

PROJETO DE INTEGRAÇÃO DAS CLEARINGS FASE 2

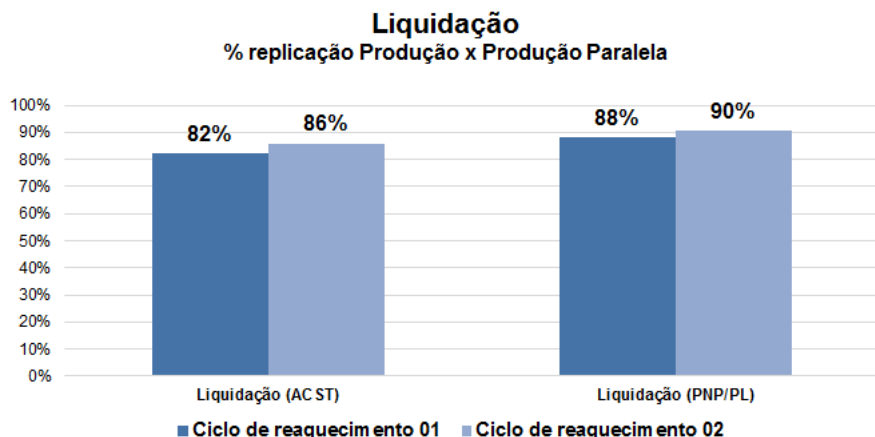
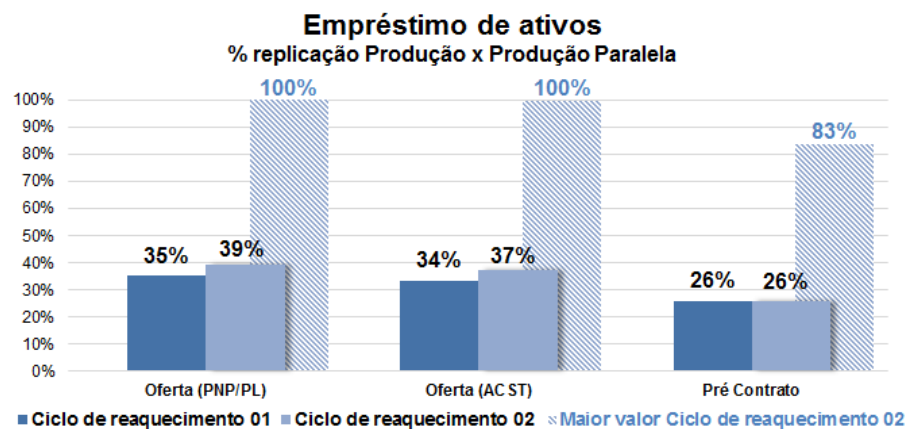
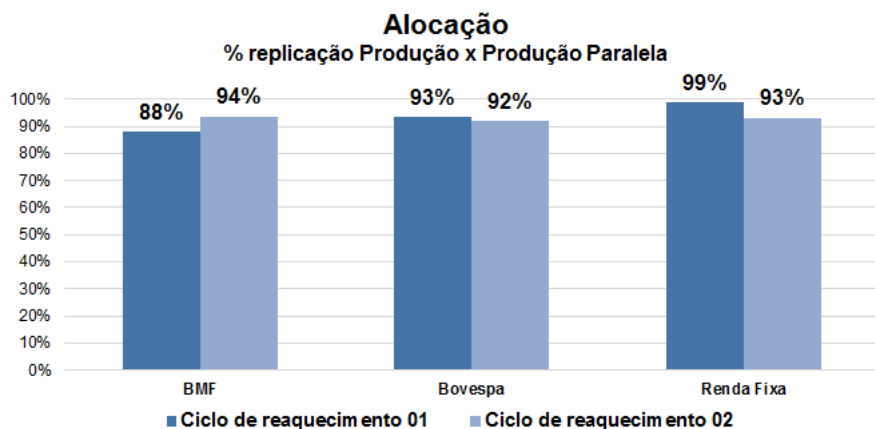
23ª Reunião do GT-TE – Produção Paralela
Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada

1. Resultado do Ciclo de Reaquecimento 02
2. SINACOR
3. Ensaio do Dia D – resultado da pesquisa
4. Implantação do IPN v2

1.

Resultado do Ciclo de Reaquecimento 02

Comparativo entre os Ciclos de Reaquecimento 01 e 02*



* Fonte: Percentual obtido das operações realizadas em Produção Paralela versus as realizadas em Produção durante os dias do ciclo (média do período)

2.

SINACOR

SINACOR V17

1. V17.12 Produção: **100% Concluído**
2. V17.25 Produção: **70% Concluído** (Meta de finalização: 24/08)

Calls de Alinhamento de Implantação SINACOR

1. Dúvidas sobre a atualização do Cook Book enviada em 18/08.
2. Esclarecimento de dúvidas de execuções gerais.
3. Agendamento prévio de validação das conciliações no domingo (27/08) – com início às 03h.

3.

Ensaio do Dia D – Resultado da Pesquisa

Pesquisa do Ensaio do Dia D

1. Pesquisa efetuada após Ensaio realizado nos dias 05, 06 e 07 de Ago/17.
2. As questões abrangiam temas como:
 - a. Comunicação para preparação para o ensaio.
 - b. Efetividade dos calls.
 - c. Atendimento pelos canais da B3 (SSP, Transição Externa, SINACOR e áreas de negócios).

➤ As respostas seguiam uma escala de avaliação: Ótimo, Bom, Regular ou Ruim.
3. Aproximadamente **86% dos respondentes avaliaram as questões como “Ótimo” ou “Bom”**.

Pesquisa do Ensaio do Dia D – continuação

4. A seguir, os principais comentários e ações que serão adotadas para a Implantação:

a. Tempo de espera para atendimento na SSP e SINACOR.

- Reforço das equipes durante todo o período da implantação e sessão simulada.

b. Maior clareza das atividades a serem executadas na sessão simulada.

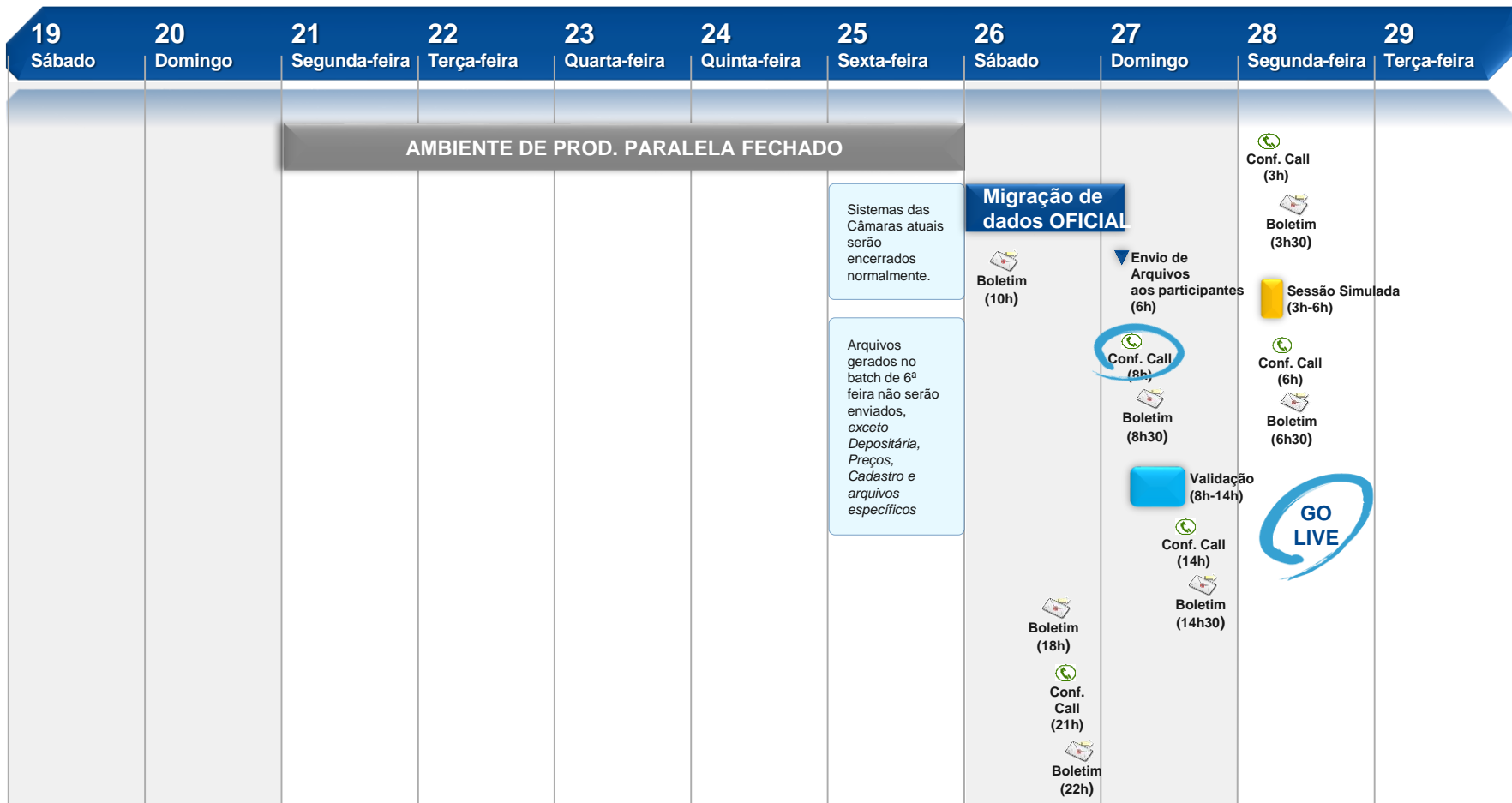
- Refinamento do roteiro da sessão simulada, deixando mais explícito o escopo a ser desempenhado por todos os participantes e o escopo opcional para algumas categorias.

4.

Implantação do IPN v2

Semana anterior à implantação em 28/08

AGOSTO/17



Destaque:

➤ **Domingo (27/8): conf. call para início da validação de dados ocorrerá as 8h.**

Informações gerais

1. **Dinâmica** (apresentada no workshop “Estratégia de Implantação” em 17/02/17)

- a. **No sábado**, é esperado que o participante realize as atividades de migração de dados e preparações do ambiente de Produção para o início da segunda-feira, bem como a recepção dos arquivos “exceção” de sexta-feira.
- b. **No domingo**, com base nos arquivos recebidos da migração de dados, os participantes devem realizar seus processos de batimentos e validação destes dados e reportar o resultado via checklist, onde tais informações serão consolidadas pela B3 para o *call* das 14h. O participante também precisa validar a extração dos arquivos do BTC (este item será detalhado no tópico “Recepção de Arquivos”).
- c. **Na segunda-feira**, a plataforma estará disponível a partir das 03h para a realização da sessão simulada (03h às 06h), onde uma massa de negócios de IPNN3 e DDMK25 será carregada no ambiente de Negociação e será possível a execução de cenários de alocação e repasse, movimentação de garantias e empréstimos. Essa massa será injetada após o *call* das 03h. Às 06h será realizado um *call* para encerramento da sessão simulada e declaração do “Go/NoGo”. Após esse *call*, será realizado o cancelamento dos negócios efetuados na sessão simulada.

Informações gerais - continuação

2. Atuação durante a implantação

- a. PNPs e PLs devem participar da validação dos insumos da migração de dados e na sessão simulada.
- b. Na sessão simulada, o Custodiante participa do teste de Empréstimo caso o PNP escolha a conta deste CST para tomar/doar emprestado. Esta é uma participação opcional a ser combinada com um PNP.
- c. A sessão simulada ocorre no dia útil (28/08, segunda-feira). Atenção com o escopo apresentado no roteiro, em que uma massa de negócios de IPNN3 e DDMK25 será carregada no ambiente de Negociação para a execução de cenários de alocação e repasse, movimentação de garantias e empréstimos.
- d. A atuação dos participantes será acompanhado via checklists.

Informações gerais - continuação

3. Recepção de Arquivos

- a. **Contexto:** Conforme workshop da Estratégia do dia D, na sexta-feira que antecede o lançamento, os arquivos da Clearing serão gerados, mas não enviados aos participantes.
- b. A exceção ocorre para os arquivos de sistemas que não são impactados pelo IPN (Depositária, Cadastro e Preços) e alguns arquivos específicos que são utilizados para processos de fechamento e batimento dos participantes, a saber: DBTL, DBTP, DBAL, DBAP, NEAC, INFR e CTLP. Todos são enviados via MTA, exceto os arquivos DBTP e DBAP que são extraídos via tela.
- c. As telas do sistema BTC estarão disponíveis no domingo para que o participante possa extrair os arquivos DBTP e DBAP, caso necessário ao processo de batimento do participante. Também estarão disponíveis para consulta os sistemas SLF e NGA. O sistema RTC não estará disponível.

Atuação dos participantes e checkpoints – quadro resumo

#	Dia	Atividades para serem reportadas pelos participantes	Horário Limite para report* à TE	Conf. call (status B3 e participantes)
1	Sábado (26/08)	<ul style="list-style-type: none"> • Andamento das atividades internas dos participantes (preparações de sistemas, Setup de configurações SINACOR/CookBook). • Sinalização da prontidão do participante para iniciar a validação da migração de dados no Domingo (27), as 08h. 	20h	21h
2	Domingo (27/08)	• Sinalização da prontidão do participante para iniciar a validação da migração de dados (caso o status do sábado tenha sido alterado).	07h	08h
3		• Resultado da validação da migração de dados.	12h30	14h
4	Segunda-feira (28/08)	• Resultado da validação da sessão simulada (empréstimo, garantias e liquidação, onde aplicáveis)	05h	06h

*** Checklist específico para a implantação, com pontos de controle para atividades do sábado, domingo e segunda. Durante o Sábado (26/8), a Transição Externa poderá fazer contatos bilaterais para obter o status das atividades.**

Período de estabilização – regras de transição

- Foi publicado o Ofício Circular 047/2017-DP, que trata dos assuntos:

1. Aprovação dos Reguladores

Em 11/08/2017, o Banco Central do Brasil (BCB) e a Comissão de Valores Mobiliários (CVM) concederam à B3 as autorizações necessárias à implementação da 2ª fase do Projeto de Integração da Pós-Negociação (IPN-V2).

2. Normativos

Relacionamos os normativos aplicáveis às atividades da Câmara BM&FBOVESPA a partir da implementação do IPN-V2, devidamente aprovados pelo BCB e pela CVM, em suas respectivas esferas de competência.

3. Adesão dos Participantes

Será necessário que os participantes formalizem, até 29/09/2017, sua adesão às novas regras de acesso e aos demais normativos que regerão a Câmara BM&FBOVESPA e a Central Depositária da BM&FBOVESPA.

4. Regras de Transição

FILCB, Tratamento especial para multas, Questões relacionadas à estrutura de participantes e pontos de atenção no processo de migração e implementação do IPNv2.

5.

Mensagem final

MUITO OBRIGADO

Tudo isso só foi possível pela atuação e colaboração dos participantes durante todo o período.

