



10 de novembro de 2015  
119/2015-DO

## COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da BM&FBOVESPA – Segmentos BOVESPA e BM&F

Ref.: **Plano de Homologação dos Participantes das Câmaras para Atendimento ao Projeto STR 23H59.**

Em 08/12/2014, o Banco Central do Brasil, por meio da Carta Circular 3682, esclareceu os procedimentos operacionais referentes à postergação do horário de fechamento de uma sessão específica do Sistema de Transferência de Reservas (STR).

Com o objetivo de auxiliar o processo homologatório dos participantes, informamos a disponibilização do roteiro de testes, que segue anexo, com o detalhamento dos cenários que devem ser testados pelos participantes da Câmara BM&FBOVESPA, da Câmara de Ações e Renda Fixa Privada, da Câmara de Câmbio e da Câmara de Ativos.

O documento descreve as datas em que as câmaras postergarão o encerramento no ambiente de homologação, bem como os cenários a serem realizados pelos participantes em cada dia.

Esclarecimentos adicionais poderão ser obtidos com a Superintendência de Entrega e Pagamento, pelos telefones (11) 2565-4757/4255 ou pelo e-mail [str2359@bvmf.com.br](mailto:str2359@bvmf.com.br).

Atenciosamente,

  
Cícero Augusto Vieira Neto

Diretor Executivo de Operações, Clearing e Depositária

**BM&FBOVESPA**

*A Nova Bolsa*



# Roteiro de Testes

**Projeto STR 23h59**

Versão: 1.1

## Histórico de Versões

Data	Versão	Descrição	Autor
26/10/2015	1.0	Criação do documento	BVMF
09/11/2015	1.1	Inserção de planejamento dos testes	BVMF

## Conteúdo

1. INTRODUÇÃO .....	4
2. DATAS DE REALIZAÇÃO DOS TESTES .....	5
3. INSTITUIÇÕES PARTICIPANTES .....	5
4. TIPOS DE CENÁRIOS DE TESTE.....	5
5. PROGRAMAÇÃO DOS CENÁRIOS DE TESTE .....	6
6. CENÁRIOS ESPECÍFICOS .....	8

## 1. INTRODUÇÃO

O Banco Central do Brasil, em 08 de dezembro de 2014, emitiu a Carta Circular Nº 3.682, através da qual esclarece os procedimentos operacionais referentes à postergação do horário de fechamento de uma sessão específica do Sistema de Transferência de Reservas (STR). Resolve ainda, conforme descrito no artigo 1º do mesmo documento: “A postergação do horário de fechamento do STR, de que trata o § 3º do art. 9º do regulamento anexo à Circular nº 3.100, de 28 de março de 2002, poderá estender-se, excepcionalmente, para além das 23h59 da sessão específica, motivada por situações de grave indisponibilidade técnica do sistema”.

As Câmaras da BM&FBOVESPA são consideradas infraestruturas do mercado financeiro (IMFs), e atuam como Contraparte Central Garantidora para mercados considerados sistemicamente importantes pelo Banco Central do Brasil. As Câmaras e seus participantes devem, obrigatoriamente, acessar o STR para a realização de instruções de pagamento. Assim, no caso de postergação do STR após as 23h59, as atividades de pós-negociação, executadas pelas Câmaras e pela Central Depositária, serão impactadas.

Os testes contidos nesse plano visam fornecer as instituições financeiras um roteiro que assegure a homologação dos processos de Liquidação dos direitos e das obrigações perante as Câmaras da BM&FBOVESPA e de encerramento, em caso de postergação do horário de fechamento do STR para além das 23h59.

## 2. DATAS DE REALIZAÇÃO DOS TESTES

Os ambientes de Certificação das 4 Câmaras (Câmara BM&FBOVESPA, Câmara de Ações, Câmara de Câmbio e Câmara de Ativos) terão seu horário de fechamento alterados para as 11h00 do dia seguinte nas seguintes datas:

Data ABERTURA Câmara	Data FECHAMENTO Câmara
10/11/2015	11/11/2015
12/11/2015	13/11/2015
17/11/2015	18/11/2015
19/11/2015	20/11/2015
24/11/2015	25/11/2015
26/11/2015	27/11/2015
01/12/2015	02/12/2015
03/12/2015	04/12/2015
08/12/2015	09/12/2015
10/12/2015	11/12/2015
15/12/2015	16/12/2015
17/12/2015	18/12/2015
22/12/2015	23/12/2015
29/12/2015	30/12/2015

## 3. INSTITUIÇÕES PARTICIPANTES

Instituições participantes das Câmaras da BM&FBOVESPA.

## 4. TIPOS DE CENÁRIOS DE TESTE

Os cenários de testes relacionados neste documento devem ser feitos de acordo com a programação constante no item 5 e podem se dividir em 3 diferentes tipos de cenário:

<b>Tipo A</b>	
<b>As mensagens:</b>	<b>Devem ser enviadas:</b>
LDL0001 definitiva, LDL0007, LDL0013, LTR0001 ou LTR0007	Antes das 23h59
LDL0003, LDL0004, LDL0008, LDL0014, LTR0004 ou LTR0008	Antes das 23h59
LDL0005, LDL0006, LDL0009, LDL0015, LTR0005 ou LTR0006	Após as 23h59

<b>Tipo B</b>	
<b>As mensagens:</b>	<b>Devem ser enviadas:</b>
LDL0001 definitiva, LDL0007, LDL0013, LTR0001 ou LTR0007	Antes das 23h59
LDL0003, LDL0004, LDL0008, LDL0014, LTR0004 ou LTR0008	Após as 23h59
LDL0005, LDL0006, LDL0009, LDL0015, LTR0005 ou LTR0006	Após as 23h59

<b>Tipo C</b>	
<b>As mensagens:</b>	<b>Devem ser enviadas:</b>
LDL0001 definitiva, LDL0007, LDL0013, LTR0001 ou LTR0007	Após as 23h59
LDL0003, LDL0004, LDL0008, LDL0014, LTR0004 ou LTR0008	Após as 23h59
LDL0005, LDL0006, LDL0009, LDL0015, LTR0005 ou LTR0006	Após as 23h59

## 5. PROGRAMAÇÃO DOS CENÁRIOS DE TESTE

Data ABERTURA Câmara	Data FECHAMENTO Câmara	Cenários a serem realizados no dia	Tipo do Cenário
10/11/2015	11/11/2015	4,5,6,11,12,14,15,16,17,23,27,28,30,32,34,35,36,37,41,42,43,44,47,48,49,57,58,59,60	A
12/11/2015	13/11/2015	4,5,7,13,14,15,16,18,24,29,31,33,34,35,36,38,45,46,47,48,50,61,62	B
17/11/2015	18/11/2015	4,5,8,11,12,14,15,16,19,25,26,27,28,30,32,34,35,36,39,40,41,42,43,44,47,48,51,57,58,59,60	C
19/11/2015	20/11/2015	4,5,9,10,13,14,15,16,20,21,25,26,29,31,33,40,45,46,52,61,62	A
24/11/2015	25/11/2015	4,5,6,11,12,14,15,16,17,23,27,28,30,32,34,35,36,37,41,42,43,44,47,48,49,57,58,59,60	B
26/11/2015	27/11/2015	4,5,7,13,14,15,16,18,24,29,31,33,34,35,36,38,45,46,47,48,50,61,62	C
01/12/2015	02/12/2015	4,5,8,11,12,14,15,16,19,24,27,28,30,32,34,35,36,39,40,41,42,43,44,47,48,51,57,58,59,60	A
03/12/2015	04/12/2015	4,5,9,10,13,14,15,16,20,21,25,26,29,31,33,40,45,46,52,61,62	B
08/12/2015	09/12/2015	4,5,6,11,12,14,15,16,17,23,27,28,30,32,34,35,36,37,41,42,43,44,47,48,49,57,58,59,60	C
10/12/2015	11/12/2015	4,5,7,13,14,15,16,18,23,29,31,33,34,35,36,38,45,46,47,48,50,61,62	A
15/12/2015	16/12/2015	4,5,8,11,12,14,15,16,19,24,27,28,31,33,34,35,36,39,40,41,42,43,44,47,48,51,57,58,59,60	B
17/12/2015	18/12/2015	4,5,9,10,13,14,15,16,20,21,25,26,29,30,32,40,45,46,52,61,62	C
22/12/2015	23/12/2015	Sob Demanda	Sob Demanda
29/12/2015	30/12/2015	Sob Demanda	Sob Demanda

O grupo de cenários de 56 a 61 podem ser realizados sob demanda. Para solicitar a execução destes cenários, o participante deve entrar em contato com a Superintendência de Entrega e Pagamento pelos telefones (11) 2565-4757/4255 ou pelo e-mail [str2359@bvmf.com.br](mailto:str2359@bvmf.com.br).

## 6. CENÁRIOS ESPECÍFICOS

### Processo de abertura e encerramento (para todas as Câmaras em todas as datas)

Cenário		Resultado Esperado
1	Câmara avisa Abertura	BVMF envia mensagens LDL0028 informando a Abertura da Câmara
2	Liquidação Provisória - envio das LDL0001	BVMF envia mensagens LDL0001 provisórias para IFs
3	Câmara avisa Fechamento	BVMF envia mensagens LDL0029 informando o Fechamento da Câmara

### Câmara BM&FBOVESPA - Liquidação pelo saldo líquido multilateral

Cenário		Resultado Esperado
4	Liquidação Definitiva - envio das LDL0001	BVMF envia mensagens LDL0001 definitivas para IFs
5	Liquidação Definitiva - envio da LDL0002	BVMF envia LDL0002 definitiva para BACEN
6	Liquidação Definitiva – com sucesso e com confirmação	a) IF Devedora envia LDL0003 confirmando a operação b) IF Devedora envia mensagem LDL0004 para o STR
7	Liquidação Definitiva – com sucesso e sem confirmação	IF Devedora envia mensagem LDL0004 para o STR
8	Liquidação Definitiva – com valor a maior da IF Devedora	a) IF Devedora envia mensagem LDL0004 com valor a maior para o STR b) BVMF envia a mensagem LDL0006 para o STR com o valor da diferença a maior informada pela IF Devedora na mensagem LDL0004
9	Liquidação Definitiva - envio das LDL0005 para IF Credoras	BVMF envia mensagens LDL0005 para IFs Credoras
10	IF Liquidante efetua pagamento não solicitado	a) IF envia mensagem LDL0004 sem ter recebido nenhuma mensagem da BVMF b) BVMF envia a mensagem LDL0006 para o STR com o valor informado pela IF na mensagem LDL0004

### Câmara BM&FBOVESPA – Processo de movimentação de garantias

Cenário		Resultado Esperado
11	Depósito de Garantias Financeiras - envio da LDL0013	BVMF envia mensagens LDL0013 para IFs
12	Depósito de Garantias Financeiras – envio da LDL0014	IF liquidante Devedora envia mensagem LDL0014 para o STR

13	Retirada de Garantias Financeiras - envio das LDL0015	BVMF envia mensagens LDL0015 para o STR
----	---	---

### Câmara Ações e Renda Fixa Privada - Liquidação pelo saldo líquido multilateral

	Cenário	Resultado Esperado
14	Liquidação Definitiva - envio das LDL0001	BVMF envia mensagens LDL0001 definitivas para IFs
15	Liquidação Definitiva - envio da LDL0002	BVMF envia LDL0002 definitiva para BACEN
16	Resultado líquido de negociações por participantes – envio da CBL1908	BVMF envia CBL1908 definitiva para IF
17	Liquidação Definitiva – com sucesso e com confirmação	a) IF Devedora envia LDL0003 confirmando a operação b) IF Devedora envia mensagem LDL0004 para o STR
18	Liquidação Definitiva – com sucesso e sem confirmação	a) IF Devedora envia mensagem LDL0004 para o STR
19	Liquidação Definitiva – com valor a maior da IF Devedora	a) IF Devedora envia mensagem LDL0004 com valor a maior para o STR b) BVMF envia a mensagem LDL0006 para o STR com o valor da diferença a maior informada pela IF Devedora na mensagem LDL0004
20	Liquidação Definitiva - envio das LDL0005 para IF Credoras e entrega dos títulos	BVMF envia mensagens LDL0005 para IFs Credoras
21	IF Liquidante efetua pagamento não solicitado	a) IF envia mensagem LDL0004 sem ter recebido nenhuma mensagem da BVMF b) BVMF envia a mensagem LDL0006 para o STR com o valor informado pela IF na mensagem LDL0004

### Câmara de Ações e Renda Fixa Privada – Processo de liquidação módulo bruto e bilateral

	Cenário	Resultado Esperado
23	Liquidação Bruta – entre IFs com sucesso e com confirmação	a) BVMF envia mensagem LTR0001 para IF Devedora b) IF Devedora envia LTR0002 confirmando a operação c) IF Devedora envia mensagem LTR0004 para o STR d) BVMF envia mensagem LTR0005 para o STR
24	Liquidação Bruta – entre IFs com sucesso e sem confirmação	a) BVMF envia mensagem LTR0001 para IF Devedora b) IF Devedora envia mensagem LTR0004 para o STR c) BVMF envia mensagem LTR0005 para o STR
25	Liquidação Bruta – IF informa confirmação de operações de "não liquidantes" da mesma IF	a) BVMF envia mensagem LTR0007 para IF b) IF confirma operação utilizando LTR0008
26	IF efetua pagamento não solicitado	a) IF envia mensagem LTR0004 sem ter recebido nenhuma mensagem da BVMF b) BVMF envia mensagem LTR0006 devolvendo o montante da mensagem LTR0004

**Câmara de Ações e Renda Fixa Privada – Processo de movimentação de garantias**

Cenário	Resultado Esperado
27 Depósito de Garantias Financeiras - envio das LDL0013	BVMF envia mensagens LDL0013 para IFs
28 Depósito de Garantias Financeiras – envio da LDL0014	IF Devedora envia mensagem LDL0014 para o STR
29 Retirada de Garantias Financeiras - envio das LDL0015	BVMF envia mensagens LDL0015 para o STR

**Câmara de Ações e Renda Fixa Privada – Processo de eventos e emissões / Tesouro Direto**

Cenário	Resultado Esperado
30 Liquidação de eventos e emissões – Pagamento de dividendos e JCP	BVMF envia mensagens LDL0009 para o STR
31 Liquidação de eventos e emissões – Direito de subscrição	a) BVMF envia mensagens LDL0007 para Liquidantes dos Agentes de Custódia b) Liquidante do Agente de Custódia envia mensagem LDL0008 para o STR
32 Liquidação de compras no Tesouro Direto	a) BVMF envia mensagens LDL0007 para Liquidantes dos Agentes de Custódia b) Liquidantes dos Agentes de Custódia envia mensagem LDL0008 para o STR
33 Liquidação de vendas no Tesouro Direto	BVMF envia mensagens LDL0009 para o STR

**Câmara de Câmbio - Liquidação pelo saldo líquido multilateral**

Cenários	Resultado Esperado
34 Liquidação Definitiva - envio das LDL0001	BVMF envia mensagens LDL0001 Definitiva para IFs
35 Liquidação Definitiva – informa saldo devedor em moeda estrangeira BMC0101	BVMF envia mensagens BMC0101 Definitivas para IFs
36 Liquidação Definitiva - envio da LDL0002	BVMF envia LDL0002 Definitiva para BACEN
37 Liquidação Definitiva – com sucesso e com confirmação	a) IF Devedora envia LDL0003 confirmando a operação b) IF Devedora envia mensagem LDL0004 para o STR
38 Liquidação Definitiva – com sucesso e sem confirmação	IF Devedora envia mensagem LDL0004 para o STR
39 Liquidação Definitiva - envio das LDL0005	BVMF envia mensagens LDL0005 para IFs

40	IF Liquidante efetua pagamento não solicitado	a) IF envia mensagem LDL0004 sem ter recebido nenhuma mensagem da BVMF b) BVMF envia a mensagem LDL0006 para o STR com o valor informado pela IF na mensagem LDL0004
----	---	---

### Câmara de Câmbio - Processo de movimentação de garantias

Cenários	Resultado Esperado	
41	Participante requisita Aceite de depósito	IF envia mensagem LDL1002 para a BVMF
42	Participante requisita depósito	IF envia mensagem LDL1003 para a BVMF
43	Depósito de Garantias Financeiras - envio das LDL0013	BVMF envia mensagem LDL0013 para IFs
44	Depósito de Garantias Financeiras – envio da LDL0014	IF Devedora envia mensagem LDL0014 para o STR
45	Participante requisita retirada	IF envia LDL1006 para a BVMF
46	Retirada de Garantias Financeiras – envio da LDL0015	BVMF envia a mensagem LDL0015 para o STR

### Câmara de Ativos - Liquidação pelo saldo líquido multilateral

Cenário	Resultado Esperado	
47	Liquidação Definitiva - envio das LDL0001	BVMF envia mensagens LDL0001 definitivas para IFs
48	Liquidação Definitiva - envio da LDL0002	BVMF envia LDL0002 definitiva para BACEN
49	Liquidação Definitiva – com sucesso e com confirmação	a) IF Devedora envia LDL0003 confirmando a operação b) IF Devedora envia mensagem LDL0004 para o STR
50	Liquidação Definitiva – com sucesso e sem confirmação	IF Devedora envia mensagem LDL0004 para o STR
51	Liquidação Definitiva - envio das LDL0005	BVMF envia mensagens LDL0005 para IFs
52	IF Liquidante efetua pagamento não solicitado	a) IF envia mensagem LDL0004 sem ter recebido nenhuma mensagem da BVMF b) BVMF envia a mensagem LDL0006 para o STR com o valor informado pela IF na mensagem LDL0004

### Câmara de Ativos - Liquidação de ativos pelo saldo líquido multilateral – Cenários sob demanda

Cenário	Resultado Esperado	
53	Liquidação de Ativos - envio das BMA0015 de débito	BVMF envia mensagens BMA0015 para Custodiantes
54	Liquidação de Ativos – Envio de SEL1023 de débito	Custodiante envia mensagem SEL1023 para SELIC com o número de operação fornecido na BMA0015 de débito
55	Liquidação de Ativos - envio das BMA0015 de crédito	BVMF envia mensagens BMA0015 para Custodiantes

56	Liquidação de Ativos – Envio de SEL1023 de crédito	Custodiante envia mensagem SEL1023 para SELIC com o número de operação fornecido na BMA0015 de crédito
----	--	--

### Câmara de Ativos – Processo de movimentação de garantias

Cenário		Resultado Esperado
57	Participante requisita Aceite de depósito	IF envia mensagem LDL1002 para a BVMF
58	Participante requisita depósito	IF envia mensagem LDL1003 para a BVMF
59	Depósito de Garantias Financeiras - envio das LDL0013	BVMF envia mensagens LDL0013 para IFs
60	Depósito de Garantias Financeiras – envio da LDL0014	IF envia mensagem LDL0014 para o STR
61	Participante requisita retirada	IF envia LDL1006 para a BVMF
62	Retirada de Garantias Financeiras - envio das LDL0015	BVMF envia mensagens LDL0015 para o STR