

# PROJETO DE INTEGRAÇÃO DAS CLEARINGS FASE 2

## 8ª 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*

## ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 7º GT (04/03/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

SINACOR

ATUAÇÃO IN LOCO

FASES 3 e 4 - PRAZOS

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

## Principais itens apontados:

1. Lista de emails unificada. ✓
2. Atendimento e automatização de chamados ✓
3. Procedimentos para G3 e lista de contraparte ✓
4. Questionário de Risco ✓
5. iMercado ✓
6. My CTC ✓
7. MTA – Fluxo de arquivos ✓

## 6. MyCTC - Inclusão de cenários para tela e arquivos/mensagens.

- Roteiros de G2 e G3 publicados.
- (G1 – disponível no final na próxima semana)

## 7. MTA – FLUXO DE ARQUIVOS

- MTA – Utilização das caixas E e W;
- Para os testes do SINCAD, sendo uma entrada antecipada, é utilizado o MTA que responde para IPN pré-V2 (usuários que começam com Exxxx);
- Para os testes da DEPOSITARIA (fase 3), foi criado um novo usuário e comunicado no workshop técnico e no workshop da fase de conectividade (usuários que começam com Wxxxx);

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 7º GT (04/03/16)

**PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA**

SINACOR

ATUAÇÃO IN LOCO

FASES 3 e 4 - PRAZOS

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

## SISTEMAS DA CLEARING

Descrição		Status
<b>Fase 3</b>	O campo “tipo de pagamento” na mensagem bvmf.12 não está sendo preenchido para operações com liquidação bruta.	Corrigido em <b>08/03/16</b> ✓
	Hash de alocação: participante envia mensagem de solicitação bvmf.186, mas não recebe o arquivo BVBG.081 (AllocationHashResponse).	Previsão de correção em <b>14/03/16</b>
	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>	

Lista de problemas conhecidos, detalhe dos cenários impactados e previsão de correção estão disponíveis no site: [http://ipn.bmfbovespa.com.br/media/PainelErros\\_Fase3\\_v3\\_0.pdf](http://ipn.bmfbovespa.com.br/media/PainelErros_Fase3_v3_0.pdf)

## SISTEMAS DA CLEARING

Descrição		Status
<b>Fase 3</b>	O agente de custódia não consegue visualizar na tela do RTC as operações de OPA que foram direcionadas a ele.	Em análise.
	O arquivo BVBG.018 não contém os campos relacionados às multas por falha de entrega de ativos.	

Lista de problemas conhecidos, detalhe dos cenários impactados e previsão de correção estão disponíveis no site: [http://ipn.bmfbovespa.com.br/media/PainelErros\\_Fase3\\_v3\\_0.pdf](http://ipn.bmfbovespa.com.br/media/PainelErros_Fase3_v3_0.pdf)



## SINACOR (1/2)

Descrição		Status
<b>Fase 2</b>	Vinculo com status "Pendente de Conciliação" não aparece na tela de Conciliação	Previsão de correção em <b>17/03/16</b>
	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.	
	Atualização do endereço vinculado.	
	Correção do cadastro do TAXID para investidor correto.	
	Atualização de consulta de contas inativas.	
	Correção da carga do código CVM no adaptar.	

## SINACOR (2/2)

Descrição		Status
<b>Fase 3</b>	Importação do BVBG28 com impersonate configurado para dois servidores diferentes	Previsão de correção em <b>17/03/16</b>
	OMMFIIX está solicitando retransmissão – com frequência	
	Falha nos contadores do Windows	
	Serviço do comunicador está parado – na virada do dia	

Cenários G2		Status
Fase 3	<b>OPA</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Operações de OPA continuarão sendo inseridas na massa de teste conforme planejado. ✓</li> </ul>
	<b>Follow-on / IPO</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>BVMF3 finalizado. (6 participantes testaram) ✓</li> <li>RDES11 finalizado. (4 participantes testaram) ✓</li> <li>BVMF3 (Nova chance) finalizado. (13 participantes testaram) ✓</li> <li><b>Nova oferta: RDES11 (Nova chance)</b> <ul style="list-style-type: none"> <li><b>Início reservas: 14/03 → Fim Reservas: 15/03</b></li> <li><b>Alocação: 16/03 e Liquidação: 17/03.</b></li> </ul> </li> </ul>
	<b>ETF Primário</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Todos os cenários de ETF Primário do roteiro foram testados com os agentes autorizados que solicitaram os testes ( tela e mensageria). ✓</li> <li>Problema de lentidão no recebimento da mensagem de captura bvmf.170.01 foi corrigido.</li> </ul>

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 7º GT (04/03/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

**SINACOR**

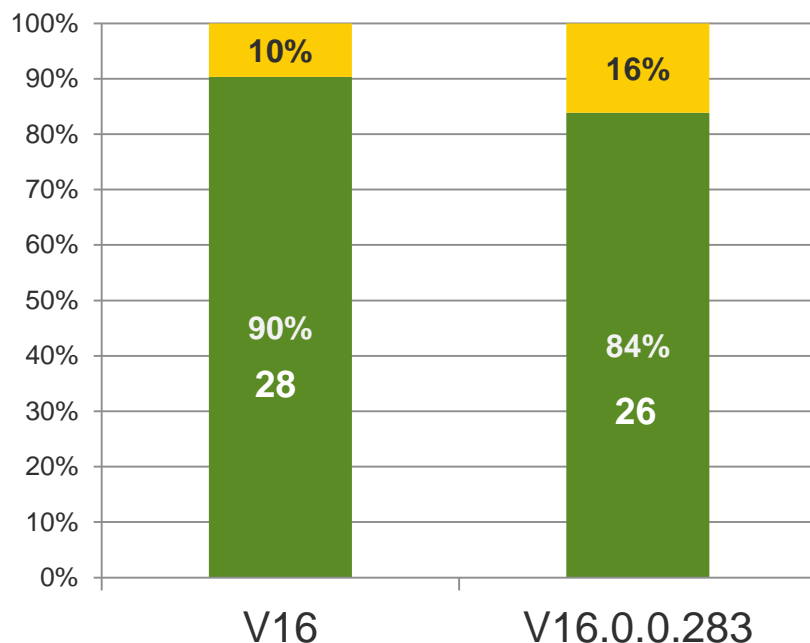
ATUAÇÃO IN LOCO

FASES 3 e 4 - PRAZOS

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

## Status da Versão SINACOR

### Corretoras do GT = 31



### Ponto de atenção:

- ✓ Atuação direta em 07 participantes que não iniciaram os testes F2 e F3 em virtude de problemas de conectividade (MTA e Secure Client).

### V15.0.3.221 (Patch SINCAD) - Versão habilitada para produção SINCAD:

- ✓ Liberado em 01/03/16.

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 7º GT (04/03/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

SINACOR

**ATUAÇÃO IN LOCO**

FASES 3 e 4 - PRAZOS

PRÓXIMOS PASSOS DA TE

- Nesta semana diversos participantes foram acompanhados in loco com uma força tarefa de diversas áreas da Bolsa (TE, Sinacor, CTC e áreas de negócio). Abaixo seguem alguns pontos capturados:
  - ✓ Desafios encontrados pela BM&FBOVESPA;
  - ✓ Alocação de recursos para testes no participante;
    - Falta de priorização;
    - Concorrência com a produção;
    - Preparação para execução dos testes (ex: concessão de acesso a usuários comuns, disponibilização de máquinas para testes, liberação de IPs e firewalls ,etc.)

- ✓ Falta de alinhamento e comunicação interna do participante;
- ✓ Equipe de projeto executando testes sem envolvimento da área de negócios;
- ✓ Processos internos dificultam o envolvimento da BM&FBOVESPA para atuação imediata;
- ✓ Versão do SINACOR, ambiente e máquinas desatualizadas;
- ✓ Dúvidas de negócio. Ex: hash da alocação.



## 1) Arquivo hash (BVBG.081.01)

- ✓ O arquivo hash permite ao participante realizar a conciliação de alocação de suas operações.
- ✓ O PNP ou PL podem solicitar o arquivo enviando a mensagem (bvmf.186.01) à BM&FBOVESPA.

## 2) Solicitação de arquivos via mensagem

- ✓ No caso de identificação de inconsistências na Alocação de seus negócios, após utilização do arquivo hash, os participantes podem, utilizando-se da mensagem (bvmf.018.02), solicitar os demais arquivos de alocação.

## Atual Fluxo de Conciliação (ACONET)

- 1. Requisição de Arquivos de Conciliação**
  - ✓ Participante solicita via mensagem, ou via tela, os arquivos de conciliação. Exemplo :
  - ✓ PNP: NEGR, PESCC, PEIQ, NALC
  - ✓ Agente de Compensação: AEIQ, ANPD, ANRP
- 2. Participante utiliza informações contidas nos arquivos e realiza conciliação com seus sistemas internos.**
- 3. Após conciliação, o participante identifica a causa das possíveis divergências na alocação de seus comitentes.**

## RTC - Conciliação com o Hash

- 1. Requisição do Hash Report**
  - ✓ Participante envia a mensagem ISO Hash Request (bvmmf186.01) solicitando arquivo Hash Report (bvbg.081.01).
- 2. Cálculo e Comparação das diferenças do Hash**
  - ✓ Participante calcula o Hash dos dados em seus sistemas e compara o Hash Report recebido pela BM&FBOVESPA.
- 3. Solicitar arquivos de conciliação**
  - ✓ Após identificação das eventuais diferenças, Participante requisita arquivos (bvmmf.018. 02) preenchendo os filtros obrigatórios (conta – lista e data pregão):
    - ✓ BVBG.012.02 – Negócios Capturados
    - ✓ BVBG.013.02 – Negócios Alocados
    - ✓ BVBG.014.02 – Repasses Enviados
    - ✓ BVBG.015.02 – Repasses Recebidos
- 4. Participante recebe os arquivos solicitados e identifica a natureza das divergências.**

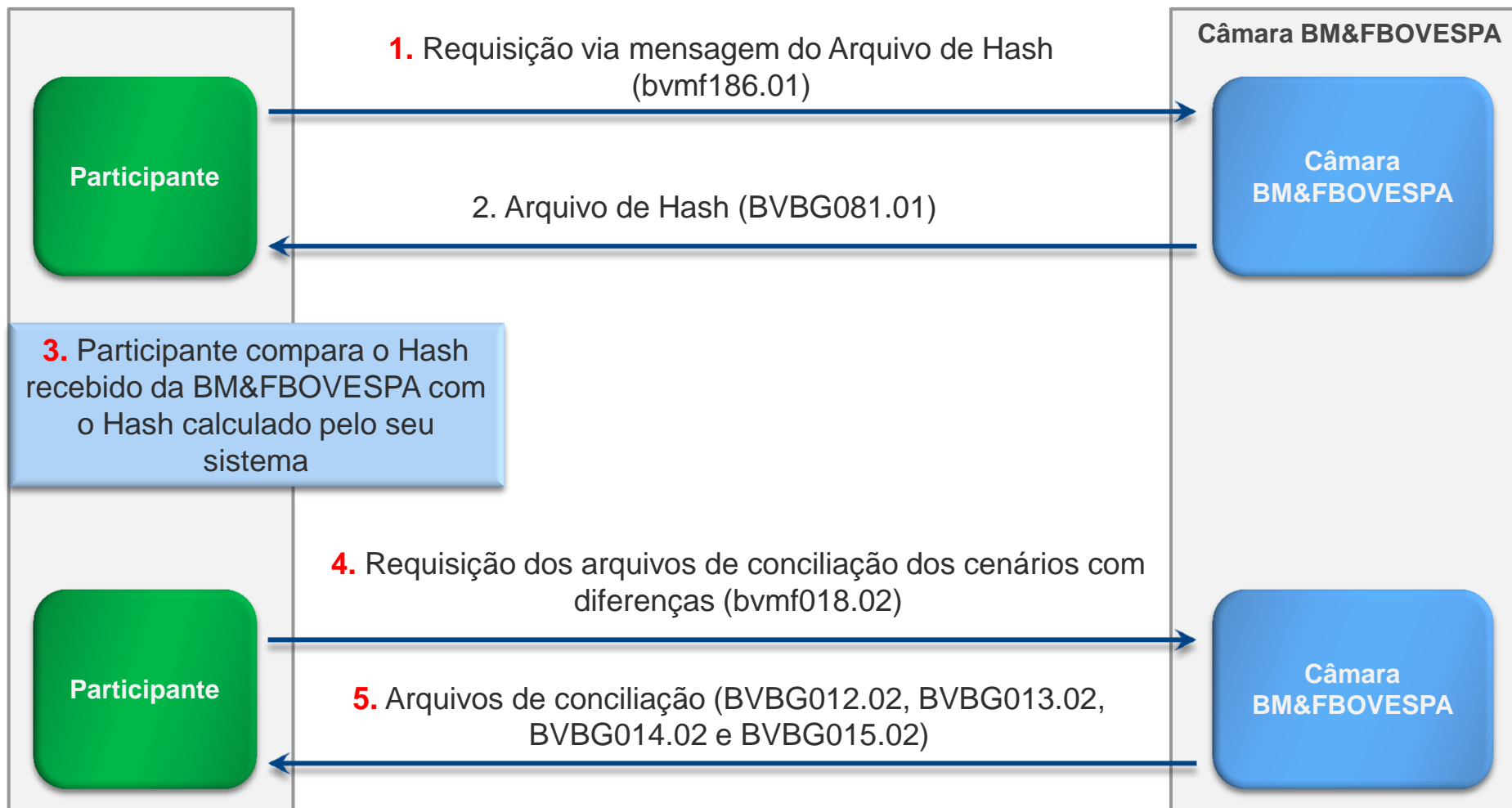
## 3) Solicitação arquivos via tela RTC

- ✓ A funcionalidade de solicitação de arquivos de alocação via tela do sistema RTC será descontinuada para acesso do PNP, PL e CST.

## 4) Arquivos End Of Day (EOD)

- ✓ A BM&FBovespa deixará de enviar os arquivos de alocação aos participantes no final do dia (arquivos EOD).

## RTC - Conciliação com o uso de Hash



## Conciliação - Hash

### 1. Atributos presentes na mensagem de solicitação do arquivo hash bvmf186.01

- ✓ Data do Pregão\* (\*obrigatório)
- ✓ Segmento (em lista)

➤ O participante pode, no momento da solicitação do arquivo hash, definir os segmentos de negócio que deseja receber para realizar a conciliação de suas alocações.

### 2. Atributos presentes no arquivo hash BVBG081.01

- ✓ Data do Pregão
- ✓ Segmento
- ✓ Mercado
- ✓ Conta
- ✓ Hash (Formato:[<Allocation Id>|<Allocation Status>|<Security Id>|<Security Exchange>|<Security Id Source>|<CustodianId>|<Custodian Account Id>|<Finality>|<Quantity>])

➤ No momento da conciliação, o participante poderá identificar as possíveis divergências de alocação no nível de posição das contas em um determinado mercado de instrumentos.

➤ Isso facilita a identificação da divergência e a definição dos filtros obrigatórios no momento da solicitação (BVMF.018.02) dos demais arquivos de Alocação (BVBG012.02, BVBG013.02, BVBG014.02 E BVBG015.02)

## Exemplo 1: Comparação de arquivo hash com divergência

**Cenário:** Negócio 10 de PETR4 está alocado para o **Cliente A** no sistema RTC - Câmara BM&FBOVESPA. Porém, no sistema interno do participante, o negócio está alocado na **Conta Máster A**.

- Arquivo hash RTC - Câmara BM&FBOVESPA

Data Pregão	Segmento	Mercado	Conta	Hash
15/05/2016	1	10	Cliente A	6d5fcedc2c3227*
15/05/2016	1	10	Máster A	4bc1d6c7d0002

- Hash Calculado pelo Participante

Data Pregão	Segmento	Mercado	Conta	Hash
15/05/2016	1	10	Cliente A	aa1f0c46dfae1
15/05/2016	1	10	Máster A	934da3e66bf8

A divergência é identificada pois o hash gerado pelo participante para as contas será diferente.

- Após identificar quais contas apresentam diferenças, o participante deve solicitar, utilizando a mensagem bvm018.02, os demais arquivos de alocação para identificar a causa da divergência e solucionar as diferenças, utilizando os filtros obrigatórios (conta em lista – limitado a 50 contas e data pregão).

\*sequência hash apenas para fim de exemplo.

## Exemplo 2: Comparação de arquivo hash sem divergência

**Cenário:** Todas as informações do sistema interno do participante correspondem corretamente às posições alocadas no sistema RTC - Câmara BM&FBOVESPA.

- Arquivo hash RTC - Câmara BM&FBOVESPA

Data Pregão	Segmento	Mercado	Conta	Hash
15/05/2016	1	10	Cliente A	6d5fcedc2c3227
15/05/2016	1	10	Máster A	4bc1d6c7d0002

- Hash Calculado pelo Participante

Data Pregão	Segmento	Mercado	Conta	Hash
15/05/2016	1	10	Cliente A	6d5fcedc2c3227
15/05/2016	1	10	Máster A	4bc1d6c7d0002

O hash gerado pelo participante será igual ao gerado pela Câmara.

→ Neste caso, o participante concluiu com sucesso o processo de Conciliação de Alocação. Todas as informações de alocação contidas em seu sistema interno estão de acordo com as informações do sistema da Câmara. Não sendo necessário solicitar nenhum outro arquivo.

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 7º GT (04/03/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

SINACOR

ATUAÇÃO IN LOCO

**FASE 3 e 4 - PRAZOS**

PRÓXIMOS PASSOS DA TE



## Atualização dos prazos para execução dos 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 <b>17/3</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Mercado à vista + ETF secundário (desde captura até recompra)</li> </ul>
	G2	22/2 a <b>17/3</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>OPA e Follow-on</li> <li>ETF primário</li> </ul>
	G3	7/3 a <b>17/3(*)</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Empréstimo (contratação)</li> </ul>
Fase 3: Liquidação e Fase 4: Risco e Garantias	G4	<b>21/3 a 24/3(*)</b>	<ul style="list-style-type: none"> <li>Empréstimo (posições e liquidação)</li> <li>Movimentações e consultas de garantias</li> </ul>
	G5	14/3 a <b>24/3(*)</b>	<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>

(\*) Semana adicional para conclusão da fase

ENCAMINHAMENTO DOS TEMAS DISCUTIDOS NO 7º GT (04/03/16)

PRINCIPAIS DESAFIOS ENCONTRADOS E AVANÇOS DA SEMANA

SINACOR

ATUAÇÃO IN LOCO

FASES 3 e 4 - PRAZOS

**PRÓXIMOS PASSOS DA TE**

## Próximos passos da TE

1. Novas visitas in loco para as fases de Certificação;
2. Atualização dos pontos focais das instituições;
  - A TE definiu especialistas por cada uma das instituições, que são responsáveis em mapear e acompanhar todas as questões do IPN.
  - Cada instituição deve definir um único ponto focal para interação com o seu especialista. Este ponto focal é responsável em manter a gestão do projeto.
3. Novas pesquisas de prontidão;
4. Próximo GT TE **em 18/03/16.**



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

