

Projeto Liquidação D+2

Especificação Técnica das Alterações de Modelo de Negócio e de Processos para Liquidação D+2

SINACOR
Especificação Técnica



Sumário

1	Introdução	3
2	Histórico de Revisão	4
3	Faturamento Bovespa	5
3.1	Contextualização	5
3.2	Alterações estruturais	5
3.2.1	Tabela TBOINTR_TS	5
3.2.2	Tabela TBOCTRMOV	6
3.2.3	Tabela TBODETFIN02	6
3.2.4	Procedure pBo_Rateio.pBo_Rateio	6
3.2.5	Procedure pBo_Detfin.pBo_ApuraVICorresp	6
3.2.6	Procedure pBo_Fin.pBo_AcertaFinCliCorresp	7
4	Tesouraria	7
4.1	Contextualização	7
4.1.1	Tabela TTSINTBO, TTSPMCLIPAP, TTSPMCLIMOV, TTSCCLIPAP e TTSCCLIMOV.	8
4.1.2	Tabela TTSPARAM	8
5	Módulo de Ordens	9
5.1	Contextualização	9

1 Introdução

O objetivo do documento é apresentar as mudanças técnicas no SINACOR decorrentes do Projeto de Liquidação D+2.



2 Histórico de Revisão

Data	Versão	Alterações
21/08/2018	1.0	Versão Inicial



3 Faturamento Bovespa

3.1 Contextualização

Atualmente, o SINACOR possui um módulo de Faturamento para Derivativos e outro para Equities.

Para o projeto Liquidação D+2, será criado um processo de integração intradiária das informações registradas no Faturamento Bovespa para o módulo de Tesouraria do SINACOR e serão realizadas alterações no fechamento para possibilitar a existência de ambos os processos: integração intradiária e fechamento do Faturamento Bovespa.

Os processos realizados no fechamento que sofrerão adaptações são:

- Acerto de dias anteriores;
- Contabilização;
- Tratamento de Correspondente;
- Rateio;
- Integração para Contas Correntes;
- Integração para Tesouraria;
- Integração para Custódia;
- Controle de cobrança de IR sobre Operações;
- Ajustes de valores de Brokerage.

3.2 Alterações estruturais

3.2.1 Tabela TBOINTR_TS

Tabela responsável por enviar a integração do módulo Faturamento Bovespa para o módulo de Tesouraria no processo de fechamento. Essa tabela não sofrerá alteração em sua chave primária e, portanto, seu relacionamento com as demais tabelas dentro do módulo se manterá intacta.

3.2.1.1 Colunas incluídas

- COD_CART: código da carteira.
- COD_AGCT: código do Agente de Custódia;
- COD_CON_CUST: código da conta no Agente de Custódia;
- DATA_FALH_REPR: data de falha da recompra.



3.2.2 Tabela TBOCTRM0V

Tabela responsável por armazenar os eventos de acerto e servir de orquestradora para todo o tratamento de acerto de dia anterior no módulo Faturamento Bovespa.

3.2.2.1 Coluna incluída

- NUM_SEQ_EXEC_PRE_BATM: número sequencial de execução do pre-matching. Essa nova coluna passará a informar qual o processo que identificou o acerto e qual o número de sua execução. Com essa nova coluna, todas as queries que referenciam essa tabela serão adaptadas para olharem para essa nova coluna.

3.2.3 Tabela TBODETFIN02

Tabela responsável por armazenar o resultado do rateio no fechamento do módulo Faturamento Bovespa. Essa tabela não sofrerá alteração em sua chave primária e, portanto, seu relacionamento com as demais tabelas dentro do módulo se manterá intacta.

3.2.3.1 Coluna incluída

- NUM_REPR: número da recompra.

3.2.4 Procedure pBo_Rateio.pBo_Rateio

Procedure responsável pela realização dos rateios nos módulos Bovespa.

3.2.4.1 Parâmetro incluído

- P_nNumSeqPreMatch: número sequencial de execução do pre-matching.

3.2.4.2 Parâmetro com comportamento modificado

- P_nProcesso: identificação do processo consumidor da rotina (1 – Fechamento, 2 – Fax e 3 – Pre-Matching).

3.2.5 Procedure pBo_Detfin.pBo_ApuraVICorresp

Procedure responsável pela distribuição dos repasses dos correspondentes entre os clientes que tiveram as operações realizadas através desses correspondentes.



3.2.5.1 Parâmetros incluídos

- P_nNumSeqPreMatch: número sequencial de execução do pre-matching;
- P_nOrigem: identificação do processo consumidor da rotina (0 – fechamento e 1 – pre-matching).

3.2.6 Procedure pBo_Fin.pBo_AcertaFinCliCorresp

Procedure responsável pela distribuição dos repasses dos correspondentes entre os clientes que tiveram as operações realizadas através desses correspondentes.

3.2.6.1 Parâmetros incluídos

- P_nNumSeqPreMatch: número sequencial de execução do pre-matching;
- P_nOrigem: identificação do processo consumidor da rotina (0 – fechamento e 1 – pre-matching).

4 Tesouraria

4.1 Contextualização

No atual modelo do SINACOR o processamento das informações de equities são realizados somente na abertura do Tesouraria, com esse novo modelo devemos receber todas as informações em Real-time com o módulo faturamento Bovespa.

Os processos alterados serão:

- Pre-Match;
- Integração de Papéis;
- Tratamento de Pendencias;
- Alterações estruturais

Os novos processos que serão desenvolvidos são:

- Integração IMERCADO
- Restrições de Ações.



4.1.1 Tabela TTSINTBO, TTSPMCLIPAP, TTSPMCLIMOV, TTSCCLIPAP e TTSCCLIMOV.

Tabela responsáveis pelo Pre-Match, Atualização de Pendências e conciliação do SINACOR receberão novas colunas afim de padronização com o novo modelo de liquidação já implantado no IPN V2.

4.1.1.1 Colunas incluídas

- COD_CART: código da carteira.
- COD_AGCT: código do Agente de Custódia;
- COD_CON_CUST: código da conta no Agente de Custódia;
- DATA_FALH_REPR: data de falha da recompra.

4.1.2 Tabela TTSPARAM

Tabela de parâmetros do módulo Tesouraria.

4.1.2.1 Colunas incluídas

- IND_PRE_BATM: Indicador de utilização do Pre-Match. Estamos migrando esse parâmetro que ficava anteriormente na tabela TXFBPARAM_GLOB_SINACOR parâmetro 11. Hoje a grande maioria das instituições não utiliza esse processo.
- IND_PRE_BATM_OLNE: Indicador de tratamento do processo de Pre-Match ONLINE.



5 Módulo de Ordens

5.1 Contextualização

Como os acessos ao novo módulo de Ordens devem ser feitas através dos serviços públicos, não haverá divulgação das alterações em tabelas.