

# PROJETO DE INTEGRAÇÃO DAS CLEARINGS FASE 2

## 6ª 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](http://www.bmfbovespa.com.br)

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

## FASES 2 E 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 5º GT (17/02/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

SINACOR

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

PERGUNTAS E RESPOSTAS

## Alteração dos prazos para os cenários de Certificação

		Período de testes Participantes	Assunto(s)
Fase 2 Cadastro		4/1 a 10/3	<ul style="list-style-type: none"> <li>Inclusão e manutenção de contas e vínculos</li> </ul>
Fase 3 Liquidação	G1	1/2 a 3/3(*)	<ul style="list-style-type: none"> <li>Mercado à vista + ETF secundário (desde captura até recompra)</li> </ul>
	G2	22/2 a 3/3(*)	<ul style="list-style-type: none"> <li>OPA e Follow-on (2 ciclos de Follow-on)</li> <li>ETF primário</li> </ul>
	G3	7/3 a 10/3	<ul style="list-style-type: none"> <li>Empréstimo (contratação)</li> </ul>
Fase 3: Liquidação e Fase 4: Risco e Garantias	G4	7/3 a 10/3	<ul style="list-style-type: none"> <li>Empréstimo (posições e liquidação)</li> <li>Movimentações e consultas de garantias</li> </ul>
	G5	14/3 a 17/3	<ul style="list-style-type: none"> <li>Opção (alocação, posições e exercício)</li> <li>Movimentações (Depósitos e Retiradas) e consultas de garantias via Mensagem e Arquivos</li> </ul>
Fase 4: Risco e Garantias	G6	21/3 a 24/3	<ul style="list-style-type: none"> <li>Termo (alocação, posições e liquidação)</li> <li>Movimentações (Depósitos e Retiradas) e consultas de garantias via Mensagem e Arquivos</li> </ul>
	G7	21/3 a 31/3	<ul style="list-style-type: none"> <li>Tratamento de eventos corporativos e Derivativos Financeiros e Commodities</li> <li>Monitorar e Efetuar Cobertura de Chamada de Margem</li> </ul>
	G8	28/3 a 31/3	<ul style="list-style-type: none"> <li>Renda Fixa</li> <li>Operações (Carteira de Cobertura e Liquidação) e Monitoramento</li> </ul>
Fase 4: Risco e Garantias	G9	4/4 a 29/4	<ul style="list-style-type: none"> <li>Monitoramento da Prévia da Margem Requerida para D+1</li> <li>Exercício de Opções</li> <li>Mensagens do Simulador de Risco</li> <li>Monitorar e Efetuar Cobertura de Chamada de Margem para Salvaguardas</li> </ul>

(\*) Conforme nível de estabilidade dos ambientes

FASES 2 E 3 - PRAZOS

**RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)**

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 5º GT (17/02/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

SINACOR

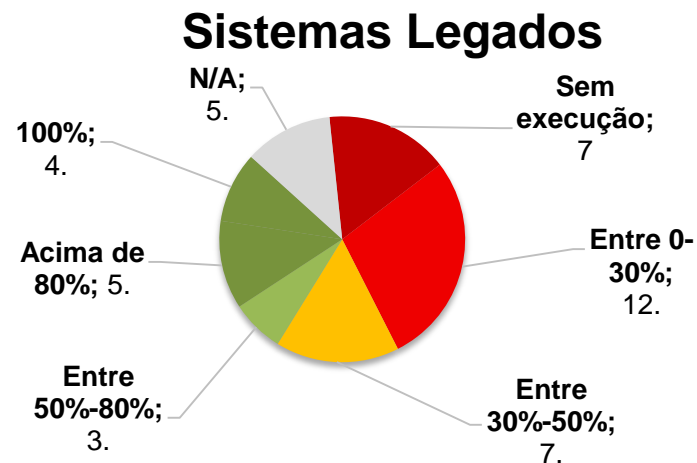
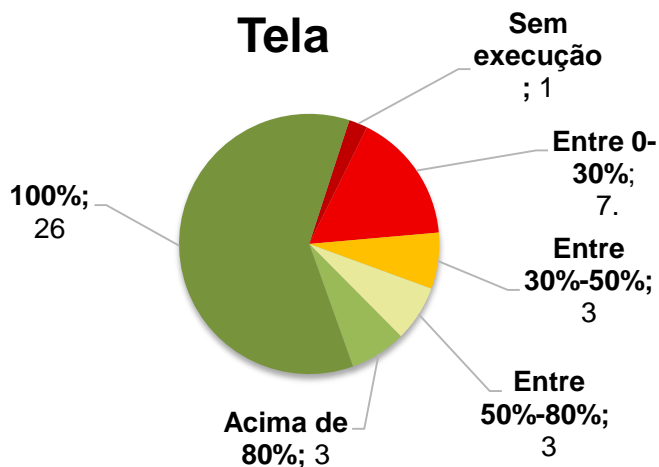
PRÓXIMOS PASSOS DA TE

PERGUNTAS E RESPOSTAS

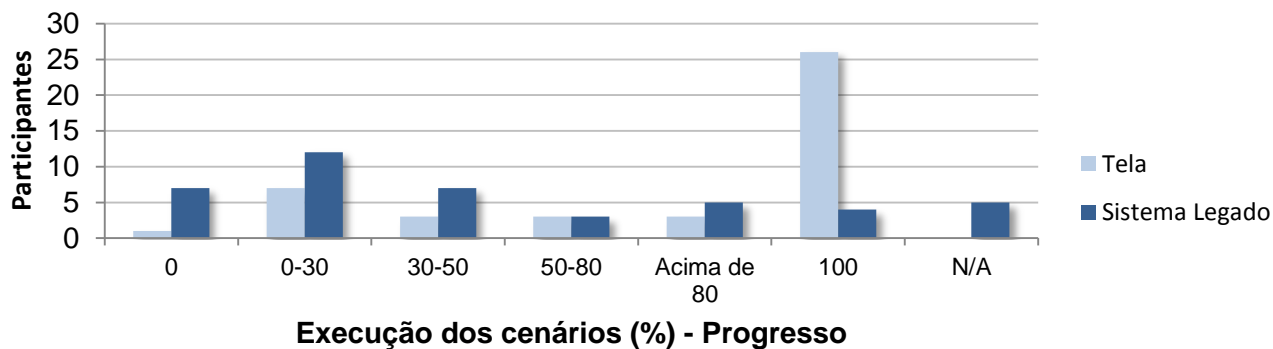
## Acompanhamento

1. Conforme divulgado no 5º GT (17/02/16), a Transição Externa intensificou o acompanhamento da execução das atividades de certificação junto aos participantes, objetivando:
  - a. Aumentar o sucesso na evolução dos cenários.
  - b. Identificar os desafios encontrados e promover/executar plano de ação para resolução dos itens.
2. Durante o acompanhamento, também foi identificada a prontidão do mercado quanto às fases de certificação, seguindo o percentual de progresso:
  - Acima de 80% ou 100%
  - Entre 30-50% ou 50-80%
  - Abaixo de 30% ou 0% (sem execução)
3. Os resultados serão apresentados a seguir.

## Fase 2: Cadastro<sup>1</sup> - Execução dos cenários/prontidão



### Distribuição da execução dos cenários por tipo de teste



1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (15/02/16 à 25/02/16)

## Fase 2: Cadastro<sup>1</sup> – Execução dos cenários/prontidão (progresso)

Participante	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	■	■

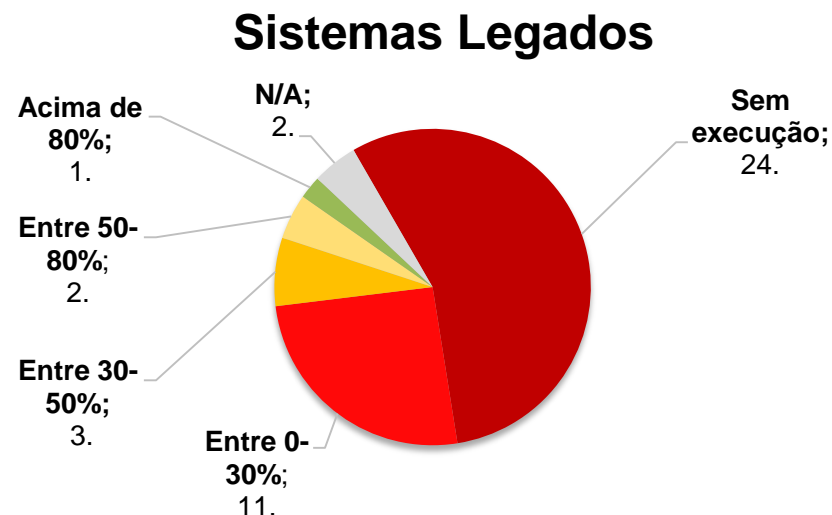
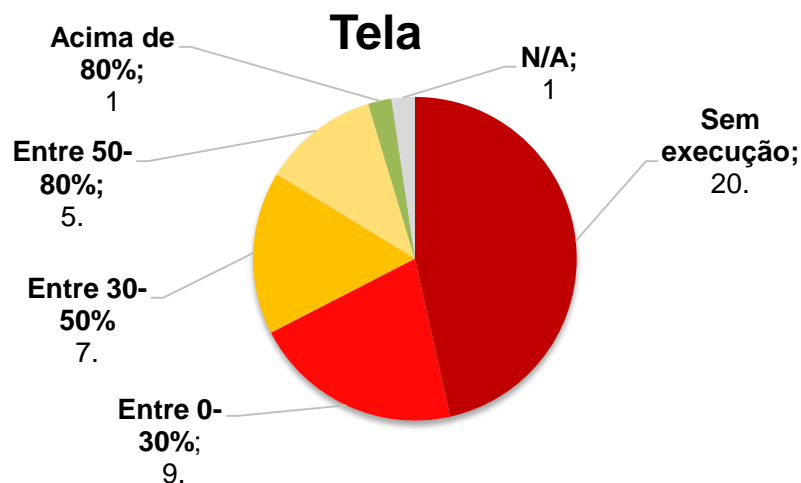
Participante	Tela	Legado
Participante 16	■	■
Participante 17	■	■
Participante 18	■	■
Participante 19	■	■
Participante 20	■	
Participante 21	■	
Participante 22	■	■
Participante 23	■	■
Participante 24	■	■
Participante 25	■	■
Participante 26	■	■
Participante 27	■	■
Participante 28	■	
Participante 29	■	■
Participante 30	■	

Participante	Tela	Legado
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	■	■

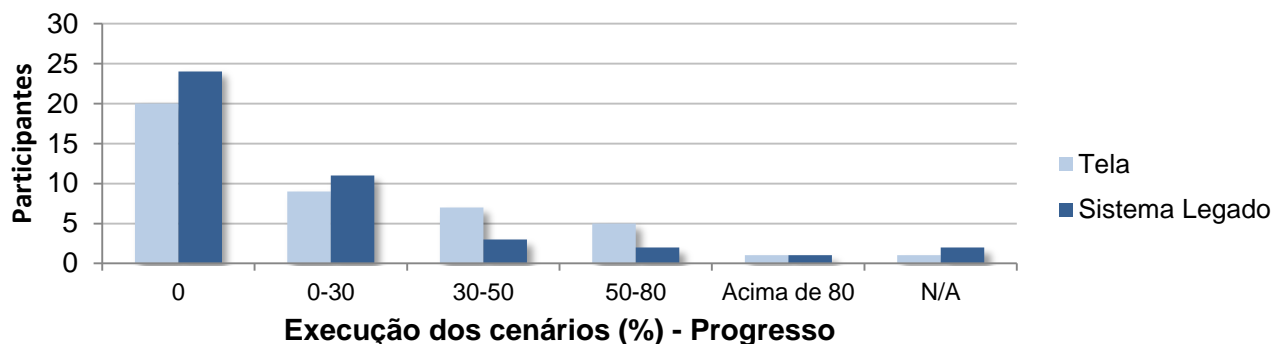
■ Progresso realizado  
 ■ Cenários não aplicáveis

1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (15/02/16 à 25/02/16)

## Fase 3: Liquidação<sup>1</sup> - Execução dos cenários/prontidão



Distribuição da execução dos cenários por tipo de teste



1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (15/02/16 à 25/02/16)



## Fase 3: Liquidação<sup>1</sup> - Execução dos cenários/prontidão (progresso)

Participante	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	Tela	Legado
Participante 16	■	■
Participante 17	■	■
Participante 18		■
Participante 19		
Participante 20		
Participante 21		
Participante 22	■	
Participante 23	■	
Participante 24	■	■
Participante 25	■	
Participante 26		
Participante 27		■
Participante 28		
Participante 29	■	■
Participante 30	■	

Participante	Tela	Legado
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		

■ Progresso realizado  
 ■ Cenários não aplicáveis

1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (15/02/16 à 25/02/16)

FASES 2 E 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

**ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 5º GT (17/02/16)**

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

SINACOR

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

PERGUNTAS E RESPOSTAS

## Principais itens apontados:

1. Grade de alocação – extensão de horário. ✓
2. Massa de trades – aumento de volume. ✓
3. SINCAD – forma de validação dos ensaios de migração. ✓
4. SINACOR – melhoria na URA de atendimento para acesso mais rápido. ✓
5. Tele conferência de Certificação – alteração de dia. ✓
6. MyCTC – cenários de testes envolvendo legados. ✓

**A seguir, serão apresentados as ações realizadas para cada item.**

## 1. Grade alocação – extensão de horário

Mercado	Grades de alocação	Repasse
<b>Renda variável*</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ Indicação até 2hs do registro do negócio, limitado as 17hs.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ Indicação até 2hs do registro do negócio, limitado as 17hs, Aceite/Rejeite pelo destino em até uma hora a partir da execução ou indicação do repasse</li> </ul>
<b>Derivativos Financeiros e Commodities</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ Indicação até duas horas do registro do negócio, limitado às 17hs</li> <li>✓ A partir de conta intermediária e conta Máster: Indicação até às 17hs do dia do registro do negócio.</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>✓ Indicação até duas horas do registro do negócio, limitado às 17hs</li> <li>✓ Aceite/Rejeite pelo destino em até uma hora a partir da execução ou indicação do repasse.</li> </ul>

\* - Há regras de exceções, que podem ser consultadas no Comunicado de Certificação publicado em 22/02/16

## 2. Massa de trades – aumento de volume

- A partir de 22/02/16 houve a duplicação do volume de trades na injeção de massa para os participantes.

### 3. SINCAD

- Conforme Ofício Circular 013/16-DP, a data de implantação do SINCAD ocorrerá após as simulações de migração de contas e vínculos do CIN para o SINCAD, previstas para ocorrerem durante o mês de março de 2016. A nova data será divulgada oportunamente.
- Participantes deverão efetuar as liberações de acesso em seus ambientes internos para os serviços e os endereços IP listados.
- Participantes que não conseguirem efetuar as liberações a tempo de realizar as simulações, deverão entrar em contato com a Central de Cadastro (11 2565-4308) para alinhar o procedimento que será adotado para a realização das validações:
  1. Acesso direto aos ambientes da BM&FBOVESPA.
  2. Disponibilização de arquivos por meio seguro e alinhado com o participante.

#### 4. SINACOR – melhoria na URA de atendimento para acesso mais rápido.

Canais de Atendimento SINACOR			
Telefone	Grupo de Atendimento	E-mail @bvmf.com.br	Ambiente
(11) 2565-5000 opção 5	1	sinacor sinacorg1 sinacorg2 sinacorg3	Produção
	2		
	3		
	4	ipn-sinacor	IPN *

(\*) Data de implantação: 26/02

#### 5. Tele conferência de Certificação – alteração de dia

- A partir de 26/02/16 o conf. call para dúvidas dos participantes será realizado as sextas-feiras, no mesmo horário (15h30).

## 6. MyCTC – cenários de testes envolvendo legados

- Na plataforma MyCTC será incluída a opção de execução de cenário por meio dos legados (SINACOR e demais sistemas do participante).
- Na **próxima semana** serão divulgadas as fases e os cenários que serão contemplados nessa nova metodologia.
- Participantes que possuírem cenários não aplicáveis deverão comunicá-los à Transição Externa.

FASES 2 E 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 5º GT (17/02/16)

**PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS**

SINACOR

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

PERGUNTAS E RESPOSTAS



## SISTEMAS DA CLEARING (1/2)

Descrição		Status
<b>Fase 2</b>	Tag incompleta no arquivo BVBG005	Corrigido em 24/02/16 ✓
<b>Fase 3</b>	<p>PLs em processo de credenciamento para o segmento de Ações não possuem estas mercadorias autorizadas, que implica nos seguintes problemas:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Repasse de operações.</li> <li>2. Alocação em conta filhote de master.</li> <li>3. Direcionamento de custódia.</li> <li>4. Indisponibilidade da conta para transferência de saldo para custódia.</li> </ol>	Corrigido em 23/02/16 ✓
	<p>Falta de harmonização de Cadastro (contas e vínculos), que implica nos seguintes problemas:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Repasse de operações.</li> <li>2. Alocação em conta filhote de master.</li> <li>3. Direcionamento de custódia.</li> <li>4. Indisponibilidade da conta para transferência de saldo para custódia.</li> </ol>	Previsão de correção em <b>26/02/16</b>
	Problema na Liquidação de OPA	Previsão de correção em <b>26/02/16</b>

## SISTEMAS DA CLEARING (2/2)

Descrição		Status
Fase 3	Quando a mensagem bvmf.15 é enviada pela sessões FIX secundária, a resposta (bvmf.14) está sendo enviada pela sessão primária.	Previsão de correção em <b>29/02/16</b>
	O arquivo BVBG.48 não está sendo gerado	Previsão de correção em <b>02/03/16</b>
	Hash de alocação: participante envia mensagem de solicitação bvmf.186, mas não recebe o arquivo BVBG.081 (AllocationHashResponse).	Previsão de correção em <b>02/03/16</b>
	Agente de Custódia não consegue autorizar/rejeitar um direcionamento de custódia por meio da mensagem bvmf.037. <i>Cenários associados podem ser realizados por meio de tela.</i>	Em análise
	O arquivo BVBG.018 não contém os campos relacionados às multas por falha de entrega de ativos.	Em análise

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>

## SINACOR (1/2)

Descrição		Status
<b>Fase 2</b>	Atualização de clientes na tela Consulta -> Situação de Cliente/Conta	Entregues em 22/02/16 ✓
	Atualização de status do arquivo inconsistente na tela	
	Alteração/ Inclusão SFP - Erro zero	
	Impersonate - Não importação dos arquivos BVBG02	
	BVVG 01 e BVVG 03 -> Processado com status gerado em arquivo	
	Inconsistência "Percentual de Cobrança Inválida"	
	Inconsistência "Situação de cadastro inválido"	
<b>Fase 3</b>	Importação do BVVG.028 -> Erro na função ProcessaEnriquecimento	
	Importação do BVVG28 -> Com mais de uma empresa contratada	
	Manutenção de Ordens -> Erro na montagem do Calendário	
	Manutenção de Negocios -> Campo Origem apresenta caracteres inválidos	
	Distribuição de Ordens Lote -> Erro ao clicar no lote	
	Conferência de Alocação -> Erro inesperado ao realizar qualquer pesquisa	
	OMMFIIX -> Monitoração -> "Não Foi possível executar automação de Ordens."	
	Erro na rotina de execução de expurgo do FIXGear	
	Quedas no serviço - APE de instrumentos	

## SINACOR (2/2)

Descrição		Status
<b>Fase 2</b>	Importação do arquivo de Vinculo BVBG.005 inconsistente sinacor apresenta erro NO DATA FOUND	Previsão de correção em <b>04/03/16</b>
	Atualização do vínculo de repasses - quando alterado um tipo de conta	
	Exportação de arquivos - quando há inclusão de documentos	
<b>Fase 3</b>	Manutenção de Ordens -> Ordens quadruplicadas	
	Importação do BVBG28 com impersonate configurado para dois servidores diferentes	
	Consulta de Associações -> Permite descasar negocio de repasse	
	Tela de Liberação -> Apresenta várias linhas de um repasse que já foi liberado.	
	Relatório -> Erro ao Acessar os relatórios do CENTURA	

FASES 2 E 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 5º GT (17/02/16)

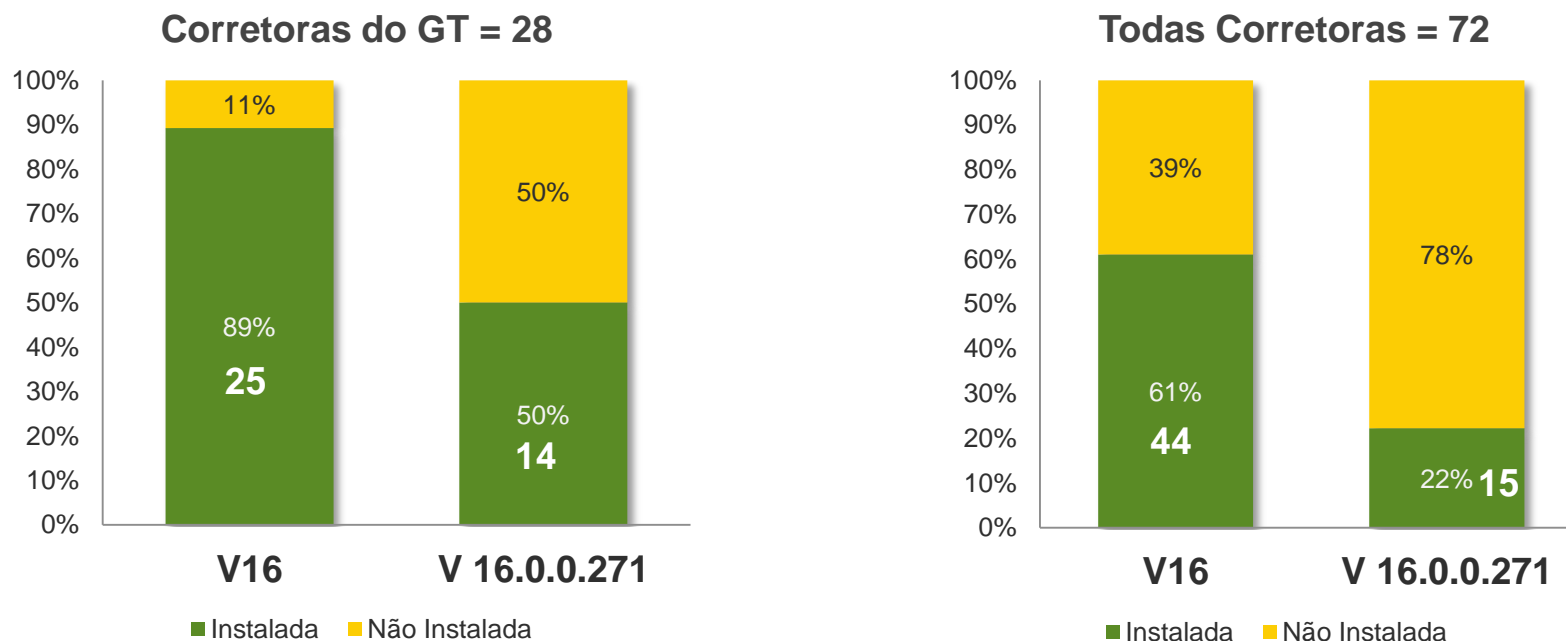
PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

**SINACOR**

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

PERGUNTAS E RESPOSTAS

## Status da Versão SINACOR



### V15.3 (Patch SINCAD) - Versão habilitada para produção SINCAD – 01/03:

✓ Execução da chave de virada para prorrogação da entrada.

FASES 2 E 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 5º GT (17/02/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS

SINACOR

**PRÓXIMOS PASSOS DA TE**

PERGUNTAS E RESPOSTAS

## Próximos passos da TE

1. Uso das mensagens de administração de risco – questionário.
2. Próximo GT.



## Uso das mensagens de administração de risco - questionário

### Objetivos:

1. Entender o uso das mensagens de administração de risco do ponto de vista não-funcional.
2. Alinhar a expectativa dos Participantes em relação as características não-funcionais das mensagens de risco.
3. Racionalizar a estrutura da BVMF para atender as necessidades dos Participantes.

### Escopo:

1. Mensagens de Monitoramento de Risco (Monitoramento de Risco Intradiário, Manutenção de Limite de Risco Intradiário, Monitor de Realocação e Transf. de posição).
2. Simulação de Risco.

### Questionário:

- TE/Risco entrarão em contato com as instituições para colher detalhes e entendimento da estratégia do uso da mensagens de risco

## Próximo GT

### – Decisão (opções):

1. Manter a recorrência quinzenal (próximo encontro **em 11/03/16**) ou
2. Antecipar a reunião para próxima semana (**04/03/16**).



facebook.com.br/bolsapravoce



twitter.com/info\_bmfbovespa



youtube.com/bmfbovespa

Visite o site da BM&FBOVESPA

[www.bmfbovespa.com.br](http://www.bmfbovespa.com.br)

Contato

**BM&FBOVESPA**

A Nova Bolsa

