

PROJETO DE INTEGRAÇÃO DAS CLEARINGS FASE 2

11ª Reunião do Grupo de Trabalho com Participantes (GT-TE)

Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada

Visite o site da BM&FBOVESPA

www.bmfbovespa.com.br

A implantação da Fase 2 do Projeto de Integração das Clearings depende da aprovação dos órgãos reguladores

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 10º GT (01/04/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRAZOS

SINACOR

TRANSIÇÃO EXTERNA

Principais itens apontados:

1. iMercado – Reunião conjunta com gestores, administradores, custodiantes e corretoras.
2. Contratos de Repasse com IPN V2 – Minuta e período de transição.
3. Empréstimo de ativos – prontidão.
4. Sincad.

1. iMercado

a. Nesta semana, fizemos uma reunião conjunta com gestores, administradores, custodiantes e corretoras, totalizando cerca de 30 instituições, para:

1. Apresentação do produto, funcionalidades e benefícios – IMBARQ;
2. Modelo de tarifação

➤ **Obtivemos o comprometimento na adesão ao iMercado, em especial ao arquivo IMBARQ.**

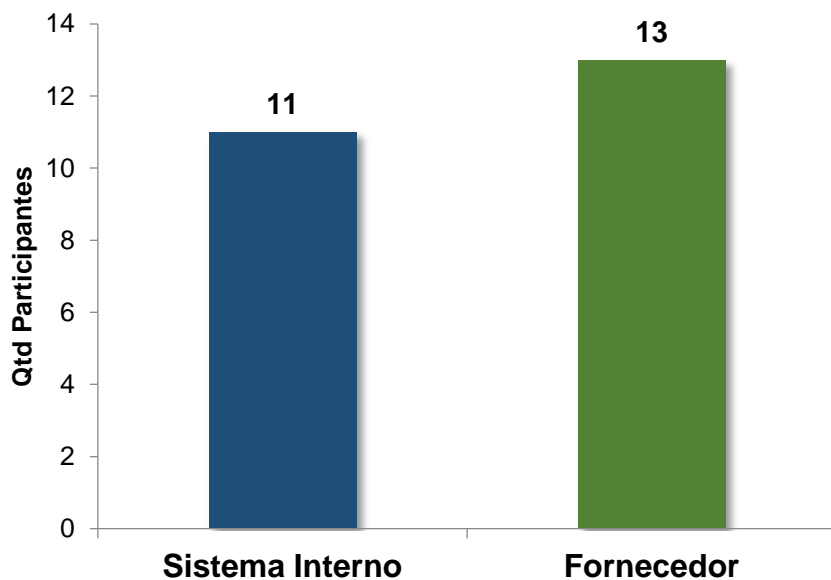
b. Workshops para todo mercado – RJ e SP.

2. Contrato de Repasse

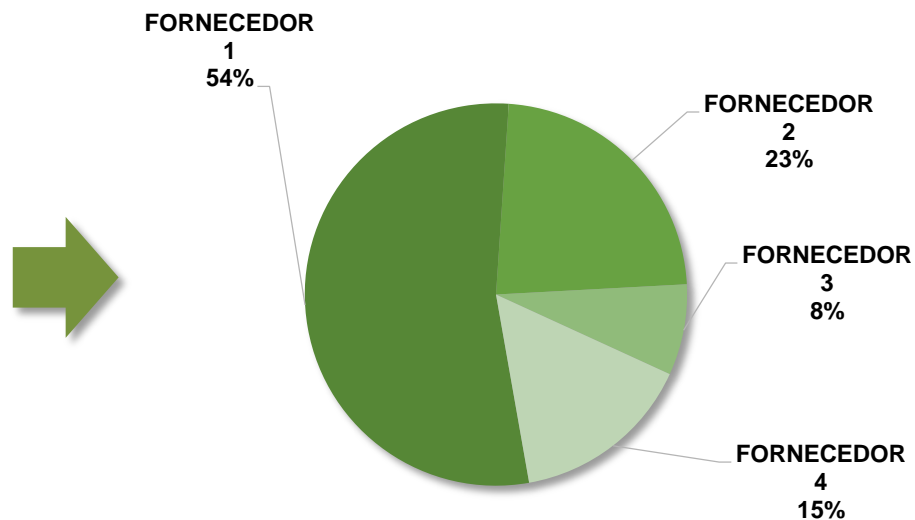
1. Minuta discutida na Câmara Consultiva de Pós Negociação.
 - Publicaremos a minuta sugerida para todos os participantes no site do Projeto.
2. BSM: período de transição alinhado com a atualização cadastral de clientes (até 24 meses).

3. Empréstimo de Ativos - Prontidão¹

Estratégia de desenvolvimento de software



Distribuição dos fornecedores



1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (21/03/16 à 06/04/16)

4. SINCAD - Migração de Contas e Vínculos (1/2)

A. Processo de validação da migração de contas

- O prazo de validação será estendido para o mês de Abril. Os participantes que necessitarem de uma base de dados para realizarem suas validações, deverão enviar uma solicitação para a Central de Cadastro da BM&FBOVESPA

B. Principais validações sugeridas:

1. Avaliar se todas as contas ativas e inativas (24 meses) estão no SINCAD.
2. Avaliar se a situação das contas está OK.
3. Checar se os dados das contas estão OK
4. Checar se os vínculos de conta máster e contas “por conta” estão OK
5. Checar se as contas qualificadas possuem vínculo de repasse
6. Checar se a situação do vínculos está OK
7. Checar se os perfis de conta (Tesouro Direto e Cadastro Simplificado) estão OK

4. SINCAD - Migração de Contas e Vínculos (2/2)

A. Contas inativas por mais de 24 meses.

1. Será gerado um arquivo com as contas inativas (a princípio um GCIN) por mais de 24 meses para envio aos participantes.
2. O arquivo será enviado aos participantes conforme demanda:
 - a. O envio do arquivo será em data diferente da data de implantação do SINCAD.
 - b. O GCIN já pode ser solicitado atualmente para obter essas informações.
3. Para as contas inativas que não forem “migradas” para o SINCAD:
 - a. No caso de manutenção da conta, o participante deverá realizar uma nova inclusão.
 - b. Haverá uma consistência com relação à titularidade da conta, da mesma forma que já ocorre atualmente.

B. O sistema CIN estará disponível para consultas durante o período de estabilização do SINCAD.

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 10º GT (01/04/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRAZOS

SINACOR

TRANSIÇÃO EXTERNA

Incidentes ocorridos na semana

04/Abr	05/Abr	06/Abr	07/Abr
<i>Segunda-feira</i>	<i>Terça-Feira</i>	<i>Quarta-feira</i>	<i>Quinta-feira</i>
-	<ul style="list-style-type: none"> Atraso na abertura do RTC 	<ul style="list-style-type: none"> Indisponibilidade na funcionalidade de Inclusão de Oferta Certificada no BTB 	<ul style="list-style-type: none"> Indisponibilidade no fluxo de envio e recebimento de arquivos do SINCAD (MTA)

ERROS CONHECIDOS - SISTEMAS DA CLEARING (1/2)

#	Descrição	Status	
Fase 3	1	O agente de custódia não consegue visualizar na tela do RTC as operações de OPA que foram direcionadas a ele.	Previsão de correção em 11/04/16
	2	Em alguns casos, o sistema GRC está apresentando dados incorretos da recompra.	Previsão de correção em 18/04/16
	3	O arquivo BVBG.018 não contém os campos relacionados às multas por falha de entrega de ativos.	Em análise.
	4	Quando a mensagem bvmf.15 é enviada pela sessão FIX secundária, a resposta (bvmf.14) está sendo enviada pela sessão primária.	
	5	Intermitência na geração de arquivos.	
	6	Intermitência no encerramento dos contratos de empréstimo já liquidados.	
	7	As telas e os arquivos do RTC estão apresentando as taxas dos contratos de empréstimo com 2 casas decimais, sendo que o correto seria com 5 casas.	
	8	O vendedor de um contrato a termo não consegue realizar a cobertura por meio da funcionalidade do módulo de controle de posições. OBS.: é possível realizar a cobertura por meio de alocação de operações.	
	9	Somente para investidor não residente, sistema está caracterizando como quebra de regra uma alocação em D+1 mesmo dentro do prazo permitido.	

ERROS CONHECIDOS - SISTEMAS DA CLEARING (2/2)

#	Descrição	Status
Fase 4	1 Cópia de carteiras com posições que liquidam no dia apresenta desbatimento de valores entre o simulador e o Monitor de Risco Intradiário, se realizada durante a janela de entrega de ativos e a janela de pagamentos. <i>Contorno: Efetuar o teste fora do período entre a janela de entrega de ativos e a janela de pagamento.</i>	Previsão de correção em 18/04/16
	2 No Relatório de Encerramento de Carteira e Relatório de Margem do monitor de risco intradiário, posições de opções inseridas em contas másteres se sobrepõem às posições de outras contas não-aloçadas, no caso do mesmo instrumento.	Em análise.
	3 Movimentações de Distribuição e Transferência para Carta de Fiança e Garantias no Exterior.	
	4 Erro Opções não aloçadas. Quando opções compradas e vendidas, de mesmo ativo objeto, são inseridas em carteira não aloçada, as posições vendidas são consideradas como cobertas no cálculo do risco.	
	5 O MC/PNP/PL não pode ser capaz de atribuir valores de recursos de liquidez para o CORE0, CORE1 e CORE2. Este atributo será parametrizado somente pela Clearing.	

Lista de problemas conhecidos, detalhe dos cenários impactados e previsão de correção estão disponíveis no site: <http://ipn.bmfbovespa.com.br/Certificacao%7CProducao/Certificacao-146>

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 10º GT (01/04/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRAZOS

SINACOR

TRANSIÇÃO EXTERNA

Fase 2 : Cadastro¹ - Execução dos cenários/prontidão (progresso)

Participante	Fase 2	
	Tela	Legado
Participante 1	██████████	██████████
Participante 2	██████████	██████████
Participante 3	███	███
Participante 4		
Participante 5	██████	██████
Participante 6	██████████	██████████
Participante 7	██████	
Participante 8	███	███
Participante 9	██████████	██████████
Participante 10	██████████	██████████
Participante 11	██████████	██████████
Participante 12	██████	██████
Participante 13	██████████	██████████
Participante 14	██████	███
Participante 15	██████████	██████████
Participante 16	██████	███
Participante 17	██████████	██████████
Participante 18	██████████	██████████
Participante 19	██████████	██████████
Participante 20	██████████	██████████
Participante 21	██████████	██████████
Participante 22	██████████	██████████
Participante 23	██████████	██████████
Participante 24	██████	██████
Participante 25	███	███
Participante 26	██████████	██████████

Participante	Fase 2	
	Tela	Legado
Participante 27	██████████	███
Participante 28	██████████	██████████
Participante 29	██████████	██████
Participante 30	██████	███
Participante 31	██████████	██████████
Participante 32	██████████	██████████
Participante 33	██████████	██████████
Participante 34	██████████	██████████
Participante 35	██████████	██████████
Participante 36	██████████	██████████
Participante 37	██████████	██████████
Participante 38	██████████	██████████
Participante 39	██████	
Participante 40	██████████	██████████
Participante 41	██████████	██████████
Participante 42	██████	██████████
Participante 43	██████	
Participante 44	██████████	
Participante 45	██████████	██████
Participante 46	██████████	██████████
Participante 47	██████████	██████████
Participante 48	██████	██████
Participante 49	██████████	
Participante 50	███	███
Participante 51		
Participante 52	██████	██████

- ██████ Progresso obtido até 31/03/16
- ███ Evolução do progresso (01/04/16 a 07/04/16)
- ██████████ Cenários não aplicáveis

1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (01/04/16 à 07/04/16)

Fase 3: Liquidação¹ - Execução dos cenários/prontidão (progresso)

G1 início em 1/2 G2 início em 22/2 G3 início em 7/3 G4 início em 21/3 G5 início em 14/3

Participante	Fase3									
	G1		G2		G3		G4		G5	
	Tela	Legado	Tela	Legado	Tela	Legado	Tela	Legado	Tela	Legado
Participante 1	■	■			■					
Participante 2	■		■							
Participante 3	■	■								
Participante 4										
Participante 5	■	■	■	■						
Participante 6	■	■	■	■	■	■	■	■		
Participante 7										
Participante 8	■	■			■	■	■	■		
Participante 9	■	■	■	■	■	■	■	■		
Participante 10	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■
Participante 11	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■
Participante 12	■				■					
Participante 13										
Participante 14	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■
Participante 15	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■
Participante 16	■									
Participante 17	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■
Participante 18	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■
Participante 19	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■
Participante 20	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■
Participante 21	■				■			■		
Participante 22	■	■								
Participante 23	■	■								
Participante 24					■					
Participante 25										
Participante 26	■	■	■	■	■	■	■	■	■	■

- Progresso obtido até 31/03/16
- Evolução do progresso (01/04/16 a 07/04/16)
- Cenários não aplicáveis

1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (01/04/16 à 07/04/16)

Fase 3: Liquidação¹ - Execução dos cenários/prontidão (progresso)

G1 início em 1/2

G2 início em 22/2

G3 início em 7/3

G4 início em 21/3

G5 início em 14/3

Participante	Fase3									
	G1		G2		G3		G4		G5	
	Tela	Legado	Tela	Legado	Tela	Legado	Tela	Legado	Tela	Legado
Participante 27	■	■	■		■		■		■	
Participante 28	■	■	■		■		■	■	■	
Participante 29	■	■	■	■	■	■	■			
Participante 30	■		■				■		■	
Participante 31	■	■	■	■	■	■		■	■	■
Participante 32	■	■	■		■	■	■	■	■	■
Participante 33	■		■		■				■	
Participante 34	■		■		■		■		■	
Participante 35	■									
Participante 36	■	■	■		■	■	■	■	■	■
Participante 37	■	■	■		■		■		■	■
Participante 38	■		■							
Participante 39	■		■		■		■		■	
Participante 40	■	■	■							
Participante 41	■	■	■	■	■		■		■	■
Participante 42										
Participante 43	■		■		■	■				
Participante 44	■		■		■	■	■		■	
Participante 45	■	■								
Participante 46	■		■		■		■		■	
Participante 47	■	■					■			
Participante 48	■									
Participante 49	■									
Participante 50	■	■								
Participante 51					■				■	
Participante 52	■	■								

■ Progresso obtido até 31/03/16

■ Evolução do progresso (01/04/16 a 07/04/16)

■ Cenários não aplicáveis

1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (01/04/16 à 07/04/16)

Fase 4: Risco e Garantias¹ - Execução dos cenários/prontidão (progresso)

G4 início em 21/3

Participante	Fase 4 - Risco		Fase 4 - Garantias	
	Tela	Legado	Tela	Legado
Participante 1				
Participante 2				
Participante 3				
Participante 4				
Participante 5				
Participante 6	■	■	■	■
Participante 7				
Participante 8				
Participante 9				
Participante 10	■		■	■
Participante 11	■		■	■
Participante 12				
Participante 13				
Participante 14	■		■	
Participante 15				
Participante 16				
Participante 17				
Participante 18				
Participante 19				
Participante 20				
Participante 21		■		■
Participante 22				
Participante 23				
Participante 24				
Participante 25				
Participante 26				

G4 início em 21/3

Participante	Fase 4 - Risco		Fase 4 - Garantias	
	Tela	Legado	Tela	Legado
Participante 27	■		■	
Participante 28	■		■	
Participante 29	■			
Participante 30	■		■	
Participante 31				
Participante 32	■		■	
Participante 33				
Participante 34		■		■
Participante 35				
Participante 36				
Participante 37				
Participante 38				
Participante 39	■		■	
Participante 40				
Participante 41				
Participante 42				
Participante 43				
Participante 44	■	■		■
Participante 45	■			
Participante 46				
Participante 47				
Participante 48				
Participante 49			■	
Participante 50				
Participante 51		■		■
Participante 52				

■ Progresso obtido até 31/03/16

■ Evolução do progresso (01/04/16 a 07/04/16)

■ Cenários não aplicáveis

1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (01/04/16 à 07/04/16)

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 10º GT (01/04/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRAZOS

SINACOR

TRANSIÇÃO EXTERNA

Atualização dos prazos para execução dos cenários de certificação

		Período de testes	Assunto(s)
		Participantes	
Fase 2		4/1 a 10/3	<ul style="list-style-type: none"> Inclusão e manutenção de contas e vínculos
	G1	1/2 a 31/3	<ul style="list-style-type: none"> Mercado à vista + ETF secundário (desde captura até recompra)
Fase 3	G2	22/2 a 17/3	<ul style="list-style-type: none"> OPA e Follow-on ETF primário
Liquidação	G3	7/3 a 31/3	<ul style="list-style-type: none"> Empréstimo (contratação)
	G4	21/3 a 14/4	<ul style="list-style-type: none"> Empréstimo (posições e liquidação) Movimentações (Depósito e Retirada) e consultas de garantias
Fase 3:	G5	14/3 a 13/4	<ul style="list-style-type: none"> Opção (alocação, posições e exercício) Movimentações (Distribuições e Transferências) e consultas de garantias
Liquidação	G6	4/4 a 14/4	<ul style="list-style-type: none"> Termo (alocação, posições e liquidação) Movimentações (Carteira de Cobertura e Liquidação) e monitoramento.
e	G7	18/4 a 28/4	<ul style="list-style-type: none"> Tratamento de eventos corporativos e Derivativos Financeiros e Commodities Movimentações (Depósito e Retirada) via mensagem.
Fase 4:	G8	18/4 a 28/4	<ul style="list-style-type: none"> Renda Fixa Monitorar e Efetuar Cobertura de Chamada de Margem
Risco e	G9	4/4 a 29/4	<ul style="list-style-type: none"> Exercício de Opções Mensagens do Simulador de Risco Movimentações (Distribuições e Transferência) via mensagens Movimentações (Depósitos, Retiradas, Distribuições e Transferências) via arquivos e consulta de garantias via mensagens e arquivos.
Garantias			

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 10º GT (01/04/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRAZOS

SINACOR

TRANSIÇÃO EXTERNA

SINACOR – Entregas Programadas para 15/04

Entregas Fase 3 – Correções em andamento

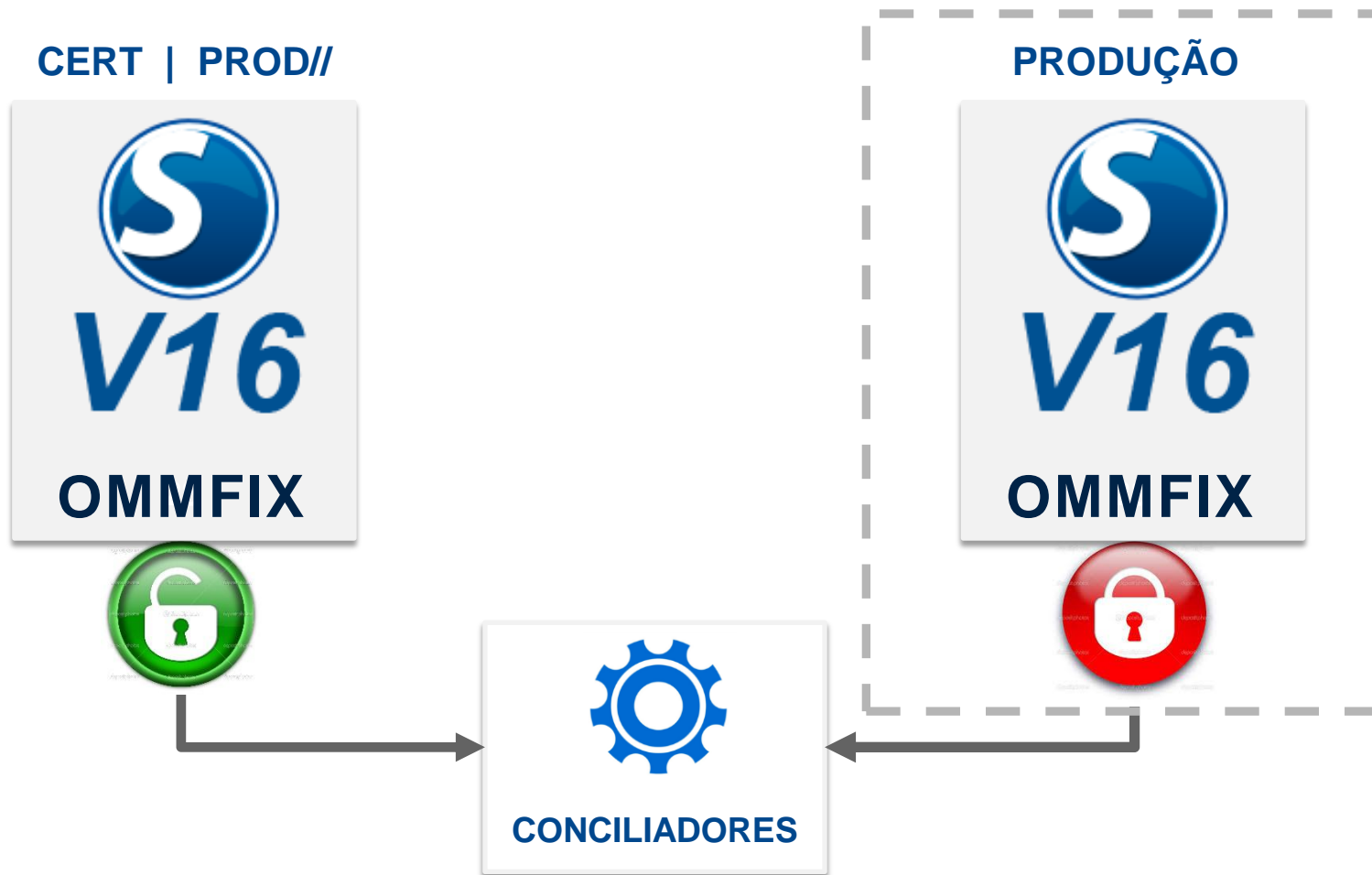
- Adequação no processamento das mensagens de ETF;
- Ajustes na aprovação/rejeição de repasse (usuário sem permissão);
- Ajustes nas consultas de Cadastro de Instrumentos;
- Ajustes no Relatório “Resultado Liquido Liquidados Dia” (BVBG.018);
- Melhoria para salvar alteração da Ordem em lote;
- Melhoria na mensagem de erro ao importar o BVBG.021;
- Tratamento na consulta de especificação com dados “não validados”.

Qtd correções: 16

Link para o detalhamento das correções:

<http://ipn.bmfbovespa.com.br/Downloads/V2-%96-Clearing-de-Renda-Variavel-e-Renda-Fixa-Privada/Documentos-189>

SINACOR – Ambiente para Produção Paralela



SINACOR – Resumo das Versões

V15 – PATCH SINCAD PRODUÇÃO

- Patch oficial para atender a entrada do SINCAD em produção – **entregue em 01/04;**
-

V16 – PRODUÇÃO, SINCAD, IPN V2 e Correções

- Versão oficial de **produção** para adequar-se as necessidades da produção paralela IPN V2 – **previsão 15/04;**
-

OMMFI

➤ Cenário atual - produção

09 – Participantes GT

13 – Demais participantes

➤ Requisitos para migração

Ambiente de homologação;

Contratação de sessões FIX;

Subscriber STM para homologação;

Liberação em firewall – novos gateways FIX.

➤ Prazo de homologação: 01 semana

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 10º GT (01/04/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRAZOS

SINACOR

TRANSIÇÃO EXTERNA

Próximos passos da TE

1. Continuidade do acompanhamento in loco das fases de Certificação.
2. Periodicidade de atualização de informações:
 - a. Evolução dos testes: semanal.
 - b. Nível de prontidão: quinzenal.
3. Reports consolidados de acompanhamento do Projeto:
 - a. Prévia enviada para os pontos focais (nível de prontidão e evolução dos testes) ✓
 - b. Finalização do report consolidado para alinhamento com ponto focal.
 - c. TE enviará para o DRM, incluindo a posição do participante em relação aos demais.
4. Próximo GT-TE em **20/04 ou 25/04.**



facebook.com.br/bolsapravoce



twitter.com/info_bmfbovespa



youtube.com/bmfbovespa

Visite o site da BM&FBOVESPA

www.bmfbovespa.com.br

Contato

BM&FBOVESPA

A Nova Bolsa

