

Captura, Repasse e Alocação

BM&FBOVESPA

A Nova Bolsa



Definição dos Arquivos de Contingência – IPN V.2

1 Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição	Responsável
15/04/2016	v.1	Versão Inicial	
22/02/2017	v.2	Ajuste na nomenclatura dos campos.	

Descrição detalhada no documento “Histórico de Alterações”.

Este documento descreve um conjunto de definições de arquivos desenvolvidos pela BM&FBOVESPA, a serem utilizados nos processos de contingência de captura, alocação e repasse de operações.

A implantação da integração das câmaras da BM&FBOVESPA e do novo sistema de risco CORE (Closeout Risk Evaluation) depende de prévia autorização dos órgãos reguladores.

Contents

1	Histórico de Revisão.....	2
2	Visão geral.....	4
2.1	Escopo	4
2.2	O processo de alocação e repasse de operações em contingência	5
2.3	Acesso a tela de contingência no sistema RTC	6
2.4	<i>Layouts</i> dos arquivos de contingência.....	6
2.4.1	Inclusão de alocação e indicação de repasse (<i>Allocation Inclusion</i>).....	6
2.4.2	Exclusão de Alocação (<i>Allocation Exclusion</i>)	9
2.4.3	Aceitação e Rejeição de Repasse (<i>Accept/Reject Give up</i>).....	10
2.5	Resultado da solicitação de alocação	12

2 Visão geral

2.1 Escopo

Este documento descreve o processo de contingência desenvolvido pela BM&FBOVESPA para atender os fluxos de alocação e repasse de operações.

Entende-se por situação de contingência a impossibilidade de comunicação do sistema do participante com a estrutura da Câmara BM&FBOVESPA, privando a realização dos procedimentos necessários de alocação e repasse de negócios. A solução de contingência apresentada neste documento visa manter o nível de operacionalidade do participante, permitindo o prosseguimento das atividades referentes aos processos abaixo:

1. Inclusão de alocação;
2. Exclusão de alocação;
3. Indicação de repasse;
4. Aceitação e Rejeição de Repasse e;
5. Rejeição de Repasse fora da grade (cancelamento de repasse).

2.2 O processo de alocação e repasse de operações em contingência

A solução de contingência será disponibilizada aos participantes via menu na interface do sistema RTC – Real Time Clearing. O acesso a esse menu é exclusivo aos participantes em situação de contingência e será consentido previamente pela Câmara BM&FBovespa.

A tela de contingência possibilita ao participante realizar o envio (*upload*) de arquivos em formato CSV, cujos *layouts* estão descritos adiante neste documento, que serão processados pelo sistema RTC, realizando as ações de alocação e repasse. Possíveis erros no processo de alocação serão informados ao participante na tela de contingência, bem como a conclusão com sucesso das alocações dispostas no arquivo processado.

Após a realização das alocações e repasses, e reestabelecida a comunicação com a BM&FBovespa, o participante deverá realizar o processo de conciliação de alocação via Hash, principal modelo de conciliação. Arquivos ISO completos apenas serão disponibilizados aos participantes após análise e mediante autorização da Câmara BM&FBovespa.

2.3 Acesso a tela de contingência no sistema RTC

A tela de contingência de alocação será um dos menus disponíveis no RTC para Participante de Negociação Pleno (PNP) e Participante de Liquidação (PL).

O menu será disponibilizado ao participante somente após liberação do acesso, pela Câmara BM&FBovespa. Após a liberação, os usuários do participante com acesso as funcionalidades de alocação poderão acessar a tela de contingência e realizar o *upload* dos arquivos.

2.4 Layouts dos arquivos de contingência

O participante deve selecionar o tipo de operação que deseja realizar no menu da funcionalidade. Cada fluxo (inclusão de alocação, aceitação de repasse etc.) possui um *layout* padrão de arquivo em formato CSV para preenchimento das informações referentes ao processo selecionado e realização do *upload*¹.

O *layout* de cada arquivo possui as informações necessárias para o participante realizar o fluxo de alocação pretendido. Após o *upload* do arquivo, as informações ficam dispostas na tela para o participante realizar revisão dos dados e confirmar o seu envio.

2.4.1 Inclusão de alocação e indicação de repasse (*Allocation Inclusion*)

O *layout* do arquivo ***Allocation Inclusion*** é utilizado para solicitar as seguintes ações:

- i) Inclusão de Alocação (dentro ou fora da grade);
- ii) Indicação de Repasse (dentro ou fora da grade);
- iii) Direcionamento de Custódia; e

¹ Existe um limite (ASD após verificação técnica) do número de alocações presentes em um único *layout* CSV.

iv) Indicação de Carteira.

Estrutura do *layout* do arquivo *Allocation Inclusion*

Nome do Campo	Definição	Exemplo de preenchimento	Obrigatório	Observações
ParticipantName	Código de identificação do participante que está enviando o arquivo.	999	Sim	
AllocationId	Número identificador da alocação.	T-1- 145449352062 6-2	Sim	
Destination Account	Código da conta onde o negócio deverá ser alocado.	110	Sim	
Quantity	Quantidade da alocação a ser realizada.	100	Sim	
Custodian	Código do custodiante onde o negócio será direcionado.	999	Não	
CustodianAccount	Código da conta de custódia onde o negócio será direcionado.	2222	Não	
Finality	Código da carteira a ser identificada.	21016	Não	
OffHoursDelayResponsibility	Em caso de solicitação fora da grade, indica o participante responsável pela quebra de regra.	1	Não	Conforme External Code List, os domínios possíveis para este campo são: 1- Participante Origem 2- Participante Destino 3- BVMF

OffHoursIndicator	Identifica se a solicitação está fora da grade,	Y	Não	Os domínios possíveis para este campo são: Y- Sim N- Não
OffHoursReason	Em caso de solicitação fora da grade, identifica a justificativa.	2	Não	Conforme External Code List, os domínios possíveis para este campo são: 1- Participant's system failure 2- Client error 3- Operational error - participant 4- BVMF's system failure 5- Account changing between accounts with same ownership
Tradeld	Número do negócio a ser alocado.	250101	Não	Este atributo não é de preenchimento obrigatório. Porém, se o número de negócio for preenchido, o conteúdo do campo será validado.

2.4.2 Exclusão de Alocação (*Allocation Exclusion*)

O *layout* do arquivo ***Allocation Exclusion*** é utilizado para solicitar as seguintes ações: i) Exclusão de Alocação.

Estrutura do *layout* do arquivo ***Allocation Exclusion***

Nome do Campo	Definição	Exemplo de preenchimento	Obrigatório	Observações
Participant Name	Código de identificação do participante que está enviando o arquivo.	999	Sim	
AllocationId	Número identificador da alocação	T-1-1454493520626-2	Sim	
Account	Conta a ser excluída da alocação.	110	Sim	
Quantity	Quantidade da alocação a ser excluída.	100	Sim	
Tradeld	Número do negócio a ter alocação excluída.	250101	Não	O atributo não é obrigatório. Porém, se o número de negócio for preenchido, o campo será validado.

2.4.3 Aceitação e Rejeição de Repasse (*Accept/Reject Give up*)

O *layout do arquivo Accept/Reject Give up* é utilizado para realizar as seguintes ações:

- i) Aceitação de repasse,
- ii) Rejeição de Repasse,
- iii) Rejeição de repasse fora da grade,
- iv) Aceitação de cancelamento de repasse (aceitação de rejeição de repasse solicitado fora da grade) e;
- v) Rejeição de cancelamento de repasse (reprovação de rejeição de repasse solicitado fora da grade).

Estrutura do *layout do arquivo Accept/Reject Give up*

Nome do Campo	Definição	Exemplo de preenchimento	Obrigatório	Observações
ParticipantName	Código de identificação do participante que está enviando o arquivo.	999	Sim	
AllocationId	Número identificador da alocação.	T-1-1454493520626-2	Sim	
AffirmationStatus	Indica se o repasse ou cancelamento de repasse será aceito ou reprovado.	Y	Sim	Os domínios possíveis para este campo são: Y- Sim N- Não
OffHoursDelayResponsibility	Em caso de solicitação fora da grade, indica o participante responsável pela quebra de regra.	1	Não	Conforme External Code List, os domínios possíveis para este campo são: 1- Participante

				Origem 2- Participante Destino 3- BVMF
OffHoursIndicator	Identifica se a solicitação de alocação está fora da grade.	Y	Não	Os domínios possíveis para este campo são: Y- Sim N- Não
OffHoursReason	Em caso de solicitação fora da grade, identifica a justificativa.	2	Não	Conforme External Code List, os domínios possíveis para este campo são: 1- Participant's system failure 2- Client error 3- Operational error - participant 4- BVMF's system failure 5- Account changing between accounts with same ownership
Tradeld	Número do negócio de repasse a ser aceito ou reprovado.	250101	Não	O atributo não é obrigatório. Porém, se o número de negócio for preenchido, o campo será validado.

2.5 Resultado da solicitação de alocação

Após o envio (upload) dos arquivos contendo as solicitações de alocações, a tela do RTC apresentará a coluna *status da alocação*, com o resultado do processamento no final do *layout* base do arquivo.

No caso de erros na solicitação da alocação, outra coluna é gerada no resultado para descrever o erro encontrado.

Informações apresentadas na tela de resultado (após processamento do arquivo CSV enviado pelo participante)

Nome do Campo Adicional	Definição	Exemplo de preenchimento	Observações
Status da Alocação	Informa o resultado do processamento da solicitação.	Sucesso/Erro	Valores referentes ao <i>External_Code_List AllocationStatusAdvice</i>
Detalhe do Erro	Em caso de erro encontrado, o resultado do processamento irá informar o motivo da inconsistência.	<i>Trade ID was not found</i>	Preenchida apenas no caso do <i>Status da Alocação</i> ser do tipo Erro.

As informações da tela de resultado das alocações do RTC poderão ser exportadas em formato de arquivo em planilha.

 [linkedin.com/company/bm&fbovespa](https://www.linkedin.com/company/bm&fbovespa)

 twitter.com/bmfbovespa

 facebook.com/bolsapravoce

Visite o site da BM&FBOVESPA

bmfbovespa.com.br