das pessoas, há processo de Desenvolvimento Humano para incentivar o diálogo, especificamente sobre os valores individuais de cada profissional vs. os valores corporativos da Núclea, contemplados no Código de Ética e Conduta.

KC 6 - The board should establish a clear, documented risk-management framework that includes the FMI's risk-tolerance policy, assigns responsibilities and accountability for risk decisions, and addresses decision making in crises and emergencies. Governance arrangements should ensure that the risk-management and internal control functions have sufficient authority, independence, resources, and access to the board.

O Modelo de Gestão de Riscos (framework) estabelecido para Núclea está descrito na política e no manual de procedimento que definem as diretrizes e responsabilidades para identificar, avaliar, responder, comunicar e monitorar os riscos da Núclea. Os materiais descrevem o ciclo da gestão de riscos na Núclea, o qual está interligado aos demais processos de gestão da Instituição, possibilitando que esse instrumento seja efetivo e traga os benefícios esperados.

A Política de Riscos e Controles Internos da Núclea tem suas atualizações realizadas com periodicidade

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

mínima anual. As propostas de ajustes são analisadas previamente pelo Comitê de Riscos, Controles Internos e Compliance que emite sua recomendação de aprovação ao Conselho de Administração. Trata-se da efetiva aplicação do processo de gerenciamento dos riscos existentes nos negócios da Núcleo, que é realizado continuamente.

A estrutura de Governança da Gestão de Riscos e Controles Internos visa garantir que as funções que suportam as práticas de Gestão de Riscos sejam adequadas e em linha com as melhores práticas, possuindo suficiente autoridade, independência, recursos e acesso ao Conselho de Administração.

O Conselho de Administração exerce papel ativo no acompanhamento da exposição aos riscos da instituição, recebendo mensalmente dashboard executivo contendo a evolução dos principais riscos corporativos, indicadores de apetite a risco, eventos relevantes e respectivos planos de ação, fortalecendo seu papel de supervisão e direcionamento estratégico.

Cabe também mencionar o papel da Auditoria Interna que exerce atividade independente e objetiva de auditoria e de consultoria interna, desenhada para adicionar valor e melhorar as operações da organização. Ela auxilia a Núcleo a realizar seus objetivos a partir da aplicação de uma abordagem sistemática e disciplinada, emitindo avaliação independente a fim de melhorar a eficácia dos processos internos de gerenciamento de riscos, controle e governança.

Adicionalmente, a Núcleo contrata auditoria externa independente para auditar as Demonstrações Contábeis anuais, bem como emitir relatório de auditoria contendo sua opinião técnica. O trabalho é acompanhado pelo Comitê de Auditoria e conduzido, conforme normas brasileiras e internacionais de auditoria.

KC 7 - The board should ensure that the FMI's design, rules, overall strategy, and major decisions reflect appropriately the legitimate interests of its direct and indirect participants and other relevant stakeholders. Major decisions should be clearly disclosed to relevant stakeholders and, where there is a broad market impact, the public.

É responsabilidade do Conselho de Administração a análise da estratégia da Núcleo, levando em consideração o interesse dos stakeholders. A inclusão de conselheiros independentes no Conselho de Administração busca aumentar a transparência e capacidade da Núcleo em trazer para as discussões outros pontos de vistas para a tomada de decisão.

Por meio dos Grupos de Trabalho das Associações representativas de classe, Fóruns de Governança, Comitês de Assessoramento e Diretoria Estatutária, a Núcleo obtém informações relevantes que auxiliam no desenho dos fluxos operacionais, regras e definição de sua estratégia. Ademais, atualmente os acionistas da Núcleo são um conjunto de Instituições Financeiras, que compõem a Assembleia Geral, sendo este órgão responsável por eleger o Conselho de Administração e este por eleger os Comitês de Assessoramento e Diretoria Estatutária. Cabe ressaltar que os acionistas são também nossos clientes, o que permite a Companhia estar sempre atenta às considerações dos nossos participantes. Observa-se ainda que a Diretoria Estatutária implementou o programa de Centralidade no Cliente, proporcionando comunicação voltada a atender e entender seus clientes. A

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

comunicação ao público de interesse da Núclea é realizada de duas maneiras: Comunicação Institucional e, nos casos de caráter técnico/operacional, por meio de comunicados, através dos sistemas de governança corporativa, e-mails e informativos operacionais. A comunicação Institucional é disponibilizada no site da Núclea e/ou via e-mails aos clientes (direcionados aos responsáveis operacionais de cada instituição), já o informativo operacional, enviado aos responsáveis técnicos e operacionais dos clientes, também é disponibilizado no site da Núclea. Estes comunicados geralmente tratam de questões operacionais relacionadas aos Sistemas e calendários sistêmicos, e são publicados pelo Centro de Excelência a Clientes (CdE Clientes).

Importante informar que a plataforma de governança corporativa é o meio de comunicação interna dos comitês de assessoramento e Conselho de Administração, o qual registra e disponibiliza informações relevantes e estratégicas para administração da empresa.

Por fim, as atas das Reuniões do Conselho de Administração são lavradas e arquivadas na sede da Núclea. Deliberações destinadas a produzir efeitos perante terceiros são lavrados em atas registradas na Junta Comercial de São Paulo (JUCESP) e publicadas em jornal de grande circulação.

Principle 3 – Framework for the comprehensive management of Risks

An FMI should have a sound risk-management framework for comprehensively managing legal, credit, liquidity, operational, and other risks.

KC 1 - An FMI should have risk-management policies, procedures, and systems that enable it to identify, measure, monitor, and manage the range of risks that arise in or are borne by the FMI. Risk-management frameworks should be subject to periodic review.

A Gestão de Riscos visa garantir que as funções que suportam as práticas de gestão de riscos sejam adequadas e em linha com as melhores práticas, possuindo suficiente autoridade, independência, recursos e acesso ao Conselho de Administração. Compete à Diretoria, com assessoramento técnico dos Executivos responsáveis, definir a estrutura e os recursos necessários para que se estabeleça uma Gestão de Riscos eficaz, dê valor agregado ao negócio e forneça incentivos para seus Participantes (clientes) para gerenciar os riscos que podem expor a Instituição.

A Política de Riscos e Controles Internos define as diretrizes a serem seguidas no gerenciamento de riscos e controles da Núclea e estabelece que o ciclo de gestão de riscos corresponde à descrição das diversas atividades que são desenvolvidas para que o perfil de riscos seja gerado e comunicado para os diversos *stakeholders*. Esta Política é publicada para todos os funcionários da Instituição, por meio da Intranet Corporativa, sofre revisão com periodicidade mínima anual, devendo ser referendada pelo Comitê de Riscos, Controles Internos e *Compliance* e aprovada pelo Conselho de Administração da Núclea sempre que tiver alterações.

A metodologia que descreve os procedimentos, acerca das etapas da gestão de riscos da Núclea, é avaliada junto ao Comitê de Riscos, Controles Internos e *Compliance* da Instituição e divulgada aos gestores, com o intuito de ser uma ferramenta de suporte para o gerenciamento dos riscos, a qual propicia uma atuação integrada entre todas as linhas de defesa. Destaca-se que a referida ferramenta de governança, abrange os processos internos

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

da Núclea e o escopo de riscos acerca de projetos regulatórios e relevantes, com o registro dos riscos identificados nesses projetos e os respectivos planos de ação para mitigá-los.

Os riscos têm seu ambiente de controles avaliado periodicamente pelas linhas. Tal prática, permite que o processo de gerenciamento de riscos da Núclea seja contínuo e reflita as evoluções no mercado em que a instituição atua, permitindo um monitoramento contínuo dos riscos que podem trazer maiores impactos para a instituição.

A cultura de riscos é continuamente fortalecida por meio de treinamentos obrigatórios, campanhas de conscientização, programa de integridade, ações de comunicação institucional, acompanhamento de indicadores de conformidade e reforço permanente do compromisso da alta administração com a gestão responsável dos riscos. Adicionalmente, mecanismos de responsabilização e assunção formal de riscos são utilizados quando aplicável, fortalecendo a accountability dos gestores e o modelo das três linhas de defesa.

KC 2 - An FMI should provide incentives to participants and, where relevant, their customers to manage and contain the risks they pose to the FMI.

A Núclea oferece incentivos para que os Participantes possam diversificar os horários de liquidação do SITRAF, de maneira a diminuir a quantidade de liquidações nos horários de pico e, conseqüentemente, diminuir a possibilidade de falhas sistêmicas neste processo. Fora do horário de pico, as tarifas cobradas são menores, o que estimula a desconcentração em horários de pico, reduzindo o risco operacional.

Para o SILOC (que contempla o SLC), as grades de liquidação ocorrem em horários determinados e o não pagamento resulta na exclusão do Participante inadimplente naquele ciclo e no recálculo dos saldos multilaterais.

A C3 Registradora permite às instituições financeiras (IF) e aos fundos de investimento registrarem suas operações de cessão e bloqueio de contratos de crédito, de tal forma que um mesmo contrato não seja cedido mais de uma vez pela mesma IF ou oferecido como lastro em mais de uma operação.

Ainda, a Política de Riscos e Controles Internos estabelece que o ciclo de Gestão de Riscos Corporativos da Núclea corresponde à descrição das diversas atividades que são desenvolvidas para que o perfil de riscos seja gerado e comunicado para os diversos *stakeholders*. Esse ciclo está interligado aos demais processos de gestão da instituição, possibilitando que esse instrumento de gestão seja efetivo e traga os benefícios esperados.

No que tange à IOSMF, a Núclea mantém em seu sítio eletrônico <https://www.nuclea.com.br> todos os documentos relacionados aos seus serviços, os quais permitem aos Participantes e às partes interessadas efetuar o gerenciamento de seus riscos, relacionados a esse serviço, de forma eficiente e contínua.

KC 3 - An FMI should regularly review the material risks it bears from and poses to other entities (such as other FMIs, settlement banks, liquidity providers, and service providers) as a result of interdependencies and develop appropriate risk-management tools to address these risks.

Os riscos materiais de interdependência são identificados e monitorados seguindo as etapas de gerenciamento de riscos, conforme descrito na Política de Riscos e Controles Internos, sendo o mesmo processo utilizado para

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

os demais riscos materiais, no âmbito estratégico (riscos corporativos) e no âmbito tático e operacional (riscos de processos). A Política de Riscos e Controles Internos estabelece que o ciclo de Gestão de Riscos Corporativos da Núcleo corresponde à descrição das diversas atividades que são desenvolvidas para que o perfil de riscos seja gerado e comunicado para os diversos *stakeholders*. Esse ciclo está interligado aos demais processos de gestão da instituição, possibilitando que esse instrumento de gestão seja efetivo e traga os benefícios esperados.

A etapa de monitoração dos riscos ocorre por meio da Cobertura de Riscos, processo que prevê que os riscos tenham seus ambientes de controles internos avaliados periodicamente. Adicionalmente, os donos dos processos devem autoavaliar seus riscos e respectivos ambientes de controles periodicamente.

A Núcleo participa em conjunto com outras IOSMFs, de um grupo de trabalho para tratar, de forma coordenada, as questões relacionadas à gestão da continuidade de negócios, considerando as interdependências existentes entre as IOSMFs. As reuniões ocorrem periodicamente e o escopo consiste em mapear as interdependências entre as IOSMFs e os cenários de crise/contingências, bem como as relações com os Provedores de Serviços Críticos que possam impactar o Sistema de Pagamento Brasileiro.

Por fim, a Núcleo conta com uma estrutura de Auditoria Interna independente, com reporte ao Conselho de Administração. As atividades executadas pela 2ª linha são submetidas a auditorias periódicas pela auditoria interna, conforme definido no escopo e planejamento dessa área, documentado e publicado no Plano de Auditoria Interna aprovado anualmente pelo Conselho de Administração.

KC 4 - An FMI should identify scenarios that may potentially prevent it from being able to provide its critical operations and services as a going concern and assess the effectiveness of a full range of options for recovery or orderly wind-down. An FMI should prepare appropriate plans for its recovery or orderly wind-down based on the results of that assessment. Where applicable, an FMI should also provide relevant authorities with the information needed for purposes of resolution planning.

Como parte da estratégia de Continuidade de Negócios, a Núcleo considera como cenários críticos eventos de interrupção de funcionamento das infraestruturas C3 Registradora, SITRAF e SILOC e a indisponibilidade de um sítio de processamento de dados ou de ambiente corporativo.

Os processos críticos e seus respectivos tempos de recuperação foram definidos pelo resultado do *Business Impact Analysis* (BIA), e como definição, as equipes que atuam nestes processos devem atuar em sítios distintos, de acordo com cada estratégia de recuperação formalizada no BIA. Além disso, todos os processos da Núcleo possuem planos de recuperação, testados de acordo com o calendário de Testes e Exercícios PCN, o que permite maior agilidade na retomada de suas atividades.

Segundo o plano de continuidade de negócios, a configuração dos ambientes corporativos da Núcleo (2 ambientes ativo/ativo) permite a rápida retomada dos processos críticos, dentro dos *Recovery Time Objective* (RTO's) definidos. Em eventual necessidade de reconstrução de ambientes, ação que requer uma decisão estratégica em função de cenários variáveis e riscos associados, caberá à Diretoria e a Comissão executiva de crise a aprovação de decisão estratégica, após a retomada do funcionamento dos processos da IOSMF.

Por fim, a Núcleo desenvolveu o plano de recuperação para IOSMF, de acordo com os cenários relevantes.

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

Tal plano contempla a descrição dos serviços críticos, o plano de comunicação e governança, os indicadores de monitoramento e respectivos níveis críticos, a relação das ferramentas de recuperação e os cenários de estresse. Adicionalmente, há revisão periódica alinhada com exigência regulatória, ou sempre que ocorrer uma mudança relevante no cenário econômico-financeiro, nas estratégias de operação, no modelo de negócios, na estrutura organizacional ou nos processos críticos relacionados aos serviços ou soluções da Instituição Operadora de Sistema do Mercado Financeiro (IOSMF).

Principle 8 – Settlement finality

An FMI should provide clear and certain final settlement, at a minimum by the end of the value date. Where necessary or preferable, an FMI should provide final settlement intraday or in real time.

KC 1 - An FMI's rules and procedures should clearly define the point at which settlement is final.

Conforme Resolução BCB nº 304/2023, a liquidação financeira interbancária é definitiva quando efetuadas as resultantes movimentações nas contas Reservas Bancárias ou nas Contas de Liquidação mantidas no BCB. As Infraestruturas SITRAF, SILOC e C3 Registradora, possuem grade de liquidação definidas em seus Regulamentos e Manuais de Operações, bem como definem claramente a realização da liquidação interbancária em moeda do BCB e a certeza de liquidação, que para a C3 Registradora ocorre neste momento da transferência de titularidade; no SITRAF após aprovação da mensagem enviada pelo remetente, mediante saldo disponível, e enviada para o destinatário e no que tange ao SILOC ocorre em cada uma das Etapas de Transferência de Recursos no Momento de Liquidação, quando o saldo da conta de liquidação da Núcleo no STR, é transferido para a conta dos Participantes com saldo credor.

A Núcleo dispõe sobre a responsabilidade e obrigações dos Participantes dos Sistemas SITRAF, SILOC e C3 Registradora nos Regulamentos de cada Sistema e Condições Específicas da C3 Registradora, bem como, nos Contratos de prestação de serviços e Termo de Adesão, disponibilizados no sítio eletrônico da Núcleo <https://www.nuclea.com.br>. As penalidades para os Participantes estão dispostas nos documentos citados.

KC 2 - An FMI should complete final settlement no later than the end of the value date, and preferably intraday or in real time, to reduce settlement risk. An LVPS or SSS should consider adopting RTGS or multiple-batch processing during the settlement day.

Para as Infraestruturas SITRAF e SILOC, a liquidação é intradia, sendo que para o SITRAF, já considerado um Sistema LBTR (Liquidação Bruta em Tempo Real), a liquidação ocorre em dois horários, de modo que os Participantes com saldo devedor possam regularizar a pendência e finalizar as operações. Já para a C3 Registradora o processamento ocorre na modalidade Entrega contra Pagamento (EcP). O SILOC possui dois ciclos de liquidação, ambos no dia subsequente aos processamentos e compensações. O segundo ciclo, de acordo com o Manual de Operações, regulariza as inconsistências. Para o SLC, Sistema incorporado ao SILOC, também existem dois ciclos diários de liquidação.

As Infraestruturas estão parametrizadas para que a compensação preceda a liquidação e, caso o Participante

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

não realize o aporte financeiro a operação não é materializada, eximindo a Núcleo de riscos de liquidez. Portanto, de acordo com o modelo operacional da Núcleo e já considerando operação com Sistema LBTR (SITRAF), não há a necessidade de adotar mais processos LBTR ou multiple-batch para suas operações.

KC 3 - An FMI should clearly define the point after which unsettled payments, transfer instructions, or other obligations may not be revoked by a participant.

As Infraestruturas SITRAF, SILOC e C3 Registradora detalham em seus Regulamentos e Documentos Correlatos as etapas de liquidações, informações relevantes quanto a possibilidade de cancelamento ou desistência da operação, assim como informações e ações que podem ser tomadas em caso de emergências. Os documentos supracitados encontram-se no sítio eletrônico da Núcleo <https://www.nuclea.com.br>, com acesso público.

Principle 9 – Money settlement

An FMI should conduct its money settlements in central bank money where practical and available. If central bank money is not used, an FMI should minimise and strictly control the credit and liquidity risk arising from the use of commercial bank money.

KC 1 - An FMI should conduct its money settlements in central bank money, where practical and available, to avoid credit and liquidity risks.

As liquidações interbancárias realizadas pelas Infraestruturas SITRAF, SILOC e C3 Registradora utilizam as contas de liquidação custodiadas no BCB e são efetuadas em moeda do Regulador, pelo Sistema de Transferência de Reservas (STR).

Principle 12 – Exchange-of-value settlement systems

If an FMI settles transactions that involve the settlement of two linked obligations (for example, securities or foreign exchange transactions), it should eliminate principal risk by conditioning the final settlement of one obligation upon the final settlement of the other.

KC 1 - An FMI that is an exchange-of-value settlement system should eliminate principal risk by ensuring that the final settlement of one obligation occurs if and only if the final settlement of the linked obligation also occurs, regardless of whether the FMI settles on a gross or net basis and when finality occurs.

A C3 Registradora opera na modalidade EcP (Entrega Contra Pagamento), cuja transferência da titularidade do ativo negociado será feita mediante a compensação dos valores acordados. Para o serviço de liquidação junto as outras IOSMFs a Núcleo atuará com o mesmo processo da C3 Registradora, realizando liquidações brutas em tempo real (LTR), originada pelas IOSMFs.

O Regulamento anexo à Resolução BCB nº 304/2023, em seu art. 123 dispõe sobre a obrigatoriedade das

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

obrigações associadas serem mutuamente vinculadas. Esta regulamentação dá o amparo legal de que as duas obrigações ligadas, pagamento e entrega do ativo financeiro na C3, EcP, só ocorram se, e somente se, a obrigação ligada ocorrer.

Principle 13 – Participant-default rules and procedures

An FMI should have effective and clearly defined rules and procedures to manage a participant default. These rules and procedures should be designed to ensure that the FMI can take timely action to contain losses and liquidity pressures and continue to meet its obligations.

KC 1 - An FMI should have default rules and procedures that enable the FMI to continue to meet its obligations in the event of a participant default and that address the replenishment of resources following a default.

Os Regulamentos e Manuais de Operações do SILOC descrevem claramente para o mercado o tratamento a ser dado para as situações de inadimplência, e os manuais de procedimentos operacionais detalham, para as equipes internas da Núclea, as ações operacionais que devem ser adotadas nestas situações.

No SILOC, em caso de inadimplência, provocada por motivos técnicos, operacionais ou financeiros, o(s) participante(s) em situação de *default* será(ão) excluído(s) do cálculo dos saldos multilaterais e novo processamento será realizado (recálculo), com a apuração das novas posições multilaterais e consequente novo ciclo de pedido de depósitos, caso necessário. Neste sistema, o(s) participante(s) que porventura foi(ram) excluído(s) de um ciclo de liquidação poderá(ão) participar normalmente dos ciclos subsequentes, desde que permaneçam autorizados a funcionar, pelo BCB.

Para o SITRAF, não há possibilidade de inadimplência pelo Participante, uma vez que, o modelo de liquidação adotado (LBTR - Liquidação Bruta em Tempo Real) extingue a possibilidade de inadimplência, pois as ordens de transferências só são liquidadas mediante saldo disponível na conta do remetente. Assim, caso não existam recursos suficientes em sua conta exclusiva no SITRAF, as mensagens de pagamento enviadas serão mantidas enfileiradas, até que existam recursos para continuidade do processo ou rejeitadas no final do ciclo.

Não obstante os modelos adotados para cada solução, é válido mencionar que a Núclea possui fundo operacional e fundo de risco IOSMF, destinados a cobrir prejuízos provocados pela Núclea, decorrentes de falhas técnicas e operacionais em seus sistemas ou ambientes de processamento que podem ser utilizados a qualquer tempo, de acordo com procedimentos definidos e formalizados no normativo Plano de Riscos IOSMF.

KC 2 - An FMI should be well prepared to implement its default rules and procedures, including any appropriate discretionary procedures provided for in its rules.

Os Regulamentos e Documentos Correlatos do SILOC descrevem claramente para o mercado o tratamento a ser dado para as situações de inadimplência, e os manuais de procedimentos operacionais detalham, para as equipes internas da Núclea, as ações operacionais que devem ser adotadas nestas situações.

No SILOC, em caso de inadimplência, provocada por motivos técnicos, operacionais ou financeiros, o(s)

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

participante(s) em situação de default será(ão) excluído(s) do cálculo dos saldos multilaterais e novo processamento será realizado (recálculo), com a apuração das novas posições multilaterais e consequente novo ciclo de pedido de depósitos, caso necessário. Neste sistema, o(s) participante(s) que porventura foi(ram) excluído(s) de um ciclo de liquidação poderá(ão) participar normalmente dos ciclos subsequentes, desde que permaneçam autorizados a funcionar, pelo BCB.

Para o SITRAF, não há possibilidade de inadimplência pelo Participante, uma vez que, o modelo de liquidação adotado (LBTR - Liquidação Bruta em Tempo Real) extingue a possibilidade de inadimplência, pois as ordens de transferências só são liquidadas mediante saldo disponível na conta do remetente. Assim, caso não existam recursos suficientes em sua conta exclusiva no SITRAF, as mensagens de pagamento enviadas serão mantidas enfileiradas, até que existam recursos para continuidade do processo ou rejeitadas no final do ciclo.

Considerando a natureza das operações realizadas por meio da C3 Registradora (Cessão, Liquidação e Registro), por serem realizadas em modelo de entrega contra pagamento (EcP), não se aplicam regras e procedimentos de inadimplência dos participantes, uma vez que não há risco de inadimplemento.

Por fim, destaca-se que, o manual de procedimentos operacionais detalha, em caso de desvio, as ações que a área de CdE Clientes deve executar para gerenciamento e operação dos sistemas, inclusive com procedimentos de comunicação para todos seus públicos de interesse, incluindo participantes e o Órgão Regulador.

KC 3 - An FMI should publicly disclose key aspects of its default rules and procedures.

Todas as regras e procedimentos relacionados à inadimplência, quando aplicáveis, estão descritos nos Regulamentos e demais Documentos Correlatos dos Sistemas da Núclea. Estes documentos são de acesso público e estão disponíveis no sítio eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br>. Resta indicar que, todos os normativos e manuais da Núclea possuem ciclo periódico de revisão alinhado com exigência regulatória, porém, nada impede que exista uma revisão eventual, em função de alteração específica ou demanda regulatória relacionada aos procedimentos e conteúdos neles descritos. Os documentos permanecem armazenados em sistema de workflow específico e possuem responsáveis formalmente definidos pela sua revisão e aprovação.

KC 4 - An FMI should involve its participants and other stakeholders in the testing and review of the FMI's default procedures, including any close-out procedures. Such testing and review should be conducted at least annually or following material changes to the rules and procedures to ensure that they are practical and effective.

Para o Sistema SILOC, que em caso de inadimplência do Participante gera demanda operacional em virtude do reprocessamento dos saldos multilaterais, a Núclea realiza o exercício de inadimplência de Participante (Recálculo). Tais processamentos, estão descritos nos documentos Manual de Procedimentos Operacionais e Regulamento Operacional do sistema. Para os cenários de inadimplência no ambiente de produção do SILOC, a área de CdE Clientes possui procedimentos de acompanhamento que incluem:

1. Contato com a Instituição pendente de depósito (Piloto de Reservas e Diretor);
2. Contato com o BCB; e

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

3. Informa a Gestão da Núcleo sobre a pendência de depósito da Instituição.

Para o Sistema SITRAF não há testes relacionados à inadimplência, pois não há impacto nas operações ou no mercado financeiro, em caso de sua materialização.

Por fim, considerando a natureza das operações realizadas por meio da C3 Registradora (Cessão, Liquidação e Registro), por serem realizadas em modelo de entrega contra pagamento (EcP), não se aplicam regras e procedimentos de inadimplência dos participantes, uma vez que não há risco de inadimplemento.

Principle 15 – General Business Risk

An FMI should identify, monitor, and manage its general business risk and hold sufficient liquid net assets funded by equity to cover potential general business losses so that it can continue operations and services as a going concern if those losses materialise. Further, liquid net assets should at all times be sufficient to ensure a recovery or orderly wind-down of critical operations and services.

KC 1 - An FMI should have robust management and control systems to identify, monitor, and manage general business risks, including losses from poor execution of business strategy, negative cash flows, or unexpected and excessively large operating expenses.

A Núcleo identifica e monitora os principais riscos relacionados ao negócio, denominados riscos corporativos. Tais riscos são identificados em conjunto com a Diretoria e Executivos responsáveis, aprovados pelo Conselho de Administração e representam as principais preocupações da administração relacionadas a potenciais falhas em suas operações ou em impactos negativos que fatores externos possam trazer para a Núcleo, impedindo ou prejudicando o atendimento a seus objetivos.

Mensalmente, a equipe de Riscos da Núcleo apresenta os resultados das avaliações dos riscos corporativos aos órgãos de governança da Núcleo. Tais avaliações permitem verificar se os riscos corporativos estão aderentes ao apetite a risco definido pela Núcleo para cada uma das categorias de riscos.

Na metodologia de gestão de riscos está previsto o processo de registro e monitoração de perdas, atrelado à materialização de riscos, tal processo também serve de insumo para a gestão de caixa da Núcleo. Ressalta-se, no entanto, que hoje a Núcleo mantém em ativos líquidos valor superior ao montante necessário para cobrir eventuais perdas decorrentes da materialização de riscos operacionais, conforme cenários estabelecidos e quantificados no Plano de Recuperação, Capitalização e Saída Ordenada. Tal disponibilidade de caixa é monitorada pela equipe financeira, acompanhada pela gestão de riscos e reportada bimestralmente ao Comitê de Riscos, Controles Internos e Compliance, de assessoramento ao Conselho de Administração da Núcleo.

KC 2 - An FMI should hold liquid net assets funded by equity (such as common stock, disclosed reserves, or other retained earnings) so that it can continue operations and services as a going concern if it incurs general business losses. The amount of liquid net assets funded by equity an FMI should hold should be determined by its general business risk profile and the length of time required to achieve a recovery or orderly wind-down, as appropriate, of its

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

critical operations and services if such action is taken.

A Núclea elaborou Plano de Recuperação, Capitalização e Saída Ordenada, que foi construído pensando em cenários de riscos que teriam impactos significativos na continuidade de negócios da Núclea. Com base na descrição desses cenários, foi realizado um trabalho com diversas áreas da Organização para quantificar o valor financeiro que esses trariam de impacto à Núclea, considerando ainda o efeito desses impactos no fluxo de caixa da Organização por um período de 6 (seis) meses.

A exposição a riscos da Núclea é apurada mensalmente, por meio da medição de indicadores de risco aprovados pelo Conselho de Administração. Tais indicadores permitem verificar se tal exposição está dentro do apetite a riscos definido pelo Conselho de Administração, incluindo o apetite financeiro, que estabelece que a Núclea deve possuir recursos financeiros líquidos equivalentes ao valor necessário para cobrir seu pior cenário de risco, quantificado no Plano de Recuperação, Capitalização e Saída Ordenada, ou 6 (seis) meses de despesas operacionais da IOSMF, o que for maior. Atualmente o valor existente é superior ao estabelecido no apetite.

Ainda a Núclea constituiu um fundo estatutário, com o intuito de reservar o valor necessário para cobrir seu pior cenário de risco. Tal fundo foi denominado Fundo de Risco IOSMF e prevê que seu saldo só poderá ser utilizado em situações de materialização de riscos mediante a aprovação do Conselho de Administração. O saldo desse fundo é apurado mensalmente pela Núclea, acompanhado pela gestão de riscos e reportado às alçadas competentes e ao Conselho de Administração.

KC 3 - An FMI should maintain a viable recovery or orderly wind-down plan and should hold sufficient liquid net assets funded by equity to implement this plan. At a minimum, an FMI should hold liquid net assets funded by equity equal to at least six months of current operating expenses. These assets are in addition to resources held to cover participant defaults or other risks covered under the financial resources principles. However, equity held under international risk-based capital standards can be included where relevant and appropriate to avoid duplicate capital requirements.

A Núclea possui Plano de Recuperação, Capitalização e Saída Ordenada, atualizado em consonância com o recomendado no documento *Recovery of Financial Market Infrastructures* do BIS, onde constam os cenários críticos de riscos aos quais a Organização está sujeita, com seus respectivos impactos financeiros e o período estimado de recuperação, considerando as ferramentas e estratégias para tal.

O Plano de Recuperação, Capitalização e Saída Ordenada possui revisão periódica alinhada com exigência regulatória, ou sempre que ocorrer uma mudança relevante no cenário econômico-financeiro, nas estratégias de operação, no modelo de negócios, na estrutura organizacional ou nos processos críticos relacionados aos serviços ou soluções de IOSMF, e é referendado pelo Comitê de Riscos, Controles Internos e Compliance e aprovado pelo Conselho de Administração da Núclea.

KC 4 - Assets held to cover general business risk should be of high quality and sufficiently liquid in order to allow the FMI to meet its current and projected operating expenses under a range of scenarios, including in adverse market conditions.

Conforme detalhado na Política de Investimento Financeiro, os ativos líquidos vinculados ao patrimônio líquido

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

devem ser aplicados em ativos financeiros que apresentam baixo potencial de risco de mercado, crédito e liquidez. Desta maneira, os títulos selecionados para investimentos são representados por títulos públicos federais, preferencialmente em pós-fixados (LFT).

KC 5 - An FMI should maintain a viable plan for raising additional equity should its equity fall close to or below the amount needed. This plan should be approved by the board of directors and updated regularly.

A Núcleo possui Plano de Recuperação, Capitalização e Saída Ordenada, que é revisado periodicamente pelo Conselho de Administração, ou sempre que ocorrer uma mudança relevante no cenário econômico-financeiro, nas estratégias de operação, no modelo de negócios, na estrutura organizacional ou nos processos críticos relacionados aos serviços ou soluções da Instituição Operadora de Sistema do Mercado Financeiro (IOSMF).

O Plano de Riscos IOSMF, documento que compõe o Plano de Recuperação, Capitalização e Saída Ordenada, foi desenvolvido de modo a descrever o plano viável de capitalização da Núcleo, que trata da estratégia para recomposição do caixa da Núcleo no caso de ocorrência de eventos de estresse que possam comprometer a capacidade da Núcleo de arcar com suas obrigações.

De acordo com a Instrução Normativa (IN) de Fundos de Riscos, o Fundo de Risco IOSMF deverá conter recursos líquidos suficientes para implementar o Plano de Recuperação, Capitalização e Saída Ordenada, dessa forma, com o intuito de avaliar o real montante de reserva necessário para implementação de seu plano, a Núcleo desenvolveu cenários de estresses que buscaram contemplar os eventos que possam ameaçar a continuidade dos seus negócios e a viabilidade da Instituição. Tais cenários foram criados utilizando como referência os princípios e abordagens expostos no documento Principles for Financial Market Infrastructures do BIS-IOSCO e na Resolução CMN nº 5.187/2024.

Principle 16 – Custody and investment risks

An FMI should safeguard its own and its participants assets and minimise the risk of loss on and delay in access to these assets. An FMI's investments should be in instruments with minimal credit, market, and liquidity risks.

KC 1 - An FMI should hold its own and its participants' assets at supervised and regulated entities that have robust accounting practices, safekeeping procedures, and internal controls that fully protect these assets.

O capital especial e reservas estatutárias, incluindo o Fundo de Risco IOSMF, são compostos por títulos públicos em conta Selic alocados diretamente em nome da Núcleo. Destaca-se que a estratégia de investimentos da Núcleo estabelece investimento em títulos públicos federais, garantindo o menor risco.

KC 2 - An FMI should have prompt access to its assets and the assets provided by participants, when required.

Os investimentos da Núcleo são custodiados no Brasil, por meio de títulos públicos em conta Selic alocados diretamente em nome da Núcleo. Destaca-se que a estratégia de investimentos da Núcleo estabelece

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

investimento em títulos públicos federais, garantindo o menor risco.

KC 3 - An FMI should evaluate and understand its exposures to its custodian banks, taking into account the full scope of its relationships with each.

Os investimentos da Núcleo são compostos por títulos públicos em conta Selic alocados diretamente em nome da Núcleo. Destaca-se que a estratégia de investimentos da Núcleo estabelece investimento em títulos públicos federais, garantindo o menor risco.

KC 4 - An FMI's investment strategy should be consistent with its overall risk-management strategy and fully disclosed to its participants, and investments should be secured by, or be claims on, high-quality obligors. These investments should allow for quick liquidation with little, if any, adverse price effect.

A estratégia de investimentos da Núcleo estabelece investimento em títulos públicos em conta Selic alocados diretamente em nome da Núcleo. Os demais recursos de livre movimentação estão alocados em fundos exclusivos compostos por títulos públicos federais.

A divulgação dos seus investimentos, assim como outras informações financeiras, consta nos demonstrativos financeiros e estão disponíveis ao público por meio do site eletrônico da Núcleo <https://www.nuclea.com.br>.

Principle 17 – Operational Risk

An FMI should identify the plausible sources of operational risk, both internal and external, and mitigate their impact through the use of appropriate systems, policies, procedures, and controls. Systems should be designed to ensure a high degree of security and operational reliability and should have adequate, scalable capacity. Business continuity management should aim for timely recovery of operations and fulfilment of the FMI's obligations, including in the event of a wide-scale or major disruption.

KC 1 - An FMI should establish a robust operational risk-management framework with appropriate systems, policies, procedures, and controls to identify, monitor, and manage operational risks.

A Gestão de Riscos e Controles Internos visa garantir que as funções que suportam as práticas de gestão de riscos sejam adequadas e em linha com as melhores práticas, possuindo suficiente autoridade, independência, recursos e acesso ao Conselho de Administração.

A Política de Riscos e Controles Internos determina que a identificação dos riscos deve ser realizada considerando os procedimentos vigentes, os respectivos desenhos dos processos e os objetivos estratégicos da Núcleo. Os eventos que possam impedir ou reduzir a capacidade de realização dos objetivos estabelecidos pela instituição devem ser identificados. O documento é amparado por outras políticas e procedimentos internos que estabelecem meios de identificação de riscos provenientes de outras fontes como o Manual de Riscos e Controles Internos, que contempla a estrutura, os papéis e as responsabilidades na gestão de riscos e que descreve a metodologia de integração dos riscos de processos aos riscos corporativos, bem como a sensibilização da avaliação final dos riscos corporativos.

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

A etapa de identificação de riscos operacionais consiste no entendimento dos processos da Cadeia de Valor da Núclea com os responsáveis, na identificação e compreensão do contexto de risco do processo em questão, contemplando fontes de informações externas, e na análise dos documentos relacionados a esses processos, incluindo manuais. Os pontos de interação com os participantes e agentes externos identificados nessa análise são considerados na construção do dicionário de riscos da Núclea. Por fim, a Núclea dispõe de processo para identificar riscos oriundos de terceiros e originários de novas iniciativas e negócios, também descritos no Manual de Riscos e Controles Internos.

KC 2 - An FMI's board of directors should clearly define the roles and responsibilities for addressing operational risk and should endorse the FMI's operational risk-management framework. Systems, operational policies, procedures, and controls should be reviewed, audited, and tested periodically and after significant changes.

Os papéis e responsabilidades acerca da gestão de riscos são distribuídos na estrutura da Organização, auxiliando a gestão de riscos em diferentes níveis para que se estabeleça uma gestão eficaz, alinhada ao apetite a riscos, e forneça incentivos para seus profissionais gerenciarem os riscos que podem expor a Organização. A formalização relacionada às responsabilidades está refletida na Política de Riscos e Controles Internos, incluindo aquelas relacionadas a riscos operacionais.

Adicionalmente, a Núclea estabeleceu como processo que a Política de Riscos e Controles Internos deve ser referendada pelo Comitê de Riscos, Controles Internos e Compliance e aprovada pelo Conselho de Administração sempre que houver uma mudança significativa e o Regulamento Interno da Auditoria Interna, aprovado pelo Conselho de Administração e referendado pelo Comitê de Auditoria, define que o papel da Auditoria Interna no gerenciamento de riscos é avaliar se os processos e controles estabelecidos pela Núclea são eficazes para adequada identificação e avaliação dos riscos significativos.

KC 3 - An FMI should have clearly defined operational reliability objectives and should have policies in place that are designed to achieve those objectives.

A Núclea possui políticas e procedimentos formais e explícitos que estabelecem objetivos e diretrizes que conduzem as ações efetivas no cumprimento de seus objetivos.

Os níveis definidos para atingimento dos objetivos estão definidos em normativos e direcionamento da Alta Administração para o adequado atendimento a requisitos regulatórios e para atendimento de adequado nível de satisfação dos Participantes. Estas informações são apuradas periodicamente a partir de indicadores internos e de pesquisas quantitativas e qualitativas junto aos Participantes.

KC 4 - An FMI should ensure that it has scalable capacity adequate to handle increasing stress volumes and to achieve its service-level objectives.

São previstos testes de carga com o envolvimento dos processadores e reporte ao Órgão Regulador. Os testes de carga são auditados conforme rotação de ênfase estabelecida no Plano de Auditoria e atividades de follow-

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

up.

A Núcleo possui documento interno que descreve as atividades de gestão de capacidade de processamento e especifica as metodologias e os critérios utilizados para o cálculo dos volumes projetados. Este processo é executado anualmente junto aos processadores. Entretanto, mudanças na solução, sejam de origem física (equipamentos), lógica (software) ou de negócio, que podem ocorrer a qualquer momento, iniciam um processo de avaliação de impacto da necessidade de um novo teste de capacidade. A finalização deste processo ocorre com a execução dos planos acordados e a formalização dos novos acordos de níveis de serviço com os processadores, quando necessário.

KC 5 - An FMI should have comprehensive physical and information security policies that address all potential vulnerabilities and threats.

A Política de Segurança da Informação da Núcleo fornece diretrizes para garantir a disponibilidade, integridade, confidencialidade, legalidade, autenticidade e auditabilidade dos ativos de informação necessários ao negócio no âmbito da Núcleo. O Modelo de Operação da área de Segurança da Informação e Resiliência Cibernética da Núcleo foi construído baseado nos frameworks mundialmente conhecidos, como ISO 27001, ISO 22301, Cobit 5, NIST CSF, NIST SP 800.53, NIST Privacy Framework, CIS AWS e AWS Best Practice. A partir desse modelo, as linhas de defesa conduzem autoavaliação, testes de controles e atividades de asseguração para adequada gestão dos riscos relacionados.

A Núcleo é certificada pela British Standard Institute (BSI) nas normas ISO 27001:2019 e ISO 22301:2012. Essas normas são referência internacional para Segurança da Informação e Continuidade de Negócios e traduzem o esforço da Núcleo na busca pela excelência nos serviços prestados a seus clientes garantindo a segurança e continuidade de suas operações.

KC 6 - An FMI should have a business continuity plan that addresses events posing a significant risk of disrupting operations, including events that could cause a wide-scale or major disruption. The plan should incorporate the use of a secondary site and should be designed to ensure that critical information technology (IT) systems can resume operations within two hours following disruptive events. The plan should be designed to enable the FMI to complete settlement by the end of the day of the disruption, even in case of extreme circumstances. The FMI should regularly test these arrangements.

Os objetivos táticos e operacionais da Núcleo estão formalmente definidos, os quais podem ser identificados na Política de Continuidade de Negócios, no que tange aos objetivos táticos e operacionais. Para a priorização de recuperação de processos, a Núcleo construiu um BIA (Análise de impacto nos negócios), onde são definidos os processos críticos e respectivos tempos de recuperação (RTOs), considerando o cenário que envolve perda de pessoas e perda de instalações físicas. Em função da criticidade e da necessidade de rápida recuperação, as equipes que atuam nestes processos permanecem em locais físicos distintos por meio do trabalho remoto (home first), evitando a necessidade de locomoção em situações de ruptura.

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

O Calendário de Testes e Exercícios PCN prevê estes exercícios periódicos, que consistem na comutação entre ambientes, garantindo que os tempos formalizados nos planos relativos aos sistemas sejam cumpridos em uma situação real de ruptura. Para a garantia de recuperação dos sistemas e processos críticos em até duas horas, os sistemas de Liquidação da Núclea, possuem tempo de ativação de contingência de 30 (trinta) minutos.

A Núclea possui documentos específicos relacionados à gestão de crise e comunicação, interna e para os públicos de interesse, incluindo Órgão Regulador.

Para o gerenciamento das comunicações em situações de crise, a Núclea possui uma Comissão Operacional de Crises, composto pelos representantes (titular e suplente) da área de monitoramento de primeiro nível, comunicação e time da gestão de crise. Este comitê é responsável pela comunicação interna e externa (como coordenação de ações junto à mídia, por meio de Assessoria de Imprensa) sobre o andamento da crise, até sua conclusão.

Para situações específicas, relacionadas a problemas e interrupções parciais nos sistemas de negócios da Núclea, a área de CdE Clientes atua como área responsável pela comunicação junto aos públicos envolvidos, incluindo o Órgão Regulador.

KC 7 - An FMI should identify, monitor, and manage the risks that key participants, other FMIs, and service and utility providers might pose to its operations. In addition, an FMI should identify, monitor, and manage the risks its operations might pose to other FMIs.

Os riscos mais importantes que devem ser considerados pelos participantes são:

- Risco sistêmico;
- Risco de liquidez; e
- Risco operacional.

Todos os Participantes passam por um processo de análise de elegibilidade e de homologação antes de iniciarem a operação no ambiente de produção e os requisitos para adesão aos sistemas de liquidação da Núclea estão descritas no Manual de Acesso aos Sistemas IOSMF, disponível no sítio da Núclea <https://www.nuclea.com.br>.

Os sistemas são monitorados 24 horas por dia, 7 dias por semana e o manual de procedimentos operacionais detalha, em caso de desvio, as ações que a área de CdE Clientes deve executar para gerenciamento e operação dos sistemas, inclusive com procedimentos de comunicação para todos seus públicos de interesse, incluindo participantes e o Órgão Regulador.

Os principais riscos decorrentes de seus participantes são tratados no manual e regulamento dos sistemas da Núclea.

Com relação aos fornecedores, a Núclea possui um processo de homologação e re-homologação de fornecedores com critérios definidos em normativo interno com periodicidade de 12 (doze) e 24 (vinte e quatro) meses dependendo da criticidade do fornecedor. As diligências são realizadas no âmbito de Integridade, LGPD, Segurança da Informação/Continuidade de Negócios e Financeiro. O processo de homologação envolve análise

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

de questionários, pendências e restrições financeiras, cadastros e listas de restrições, mídias e processos, seguidos de conclusão com score de risco. Após análise, e a depender do score estabelecido, o fornecedor diligenciado é submetido a uma comissão avaliadora que delibera ou não pela parceria em questão ou pela definição de um plano de ação.

Principle 18 – Access and participation requirements

An FMI should have objective, risk-based, and publicly disclosed criteria for participation, which permit fair and open access.

KC 1 - An FMI should allow for fair and open access to its services, including by direct and, where relevant, indirect participants and other FMIs, based on reasonable risk-related participation requirements.

As regras sobre a adesão aos serviços do SITRAF, SILOC e C3 Registradora estão descritas nos Regulamentos e Documentos Correlatos dos Sistemas. Os Regulamentos e os Manuais de Operações estão disponíveis no sítio eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br> dando ampla publicidade a todos os públicos, além de viabilizar a isonomia entre Participantes e possibilidade de adesão de forma aberta. Ainda, a Núclea publica no mesmo sítio, os documentos de adesão, permitindo a avaliação de obrigações, riscos e regras de funcionamento dos Sistemas previamente, antes da formalização da adesão do Participante.

KC 2 - An FMI's participation requirements should be justified in terms of the safety and efficiency of the FMI and the markets it serves, be tailored to and commensurate with the FMI's specific risks, and be publicly disclosed. Subject to maintaining acceptable risk control standards, an FMI should endeavour to set requirements that have the least-restrictive impact on access that circumstances permit.

As regras que suportam o negócio da Núclea estão fundamentadas em leis federais, bem como, em normativos expedidos por órgãos reguladores. Da mesma forma, os requisitos para adesão e participação de instituições aos Sistemas da Núclea, seguem os princípios de segurança e eficiência exigidos pelo mercado e regulamentação vigente.

A Núclea pratica o princípio da isonomia para todos os Sistemas. Neste sentido, todos os Participantes necessitam cumprir os mesmos requisitos e procedimentos para acesso aos Sistemas. Depois de todos os requisitos atendidos, o Participante estará apto a utilizar os Sistemas da Núclea.

Os critérios para participação e adesão de novos Participantes, a documentação que estabelece a formalização desta adesão, os Regulamentos e Manuais de Operação, os Contratos, bem como o descritivo com o funcionamento de cada Sistema processado pela Núclea, estão disponíveis no seu sítio eletrônico <https://www.nuclea.com.br/>. O acesso ao sítio é público, e além dos documentos e instruções disponíveis, a Núclea também coloca à disposição do público, na Internet, um canal de comunicação Fale Conosco, criado com o objetivo de auxiliar e esclarecer dúvidas gerais sobre os produtos, Sistemas e sobre a Núclea.

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

KC 3 - An FMI should monitor compliance with its participation requirements on an ongoing basis and have clearly defined and publicly disclosed procedures for facilitating the suspension and orderly exit of a participant that breaches, or no longer meets, the participation requirements.

A Núclea realiza o monitoramento da conformidade de participantes com as regras de exigibilidade, bem como realiza de forma indireta a fiscalização do cumprimento pelos Participantes de suas obrigações e responsabilidades. Os direcionamentos de conduta externa de participantes estão descritos nos regulamentos operacionais dos sistemas, que trazem de forma clara as obrigações e responsabilidades dos participantes diretos e indiretos, penalidades e possibilidade de recurso para que as instituições possam fazer uso dos Sistemas. As regras para exclusão e suspensão de participantes são formalizadas nos regulamentos dos Sistemas da Núclea e estão publicados no site da Núclea <https://www.nuclea.com.br>. Além disso, o participante pode solicitar sua saída voluntária mediante notificação, desde que tenha efetuado o pagamento de todas as despesas, conforme previsto em contrato de prestação de serviços.

Além dos Regulamentos, a Núclea dispõe de procedimentos e checklists internos que descrevem as atividades relacionadas à saída ordenada de participantes de seus sistemas, seja em função de descumprimento dos requisitos de participação, ou por saída voluntária.

Principle 19 – Tiered participation arrangements

An FMI should identify, monitor, and manage the material risks to the FMI arising from tiered participation arrangements.

KC 1 - An FMI should ensure that its rules, procedures, and agreements allow it to gather basic information about indirect participation in order to identify, monitor, and manage any material risks to the FMI arising from such tiered participation arrangements.

A Núclea dispõe de regras, procedimentos e instrumentos contratuais aplicáveis aos sistemas C3 e SILOC, que permitem identificar a estrutura de participação de seus Participantes, incluindo, quando aplicável, arranjos de participação indireta.

No âmbito dos processos de adesão, manutenção cadastral e operação dos sistemas, são coletadas e mantidas informações sobre os Participantes e suas relações de participação, proporcionando visibilidade sobre as estruturas de acesso e atuação nos ambientes operados pela Núclea.

Essas informações subsidiam as atividades de monitoramento e gestão dos riscos relevantes para os sistemas administrados pela Núclea, observadas as características e especificidades de cada serviço. Adicionalmente, a Núclea realiza avaliações periódicas de seus processos e controles, buscando assegurar sua adequação e efetividade em relação aos riscos eventualmente associados a arranjos de participação indireta.

Este KC não se aplica ao SITRAF.

KC 2 - An FMI should identify material dependencies between direct and indirect participants that might affect the FMI.

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

A Núclea dispõe de regras, procedimentos e mecanismos que permitem identificar as relações entre Participantes diretos e indiretos nos sistemas C3 e SILOC, observadas as características e modelos operacionais de cada serviço.

No processo de adesão e durante o relacionamento com os Participantes, são coletadas e mantidas informações sobre as estruturas de participação e os vínculos existentes entre os agentes que acessam os sistemas operados pela Núclea. Essas informações proporcionam visibilidade sobre potenciais interdependências relevantes para a operação dos sistemas.

O monitoramento dessas estruturas integra as atividades de gestão de riscos e suporte operacional da Núclea, contribuindo para a identificação e avaliação de eventuais dependências que possam impactar os sistemas administrados. Adicionalmente, a Núclea revisa periodicamente seus processos e controles, buscando assegurar a adequada compreensão e gestão dos riscos associados aos diferentes modelos de participação.

Este KC não se aplica ao SITRAF.

KC 3 - An FMI should identify indirect participants responsible for a significant proportion of transactions processed by the FMI and indirect participants whose transaction volumes or values are large relative to the capacity of the direct participants through which they access the FMI in order to manage the risks arising from these transactions.

A Núclea dispõe de regras, procedimentos e mecanismos de monitoramento aplicáveis à C3 e ao SILOC que permitem identificar os Participantes diretos e indiretos, bem como compreender as respectivas estruturas de participação nos sistemas.

No âmbito dos processos de adesão, cadastro e operação, são mantidas informações sobre as relações entre Participantes Principais e Participantes Administrados, proporcionando visibilidade sobre os arranjos de participação indireta existentes nos sistemas. Essas informações contribuem para a identificação de concentrações relevantes de atividade e para a avaliação de potenciais impactos operacionais decorrentes dessas estruturas.

Adicionalmente, a Núclea realiza o monitoramento dos serviços e do processamento das transações sob sua responsabilidade, observadas as características e os modelos operacionais da C3 e do SILOC. As informações obtidas por meio desses processos subsidiam as atividades de gestão de riscos e a avaliação contínua da adequação dos controles adotados em relação aos arranjos de participação indireta.

Este KC não se aplica ao SITRAF.

KC 4 - An FMI should regularly review risks arising from tiered participation arrangements and should take mitigating action when appropriate.

A Núclea realiza avaliações periódicas dos riscos relacionados aos seus sistemas e aos modelos de participação adotados, incluindo, quando aplicável, os arranjos de participação indireta observados na C3 e no SILOC.

As informações obtidas nos processos de adesão, manutenção cadastral, monitoramento operacional e gestão de riscos permitem à Núclea acompanhar as estruturas de participação existentes e avaliar potenciais impactos

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

decorrentes das relações entre Participantes Principais e Participantes Administrados.

Com base nessas avaliações, a Núclea pode adotar medidas de mitigação consideradas apropriadas, observadas as características, responsabilidades e limites de atuação definidos nos regulamentos, manuais e demais instrumentos aplicáveis a cada sistema.

Adicionalmente, os processos e controles relacionados aos arranjos de participação são objeto de revisão contínua, visando assegurar sua adequação à evolução dos serviços, dos riscos e das estruturas de participação observadas nos sistemas administrados pela Núclea.

Este KC não se aplica ao SITRAF.

Principle 20 – FMI links

An FMI that establishes a link with one or more FMIs should identify, monitor, and manage link-related risks.

KC 1 - Before entering into a link arrangement and on an ongoing basis once the link is established, an FMI should identify, monitor, and manage all potential sources of risk arising from the link arrangement. Link arrangements should be designed such that each FMI is able to observe the other principles in this report.

O serviço de liquidação oferecido pela C3 Registradora prevê a assinatura de instrumentos jurídicos para habilitar o serviço de liquidação junto a outras infraestruturas do mercado financeiro com viés de aceitação, movimentação e liquidação de garantias.

Para o serviço de liquidação junto às outras IOSMFs, a Núclea atuará com o mesmo processo da C3 Registradora, realizando liquidações brutas em tempo real (LTR), originada pelas IOSMFs.

No que se refere ao R2C3 (registradora de recebíveis de cartão), a identificação de riscos associados a links entre infraestruturas ocorre por meio da análise estruturada do modelo de comunicação bilateral definido no Manual Técnico de Interface entre Sistemas, que faz parte da Convenção entre Registradoras do Ecossistema de Registro de Recebíveis de Cartão, que estabelece requisitos arquiteturais, operacionais e de validação de dados para todas as signatárias, tais como:

- a) Avaliação da arquitetura e modelo de conectividade
- b) Controle de rastreabilidade e integridade das transações
- c) Validação estruturada de dados (payloads)
- d) Processos operacionais padronizados
- e) Tratamento formal de erros e exceções
- f) Controles de temporalidade e integridade da informação

A decisão de estabelecer ou manter um link de interoperabilidade considera o nível de aderência da contraparte aos controles definidos no manual técnico, acima destacados, e somente é realizado entre IOSMFs autorizadas pelo Banco Central do Brasil a participarem do ecossistema, que depende de realização de testes

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

homologatórios que comprovam a aptidão técnica e jurídica da IOSMF signatária da Convenção. Por fim, cabe destacar que a responsabilidade pela integridade da informação incluída no sistema é do Participante (credor ou credenciadora), de modo que cada IOSMF tem dever de monitoramento e supervisão de Participantes com os quais mantém conexão operacional ativa.

Sinalizamos que este KC não se aplica ao SITRAF e nem ao SILOC.

KC 2 - A link should have a well-founded legal basis, in all relevant jurisdictions, that supports its design and provides adequate protection to the FMIs involved in the link.

Os links da C3 Registradora, inclusive da Câmara de Liquidação, são estabelecidos no Brasil.

A estruturação do link entre Núcleo e a IOSMF Parceira é realizada por empresas brasileiras e estão sujeitas à jurisdição brasileira, onde prestarão este serviço e onde será estabelecido o arcabouço jurídico firmado. Destacando-se as seguintes normas: Lei nº 12.810/2013 e dos textos incluídos pela Lei nº 13.476/17 e Lei nº 10.214/01; Resolução BCB nº 304/2023, bem como os §§ 1º e 2º do Art. 10 da Medida Provisória nº 2.200-2/2001, que conferem validade jurídica aos documentos e declarações produzidos em processos utilizando a certificação da ICP-Brasil ou com a utilização de outro meio de comprovação da autoria e integridade de documentos em forma eletrônica, inclusive os que utilizem certificados não emitidos pela ICP-Brasil, desde que admitido pelas partes como válido.

KC 9 - A TR should carefully assess the additional operational risks related to its links to ensure the scalability and reliability of IT and related resources.

A Núcleo monitora seus Sistemas e, identificando intermitência ou problemas operacionais no sítio principal, passa a processar seus Sistemas a partir do sítio de contingência.

Por ser uma Câmara de Ativos, com significativa contribuição para a segurança, integridade e transparência do Sistema Financeiro Nacional, o BCB define a C3 Registradora como Câmara sistemicamente importante, com índice de disponibilidade mínimo de 99,8% (noventa e nove, oito por cento).

Todos os eventos que envolvem a Câmara de Liquidação também são suportados por instrumentos jurídicos, bem como, seus processos e procedimentos detalhados nos Documentos do Produto (Regulamento e Documentos Correlatos).

Assim como a Núcleo, os meios de comunicação com a IOSMF Parceira possuem contingência e são monitorados pela equipe de infraestrutura de TI da Núcleo, a fim de reduzir riscos de indisponibilidade de comunicação.

Principle 21 – Efficiency and effectiveness

An FMI should be efficient and effective in meeting the requirements of its participants and the markets it serves.

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

KC 1 - An FMI should be designed to meet the needs of its participants and the markets it serves, in particular, with regard to choice of a clearing and settlement arrangement; operating structure; scope of products cleared, settled, or recorded; and use of technology and procedures.

A Núclea possui mecanismos para avaliação periódica do nível de satisfação dos seus Participantes (clientes).

Adicionalmente, a Núclea atua e colabora nos GTs promovidos por associações de bancos, onde são discutidas oportunidades de melhoria e novas funcionalidades para Sistemas existentes ou novas soluções que necessitam ser implantadas, para atendimento às demandas de mercado.

A atuação e colaboração da Núclea nos grupos de trabalho do BCB e das associações de classes (por exemplo, FEBRABAN, ABECS, ABBI, ABBC) permite que a IOSMF avalie continuamente a aderência de seus serviços e Sistemas, arquitetura tecnológica, estrutura operacional, entre outros, para que estejam aderentes às determinações do Órgão Regulador e as necessidades do mercado.

KC 2 - An FMI should have clearly defined goals and objectives that are measurable and achievable, such as in the areas of minimum service levels, risk-management expectations, and business priorities.

A Núclea monitora alguns indicadores para medir e assegurar que seus Sistemas estão de acordo com as normas do BCB. Por meio do Manual dos Principais Indicadores de Desempenho, a Núclea tem definido seus principais indicadores para os Sistemas os quais opera, como as metas de disponibilidade de Sistemas, satisfação dos Clientes, manutenção das certificações de Segurança da Informação e Continuidade de Negócios bem como o cumprimento do calendário de exercícios do PCN.

KC 3 - An FMI should have established mechanisms for the regular review of its efficiency and effectiveness.

A Núclea monitora alguns indicadores para medir e assegurar que seus Sistemas estão de acordo com as normas do BCB. Por meio do Manual dos Principais Indicadores de Desempenho, a Núclea tem definido seus principais indicadores para os Sistemas os quais opera, como as metas de disponibilidade de Sistemas, satisfação dos Clientes, manutenção das certificações de Segurança da Informação e Continuidade de Negócios bem como o cumprimento do calendário de exercícios do PCN.

Os processos são monitorados diariamente e os indicadores publicados periodicamente.

Durante o período de avaliação, as infraestruturas operadas pela Núclea mantiveram níveis de disponibilidade superiores às metas corporativas e regulatórias estabelecidas, com acompanhamento periódico de indicadores de desempenho operacional, capacidade de processamento, satisfação dos participantes, testes de continuidade de negócios e efetividade dos controles internos. Os resultados observados demonstram a eficácia da estrutura de governança, gestão de riscos e resiliência operacional adotada pela instituição.

Principle 22 – Communication procedures and standards

An FMI should use, or at a minimum accommodate, relevant internationally accepted communication

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

procedures and standards in order to facilitate efficient payment, clearing, settlement, and recording.

KC 1 – An FMI should use, or at a minimum accommodate, internationally accepted communication procedures and standards.

A Núclea e os demais clientes/participantes da C3 Registradora, SITRAF e SILOC possuem interligação para liquidação das operações, exclusivas com o STR (Sistema de Transferência de Fundos), o qual utiliza os padrões técnicos das redes que suportam o tráfego de dados para a comunicação eletrônica do Sistema Financeiro Nacional (RSFN), descrito no Catálogo de Serviços do SFN (padrão do SPB) e Manual de Redes e Segurança do SFN.

Principle 23 – Disclosure of rules, key procedures, and market data

An FMI should have clear and comprehensive rules and procedures and should provide sufficient information to enable participants to have an accurate understanding of the risks, fees, and other material costs they incur by participating in the FMI. All relevant rules and key procedures should be publicly disclosed.

KC 1 – An FMI should adopt clear and comprehensive rules and procedures that are fully disclosed to participants. Relevant rules and key procedures should also be publicly disclosed.

A Núclea disponibiliza em seu site eletrônico <https://www.nuclea.com.br/> todos os documentos com as regras e procedimentos de funcionamento da SITRAF, SILOC e C3 Registradora. Os Regulamentos, Manuais de Operações, Cenários de Testes e Requisitos para Adesão aos Sistemas são exemplos de documentos disponíveis para o público.

Os Manuais e Regulamentos dos Sistemas SITRAF, SILOC e C3 Registradora contemplam os procedimentos, regras, etapas de processamentos, riscos, sanções, entre outras informações pertinentes à operação da Núclea. Os documentos estão disponíveis para acesso público no site eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br/>, os quais dispõem sobre os procedimentos que os participantes devem seguir, em situações normais e de exceção.

Assim que os participantes ou público em geral tomam contato com a documentação publicada, existem canais de comunicação implantados para esclarecimento de dúvidas ou obtenção de mais detalhes sobre determinado documento. Ademais, a manifestação recebida por um destes canais, em assuntos referentes à qualidade de documentos publicados, é utilizada para que a Núclea promova a revisão de seus documentos, seja pelo motivo de correção ou para melhor esclarecimento sobre determinado assunto.

KC 2 – An FMI should disclose clear descriptions of the system's design and operations, as well as the FMI's and participants' rights and obligations, so that participants can assess the risks they would incur by participating in the FMI.

Estão disponibilizados no site eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br/>, os Regulamentos que regem os procedimentos no âmbito de cada Sistema e os Manuais de Operações, cujo objetivo é descrever os

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

procedimentos que os Participantes deverão realizar para se adequar a cada Sistema e ainda detalhar os processos das Câmaras. Cabendo destacar que, após a publicação de um novo documento, ou atualização de um documento existente, a Núclea comunica a todos os clientes do sistema envolvido, através de Comunicado e Informativos que também são publicados no site.

A Núclea dispõe sobre a responsabilidade e obrigações dos Participantes dos Sistemas SITRAF, SILOC e C3 Registradora nos seus Manuais, Regulamentos, assim como nos Contratos de prestação de serviços e Termo de Adesão. Os documentos estão no sítio eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br/>.

KC 3 – An FMI should provide all necessary and appropriate documentation and training to facilitate participants' understanding of the FMI's rules and procedures and the risks they face from participating in the FMI.

A Núclea facilita a compreensão pelos Participantes das regras e dos procedimentos da entidade e dos riscos associados à sua participação, por meio da efetiva comunicação junto aos clientes e disponibilização de documentos técnicos para adesão. A Núclea dispõe de documentação suporte, como regras e procedimentos em seu sítio eletrônico <https://www.nuclea.com.br/>, cujo acesso é público, bem como podem ser questionadas à estrutura do CdE Clientes para eventuais entendimentos adicionais.

Na adesão de um novo Participante, a Núclea realiza ações definidas no documento Plano Homologatório, que é conduzido pelo CdE Clientes da Núclea, cujo objetivo é acompanhar o processo de homologação junto ao Participante. A documentação que deve ser utilizada como referência para o processo homologatório está disponível no sítio eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br/>.

Já no ambiente de produção, na identificação de algum comportamento inadequado de um Participante, a Núclea adota medidas preventivas e corretivas. Além do processo de homologação, os Regulamentos dos Sistemas deixam claro todas as responsabilidades do Participante e da Núclea, entre elas, a responsabilidade do envio correto das informações para processamento, pelo Participante, além das penalidades previstas para todos os Sistemas.

KC 4 – An FMI should publicly disclose its fees at the level of individual services it offers as well as its policies on any available discounts. The FMI should provide clear descriptions of priced services for comparability purposes.

As taxas anuais ou únicas para adesão nos Sistemas SITRAF, SILOC e C3 Registradora, constam, de acordo com os respectivos Contratos de prestação de serviços e Termo de Adesão, bem como nos comunicados de tarifas, divulgados e disponibilizados no sítio eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br/>. Nos comunicados de tarifas, são detalhadas todas as regras de cobrança, valores individuais para cada tipo de transação (quando aplicável), exceções e prazo de vigência das referidas tarifas.

A Núclea não possui uma política específica sobre descontos aplicados aos serviços prestados. Especificamente para o SITRAF existe uma variação nos valores de tarifas, em função do horário em que o Participante envia suas mensagens para processamento. Esta medida tem como objetivo a mitigação de risco sistêmico e aumento da liquidez para os Participantes, uma vez que as tarifas com menor valor incidem sobre as

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

primeiras horas do dia.

As informações sobre as tarifas/taxas ficam registradas nos contratos de prestação de serviços, assinados entre a Núclea e o Participante, e nos comunicados de tarifas, divulgados para os Participantes, disponibilizados no sítio eletrônico da Núclea <https://www.nuclea.com.br/>. Nos comunicados de tarifas, são detalhadas todas as regras de cobrança, valores individuais para cada tipo de transação (quando aplicável), exceções e prazo de vigência das referidas tarifas.

KC 5 – An FMI should complete regularly and disclose publicly responses to the CPSS-IOSCO disclosure framework for financial market infrastructures. An FMI also should, at a minimum, disclose basic data on transaction volumes and values.

A Núclea publica, regularmente, em seu sítio eletrônico <https://www.nuclea.com.br/> outras informações, como estatísticas e volumes processados nos Sistemas SITRAF, SILOC e C3 Registradora.

A navegação no sítio eletrônico da Núclea https://www.nuclea.com.br está disponível na língua portuguesa, assim como os documentos nele publicados.

Principle 24 – Disclosure of Data

A TR should provide timely and accurate data to relevant authorities and the public in line with their respective needs.

KC 1 – A TR should provide data in line with regulatory and industry expectations to relevant authorities and the public, respectively, that is comprehensive and at a level of detail sufficient to enhance market transparency and support other public policy objectives.

A Núclea disponibiliza aos Reguladores, participantes e público em geral, todos os dados pertinentes à sua operação, com o objetivo de manter a transparência perante o mercado, bem como de assegurar que a comunicação atinja seus públicos de interesse de forma clara e objetiva, em uma linguagem comumente utilizada. Além dos dados, a Núclea disponibiliza em seu sítio eletrônico <https://www.nuclea.com.br/> a documentação do sistema que auxilia os usuários compreenderem e interpretarem os dados corretamente.

KC 2 – A TR should have effective processes and procedures to provide data to relevant authorities in a timely and appropriate manner to enable them to meet their respective regulatory mandates and legal responsibilities.

A Núclea cumpre os Regulamentos e demais Documentos Correlatos, além das Convenções de cada Sistema, e atende os prazos determinados pelo Regulador. A partir dessas perspectivas legais, operacionais e tecnológicas, atende às necessidades dos Participantes e do Órgão Regulador para que possam cumprir seus mandatos regulatórios e responsabilidades legais.

A partir do início das operações como uma Registradora, a C3 Registradora passou a contar com dois novos mecanismos para prover informações ao BCB, de forma a auxiliar no cumprimento de suas atribuições com o

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

Regulador: i) Detecção e reporte ao BCB das operações fora de padrão; e ii) fiscalização indireta. Além destes mecanismos para prover informações sobre os ativos registrados na Registradora, também foi implantada uma rotina de conciliação mensal dos registros da C3 com os reportes realizados pelos Participantes ao BCB, de modo a permitir a apuração de eventuais operações não registradas na C3.

Periodicamente, a Núclea envia ao BCB as estatísticas de processamento, dados quantitativos de cessões de contratos, parcelas negociadas nestas cessões, valores correspondentes e demais dados referentes às operações realizadas na infraestrutura C3 Registradora.

KC 3 - A TR should have robust information systems that provide accurate current and historical data. Data should be provided in a timely manner and in a format that permits it to be easily analysed.

A Núclea foi certificada pela BSI (British Standard Institute) na norma ISO 27001:2019, que é o padrão mais renomado e reconhecido para Segurança da Informação para garantir a segurança, integridade, disponibilidade e confidencialidade da informação. Fornece dados atuais e históricos precisos em tempo hábil em um formato padronizado que facilita uma análise comparativa rápida e precisa.

A partir do início das operações como uma Registradora, a C3 Registradora passou a contar com um mecanismo de detecção e reporte ao BCB das operações fora de padrão, permitindo ao Regulador agir quando uma operação fora de padrão detectada na Registradora não for justificada ou corrigida pelos Participantes.

A Núclea dispõe, em sua estrutura organizacional, de uma área responsável pela qualidade e integridade das informações atuais e históricas, referentes a seus Sistemas de negócio. Possui, ainda, ferramenta estatística que permite a extração de informações e montagem de pesquisas estruturadas para atendimento às diferentes demandas, seja dos Participantes de seus Sistemas ou provenientes do Órgão Regulador. Ademais, com a criação de bases de dados *offline* seguras, idênticas às bases de dados *online* é possível garantir a integridade da informação e a possibilidade de rastreabilidade, acessibilidade, comparabilidade e análise.

A Núclea mantém informações históricas em suas bases de dados ativas por um período de 5 (cinco) anos, após este prazo, as informações são transferidas para mídias magnéticas para armazenamento por períodos superiores, permitindo que mediante solicitação, relatórios de períodos passados sejam reencaminhados, em prazo compatível com o esforço de processamento dos volumes de informações do período da solicitação.

6. CONSIDERAÇÕES ADICIONAIS

Não há considerações adicionais neste relatório.

7. CONTROLE DO DOCUMENTO

Relatório Divulgação PFMI CPSS-IOSCO

Instituição Operadora de Sistemas do Mercado Financeiro (IOSMF)

DENOMINAÇÃO: Autoavaliação aos Princípios para Infraestruturas do Mercado Financeiro	
VIGÊNCIA: 10/07/2028	VERSÃO: 4

Versão	Rev.	Publicação	Motivo/ Descrição	Responsável	Vencimento
1	-	31/03/2020	Publicação do Relatório Sumarizado do PFMI	Compliance	31/03/2022
2	-	13/07/2022	Revisão bienal do Relatório Sumarizado do PFMI	Compliance	13/07/2024
3	-	12/07/2024	Revisão bienal do Relatório Sumarizado do PFMI	Compliance	12/07/2026
4	-	10/07/2026	Revisão bienal do Relatório Sumarizado do PFMI	Compliance	10/07/2028