

PROJETO DE INTEGRAÇÃO DAS CLEARINGS FASE 2

7ª 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 6º GT (26/02/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

SINACOR

FASE 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

Principais itens apontados:

1. Extensão do ambiente após às 17hs. ✓
2. Melhorias no processo de atendimento. ✓
3. Acesso ao Sistema de Empréstimo de ativos – BTB ✓
4. CAU – Lista descritiva e melhorias. ✓
5. MyCTC - Inclusão de cenários para tela e arquivos/mensagens. ✓
6. BDIN – Data de liberação em Produção Paralela. ✓
7. SINACOR – Liberação de versão. ✓

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

1. Extensão do Ambiente de Certificação após às 17hs.

- Os Participantes poderão realizar testes no ambiente de certificação com horário prorrogado até **às 18h**.
- A BM&FBOVESPA manterá estrutura de atendimento **entre 9h e 18h, sem interrupção**.
- As massas de testes serão disponibilizadas às: **9h30, 11h30, 13h30 e 15h30**.
- Será realizado um levantamento sobre a efetividade da utilização do ambiente de certificação entre 17h e 18h – discussão no próximo GT.

2. Estruturação da equipe e fluxo de atendimento

- Recapacitação da equipe de CTC.
- Reorganização do fluxo de atendimento em N1, N2 e N3.
- Considerando as fases de certificação, foram alocados recursos adicionais com conhecimento de negócio para operação do ambiente e prontidão nas respostas.
- Automatização do registro dos chamados via correio eletrônico, **a partir de 07/03/16.**

3. Acesso ao Sistema de Empréstimo de ativos – BTB.

- O perfil no CAU para acesso ao BTB foi liberado aos usuários privilegiados em **02/03/16**, com o objetivo de auxiliar nas preparações para concessão aos usuários comuns.

4. CAU – lista e descrição de perfis

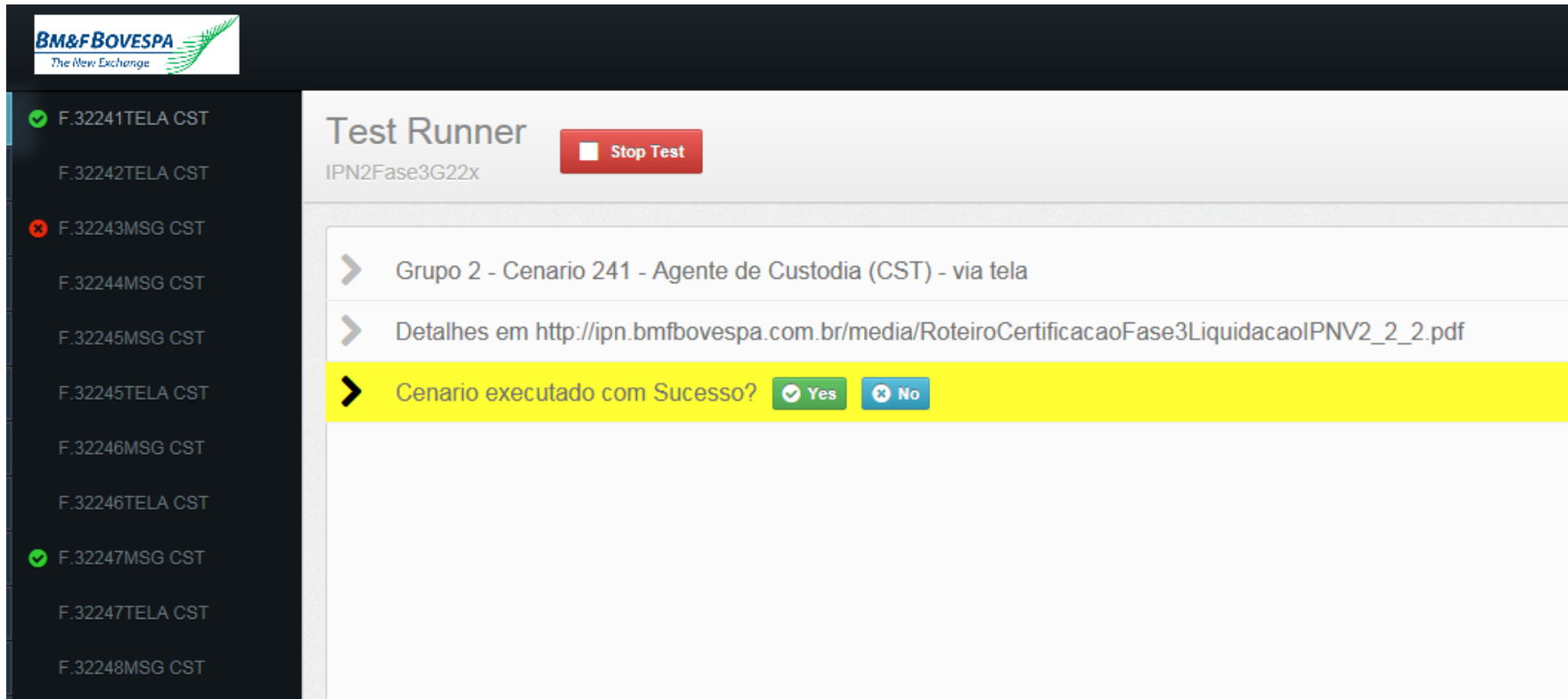
| Perfil | Descrição do perfil | Categoria que utiliza o perfil |
|---------------------------------------|---|---|
| RTC_CM-SETTLEMENT-MANAGER_BVMF | <ul style="list-style-type: none"> Acesso para Membro de Compensação ao módulo Gestão de Liquidação do RTC | <ul style="list-style-type: none"> MC – Membro de Compensação |
| RTC_P-SETTLEMENT-MANAGER_BVMF | <ul style="list-style-type: none"> Acesso para PNP e PL ao módulo Gestão de Liquidação do RTC | <ul style="list-style-type: none"> PNP – Participante de Negociação Pleno; PL - Participante de Liquidação |
| RTC_P-TRADE-MANAGER_BVMF | <ul style="list-style-type: none"> Acesso para PNP e PL para Gestão de Alocações e Repasses | <ul style="list-style-type: none"> PNP – Participante de Negociação Pleno; PL - Participante de Liquidação |
| RTC_P-POSITION-MANAGER_BVMF | <ul style="list-style-type: none"> Acesso de Manutenção para Participante ao Controle de Posição | <ul style="list-style-type: none"> PNP – Participante de Negociação Pleno; PL - Participante de Liquidação |

Disponibilizaremos o documento no site do IPN na próxima semana.

5. MyCTC - Inclusão de cenários para tela e arquivos/mensagens. (1/2)

- Na plataforma MyCTC serão incluídas opções independentes para declaração de progresso de cenários de Tela e Arquivos/Mensagens.
- Essas alterações serão realizadas durante a **próxima semana** e serão divulgadas via comunicado do CTC.
- Participantes que possuírem cenários não aplicáveis deverão comunicá-los à Transição Externa.

5. MyCTC - Inclusão de cenários para tela e arquivos/mensagens. (2/2)



The screenshot displays the MyCTC Test Runner interface. On the left, a dark sidebar lists test scenarios with status indicators: a green checkmark for F.32241TELA CST and F.32247MSG CST, and a red 'x' for F.32243MSG CST. The main area is titled 'Test Runner' and shows 'IPN2Fase3G22x' with a red 'Stop Test' button. The test results are as follows:

- Grupo 2 - Cenário 241 - Agente de Custodia (CST) - via tela
- Detalhes em http://ipn.bmfbovespa.com.br/media/RoteiroCertificacaoFase3LiquidacaoIPNV2_2_2.pdf
- Cenário executado com Sucesso? Yes No

6. **BDIN – Data de liberação Produção Paralela.**

- **Proposta:**

- Liberação dos novos arquivos (BVBG086 e BVBG087) a partir de **abril/2016**, em regime de teste.
- Os atuais arquivos (BD e BDI) continuarão sendo gerados em paralelo até a entrada do IPN-V2.

7. **SINACOR – Liberação de versão.**

- As versões serão liberadas e publicadas às quintas-feiras.

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 6º GT (26/02/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

SINACOR

FASE 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

SISTEMAS DA CLEARING (1/2)

| Descrição | | Status |
|-----------|--|--------------------------------|
| Fase 3 | <p>Falta de harmonização de Cadastro (contas e vínculos), que implica nos seguintes problemas:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Repasse de operações. 2. Alocação em conta filhote de master. 3. Direcionamento de custódia. 4. Indisponibilidade da conta para transferência de saldo para custódia. | Corrigido em 26/02/16 ✓ |
| | O arquivo BVBG.48 não está sendo gerado. | Corrigido em 02/03/16 ✓ |
| | Hash de alocação: participante envia mensagem de solicitação bvmf.186, mas não recebe o arquivo BVBG.081 (AllocationHashResponse). | Corrigido em 02/03/16 ✓ |

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. | Em análise. |
| | 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> | |
| | O arquivo BVBG.018 não contém os campos relacionados às multas por falha de entrega de ativos. | |
| | O campo “tipo de pagamento” na mensagem bvmf.12 não está sendo preenchido para operações com liquidação bruta. | |

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 |
|---------------|--|--------------------------------|
| Fase 2 | Importação do arquivo de Vinculo BVBG.005 inconsistente sinacor apresenta erro NO DATA FOUND | Corrigido em 03/03/16 ✓ |
| | Atualização do vínculo de repasses - quando alterado um tipo de conta | |
| | Exportação de arquivos - quando há inclusão de documentos | |
| Fase 3 | 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 | |

SINACOR (2/2)

| Descrição | | Status |
|---------------|---|---|
| Fase 2 | Vinculo com status "Pendente de Conciliação" não aparece na tela de Conciliação | Previsão de correção em 17/03/16 |
| | Ao enviar a conta o sistema processou o arquivo de resposta porém não informa quais os campos que são obrigatórios. | |
| | Melhoria na mensagem para o usuário informando qual documento não é permitido para o tipo de cliente. | |
| | Cadastro de Documento BVMF -> Aceita hífen no documento. | |
| Fase 3 | Importação do BVBG28 com impersonate configurado para dois servidores diferentes | |
| | OMMFIIX está solicitando retransmissão – com frequência | |
| | Falha nos contadores do Windows | |
| | Serviço do comunicador está parado – na virada do dia | |

Principais avanços da semana

| Cenários G2 | | Status |
|-------------|-----------------|--|
| Fase 3 | OPA | <ul style="list-style-type: none"> Operações de OPA estão sendo inseridas na massa de teste conforme planejado. ✓ |
| | Follow-on / IPO | <ul style="list-style-type: none"> BVMF3 finalizado. ✓ RDES11 em andamento. Follow on de BVMF3 seguirá o cronograma: <ul style="list-style-type: none"> Início das reservas em 07/03/16. Fim das reservas em 08/03/16. Alocação em 09/03/16. Liquidação em 10/03/16. |
| | ETF Primário | <ul style="list-style-type: none"> Cenários de ETF Primário via tela testados com agentes autorizados. ✓ Demais participantes que solicitaram testes serão contatados hoje e agendados para próxima semana. |

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 6º GT (26/02/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

SINACOR

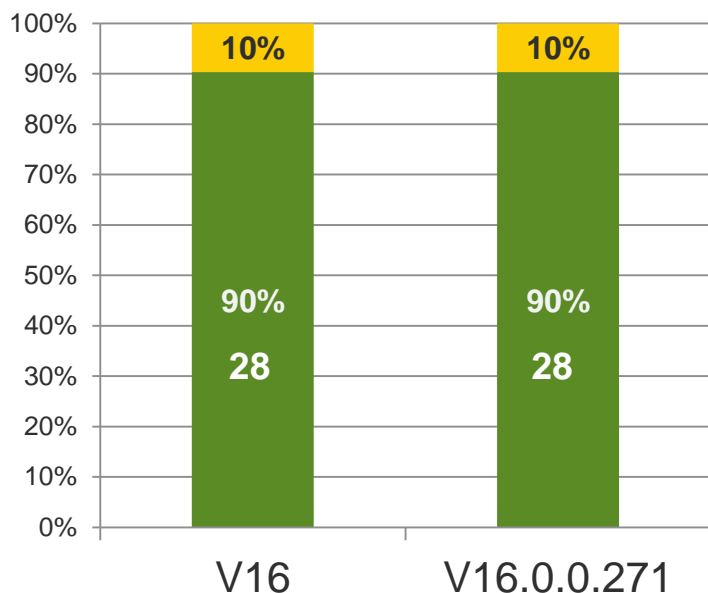
FASE 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

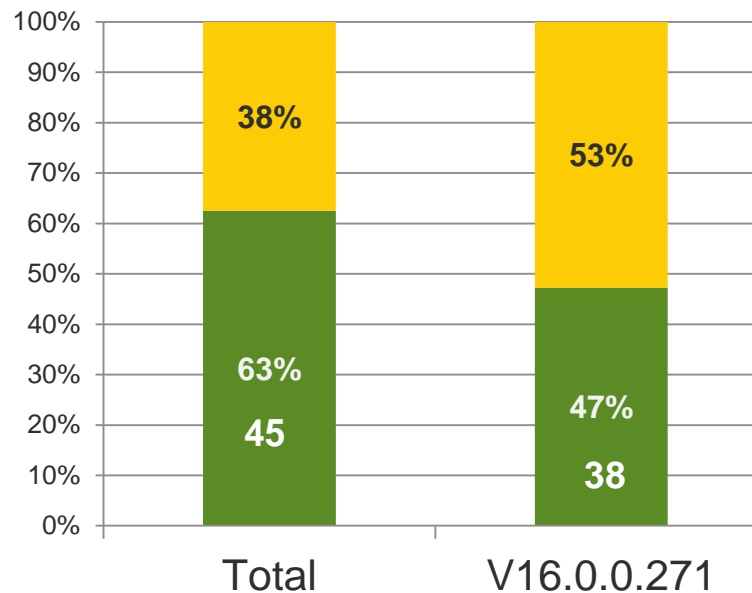
PRÓXIMOS PASSOS DA TE

Status da Versão SINACOR

Corretoras do GT = 31



Todas Corretoras = 72



V15.3 (Patch SINCAD) - Versão habilitada para produção SINCAD:

✓ Liberado em 01/03/16.

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 6º GT (26/02/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

SINACOR

FASE 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

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

(*) Semana adicional para conclusão da fase

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 6º GT (26/02/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

SINACOR

FASE 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

Acompanhamento

1. Conforme divulgado no 5º GT (19/02/16), 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. A seguir, será apresentada a evolução do progresso desenvolvida durante a última semana (de 26/02/16 a 03/03/16).

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

| Participante | Tela | Legado |
|-----------------|---|-------------------------------|
| Participante 1 | Progresso obtido até 25/02/16 | |
| Participante 2 | | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 3 | | |
| Participante 4 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 5 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 6 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 7 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 8 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 9 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 10 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 11 | Progresso obtido até 25/02/16 | |
| Participante 12 | Progresso obtido até 25/02/16 | Cenários não aplicáveis |
| Participante 13 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 14 | Evolução do progresso (26/02/16 a 03/03/16) | |
| Participante 15 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |

| Participante | Tela | Legado |
|-----------------|-------------------------------|---|
| Participante 16 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 17 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 18 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 19 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 20 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 21 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 22 | Progresso obtido até 25/02/16 | Evolução do progresso (26/02/16 a 03/03/16) |
| Participante 23 | | |
| Participante 24 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 25 | Progresso obtido até 25/02/16 | Evolução do progresso (26/02/16 a 03/03/16) |
| Participante 26 | Progresso obtido até 25/02/16 | Evolução do progresso (26/02/16 a 03/03/16) |
| Participante 27 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 28 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 29 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 30 | Progresso obtido até 25/02/16 | Cenários não aplicáveis |

| Participante | Tela | Legado |
|-----------------|---|---|
| Participante 31 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 32 | Progresso obtido até 25/02/16 | Cenários não aplicáveis |
| Participante 33 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 34 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 35 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 36 | Progresso obtido até 25/02/16 | |
| Participante 37 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 38 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 39 | Progresso obtido até 25/02/16 | Cenários não aplicáveis |
| Participante 40 | Evolução do progresso (26/02/16 a 03/03/16) | |
| Participante 41 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 42 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |
| Participante 43 | Progresso obtido até 25/02/16 | Cenários não aplicáveis |
| Participante 44 | Progresso obtido até 25/02/16 | Evolução do progresso (26/02/16 a 03/03/16) |
| Participante 45 | Progresso obtido até 25/02/16 | Progresso obtido até 25/02/16 |

- Progresso obtido até 25/02/16
- Evolução do progresso (26/02/16 a 03/03/16)
- Cenários não aplicáveis

1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (26/02/16 à 03/03/16)

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

| Participante | G1 | | G2 | |
|-----------------|------|--------|------|--------|
| | 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 | G1 | | G2 | |
|-----------------|------|--------|------|--------|
| | Tela | Legado | Tela | Legado |
| Participante 23 | | | | |
| Participante 24 | ■ | ■ | ■ | |
| Participante 25 | ■ | ■ | | |
| Participante 26 | ■ | ■ | ■ | |
| 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 | | | | |

- Progresso obtido até 25/02/16
- Evolução do progresso (26/02/16 a 03/03/16)
- Cenários não aplicáveis

1 – Fonte: Pesquisa TE com participantes (26/02/16 à 03/03/16)

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 6º GT (26/02/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

SINACOR

FASE 3 - PRAZOS

RESULTADO PARCIAL DAS FASES DE CERTIFICAÇÃO (GT)

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

Próximos passos da TE

1. Intensificação das visitas in loco para as fases de Certificação.
2. Próximo GT TE **em 11/03/16**.



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

