

**PROJETOS E INICIATIVAS**

**2º SEMESTRE 2018**

**PCO CAPTURA,  
ALOCAÇÃO E  
REPASSE**





# AGENDA

**1. INTRODUÇÃO**

**2. PCO CAPTURA, ALOCAÇÃO E REPASSE**

**3. PRÓXIMOS PASSOS**

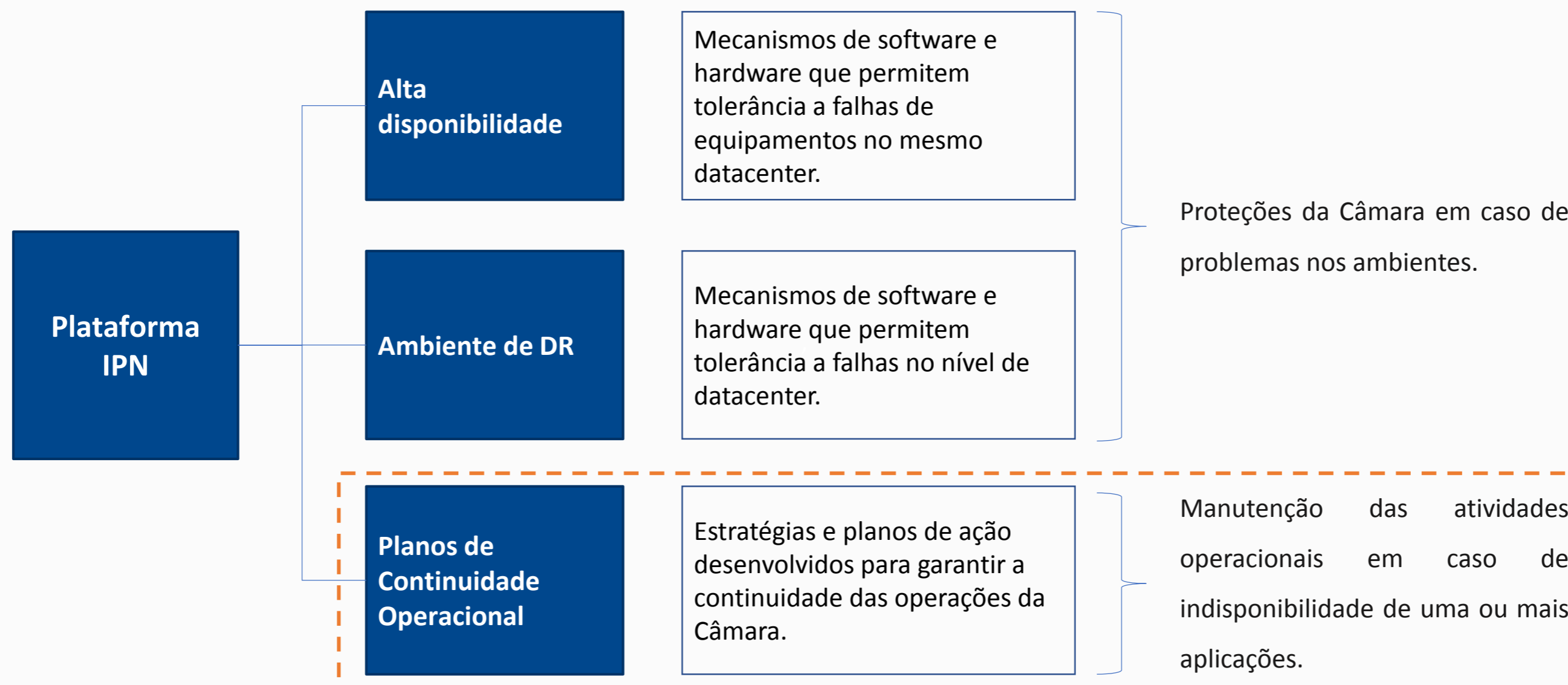
## CAPÍTULO 1

# INTRODUÇÃO



## INTRODUÇÃO

### Resiliência da Plataforma IPN

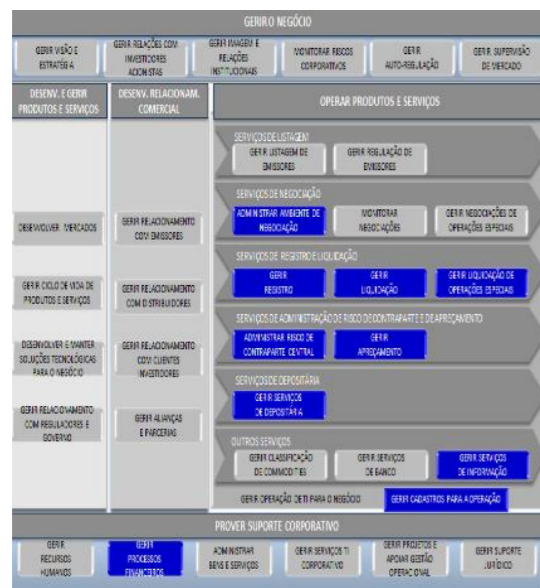


## INTRODUÇÃO

### Metodologia para levantamento e priorização cenários para PCOs

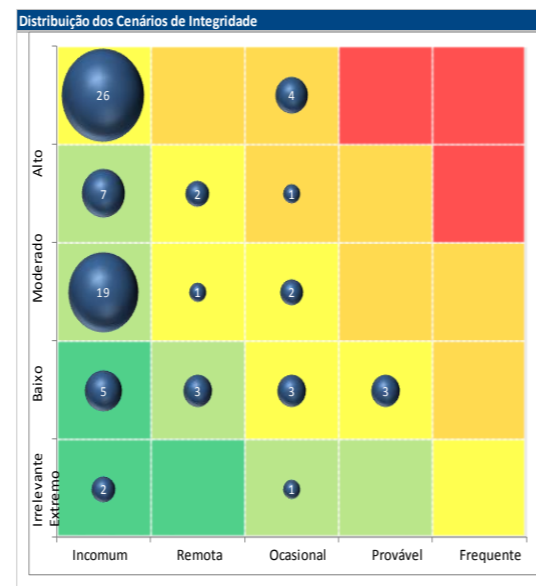
#### 1 Levantamento

- Utilizando como base os processos da pós-negociação, foram levantados potenciais **cenários de quebra de integridade e indisponibilidade**.



#### 2 Distribuição

- 85 cenários mapeados** (28 levantados na V1 e 57 da V2);
- Fatores considerados:
  - Impacto nos processos; e
  - Probabilidade de ocorrência.



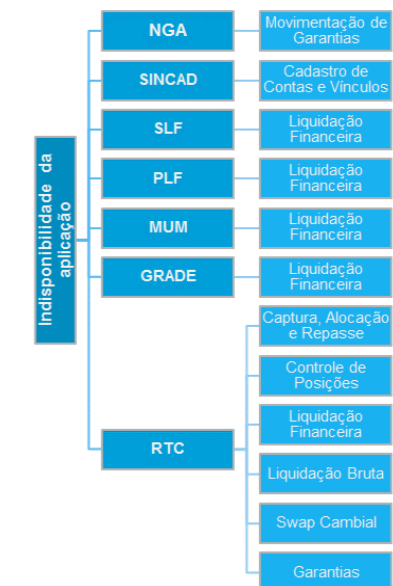
#### 3 Seleção

- 19 cenários selecionados** para avaliação de desenvolvimento ou revisão dos Planos de Continuidade Operacional.

Tema	Característica	Cenários	Impacto	Probabilidade
Alocação	Integridade	Discrpancia entre quantidade de trades realizados e trades capturados	5	1
Alocação	Indisponibilidade	Impossibilidade de alocação e repasse de trades	5	1
Alocação	Indisponibilidade	Indisponibilidade do Sistema de Aluguel de Ativos	5	1
Alocação	Integridade	Não captura por inconsistência de trades realizados (TIS x RTC)	5	2
Alocação	Indisponibilidade	Indisponibilidade do RTC	5	3
Balção	Integridade	Falha na interface entre o sistema Calypso e o SLF	5	1
Balção	Integridade	Falha na interface entre o sistema RIO e SLF	5	1
Cadastro	Integridade	Perda de integridade entre réplicas de cadastro	5	1
Cadastro	Indisponibilidade	Indisponibilidade do Sincad	5	1
Depositária	Indisponibilidade	Indisponibilidade do CAC	5	1
Garantias	Indisponibilidade	Indisponibilidade do NGA	5	1
Liquidação	Integridade	Inconsistência entre débitos e créditos nas instruções de liquidação de ativos	5	1
Liquidação	Indisponibilidade	Indisponibilidade dos Sistemas de Liquidação	5	1
Liquidação	Integridade	Falha na integração da liquidação de ativos com a depositária (RTC x CAC)	5	1
Liquidação	Integridade	inconsistência no netting financeiro da clearing	5	3
Posições	Integridade	Inconsistência na quantidade de posições	5	1
Risco	Indisponibilidade	Indisponibilidade do CORE	5	1
Risco	Indisponibilidade	Indisponibilidade total do GPS	5	1
Risco	Integridade	Falha no processo de geração de cenários	5	1

#### 4 Priorização

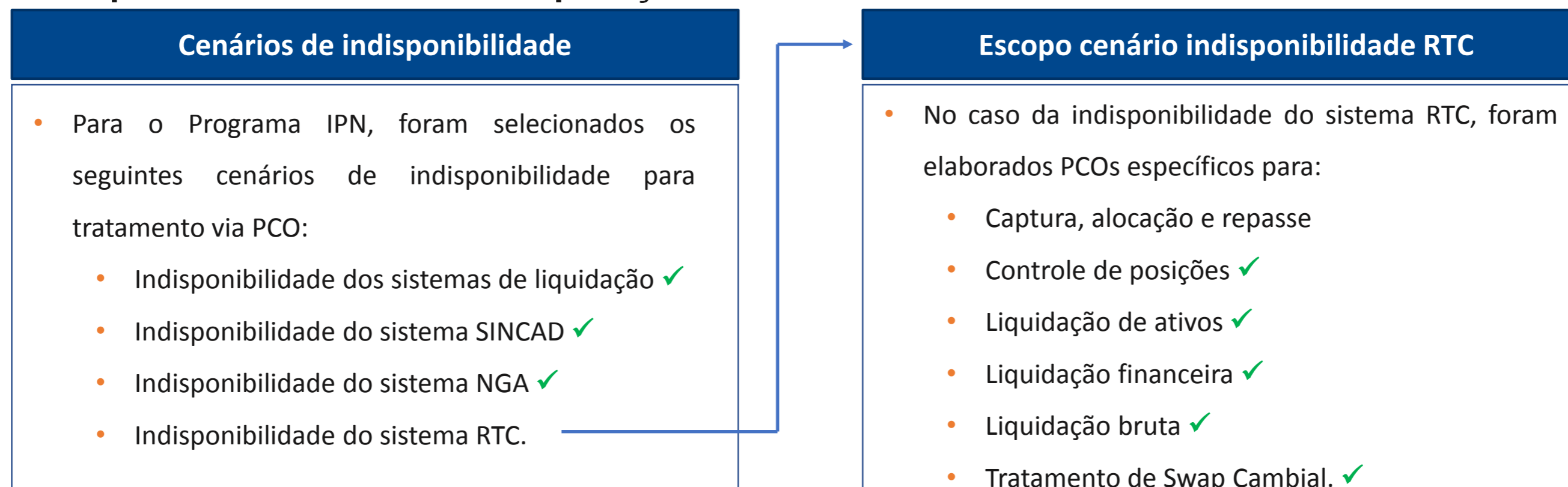
- 12 cenários priorizados** como escopo do IPN V2 para tratamento de situações de Indisponibilidade da aplicação.



## INTRODUÇÃO

### Planos de Continuidade Operacional do Programa IPN

Os PCOs desenvolvidos para o programa IPN contemplam os processos mais críticos para o negócio e buscam minimizar os impactos para os participantes, decorrentes da **indisponibilidade total destas aplicações.**



✓ PCOs desenvolvidos e entregues junto com a segunda fase do Projeto de Integração da Pós-Negociação.

**Este workshop irá focar na apresentação das premissas e regras aplicáveis para o tratamento dos processos de captura, alocação e repasse.**

## CAPÍTULO 2

# PCO CAPTURA, ALOCAÇÃO E REPASSE



## ESCOPO



1. Execução das atividades de alocação e repasse através de uso de sistema alternativo, disponibilizado pela clearing, em caso de indisponibilidade do RTC.
2. Negócios capturados durante o PCO serão priorizados a partir do segmento de negociação. Aqueles não priorizados para alocação serão segregados e bloqueados, e seu processamento será realizado no dia seguinte. Assim, serão tratados por este PCO os processos de alocação de comitentes que devam obrigatoriamente ser realizados no dia.

### Negócios escopo do PCO

- Derivativos financeiros e de commodities
- Renda Fixa D+1
- Opções de ações
- Termo
- Equities D-1 (vista, fracionário, exercício, leilões, ETF secundário)

### Negócios fora do escopo do PCO

- Equities D+0 (vista, fracionário, exercício, leilões, ETF secundário) – Tratados em D+1
- Captura de empréstimos de ativos (BTB) – Tratados após retorno do RTC
- Captura de ETF primário (integralização e resgate) – Tratados após retorno do RTC
- Captura de Distribuições Públicas (DDA) e Swap Cambial serão tratados por PCOs próprios

**O PCO da Captura, Alocação e Repasse não sofreu alterações em relação ao modelo acordado durante a implementação do IPN, reforçando que o Sinacor está adequado as regras e processos estabelecidos.**



## PREMISSAS



1. Indisponibilidade total do sistema RTC.
2. Os demais sistemas da plataforma IPN estão ativos.
3. Manutenção da mensageria ISO:
  - a. bvmf.012 (TradeLegNotification).
  - b. bvmf.013 (SecuritiesAllocationInstruction)
  - c. bvmf.014 ((SecuritiesAllocationInstructionStatusAdvice)
  - d. bvmf.019 (InformGiveUppendingApproval).
4. O processamento EoD do dia anterior foi concluído com sucesso. Todos arquivos necessários foram gerados nesse processamento e disponibilizados aos participantes.
5. O sistema RTC será restaurado antes do processamento EoD do dia da indisponibilidade.

## REGRAS ALOCAÇÃO EM PCO



1. Os negócios capturados e alocados em conta final não serão passíveis de alteração da alocação.
  - a. Não será permitida nenhuma solicitação de exclusão de alocação pelos participantes.
  - b. Não haverá tratamento da mensagem bvmf.015 (SecuritiesAllocationInstructionCancellation). O recebimento de mensagem bvmf.015 de exclusão de alocação será rejeitado pelo SMP e acarretará no não processamento da solicitação e no envio da mensagem TSMT.016 de erro técnico ao participante.
2. Alocações poderão ser realizadas:
  - a. de forma completa, em uma única mensagem de alocação; ou
  - b. de forma incremental, através de mensagens de alocação distintas, até o limite da quantidade remanescente a alocar para o negócio.
3. Contas do tipo Captura, Máster, Admincon, Fintermo, Intermediária e Brokerage serão consideradas “transitórias”.
4. Os negócios que estejam em conta máster somente poderão ser alocados para contas vinculadas a ela.
  - a. Não será permitido realizar alocação da conta máster para contas finais sem vínculo ou contas do tipo transitória.

## REGRAS ALOCAÇÃO EM PCO



6. Grades de alocação serão flexibilizadas durante a execução do plano de continuidade.
7. Não haverá validação da situação da conta, restrições de segmento e titularidade.
8. Negócios poderão ser cancelados via PCO, porém a mensagem bvmf.017 (TradeLegNotificationCancellation) não será enviada.
  - a. Os negócios cancelados serão enviados após o encerramento da alocação.
9. A mensagem bvmf.018 (TradeManagementReportRequest) não será tratada.
  - a. Apenas os arquivos BVBG.013 e BVBG.014 serão disponibilizados após o encerramento da alocação para todos os participantes (PNP, PL e Agentes de Custódia). Não será possível requisitá-los.

## REGRAS DIRECIONAMENTO DE CUSTÓDIA E INDICAÇÃO DE CARTEIRA EM PCO



1. Durante o PCO será possível realizar alocações com direcionamento de custódia e indicação de carteira, que poderão ocorrer das formas usualmente permitidas.
  - a. Uma vez que a alocação esteja em conta final, não será possível realizar a inclusão ou alteração do direcionamento de custódia e indicação de carteira.
2. O direcionamento de custódia será respeitado, na respectiva ordem:
  - a. Informações enviadas via mensageria;
  - b. Vínculo de custódia opcional; e
  - c. Nenhuma informação - mesma conta de posição.
3. Em caso de erro no direcionamento de custódia ou indicação de carteira, a conta de posição e a carteira livre serão atribuídas respectivamente, após o restabelecimento do RTC.

## REGRAS REPASSE EM PCO



1. O PCO adotará como premissa o aceite automático de repasses:
  - a. O aceite tácito ocorrerá por meio de envio pelo sistema alternativo das mensagens de notificação de repasse pendente (bvmf.019) e, logo na sequência, a confirmação do aceite do repasse (bvmf.014) aos participantes envolvidos.
2. Mensagens de rejeição ou cancelamento de repasse (bvmf.016) não serão processadas e retornarão erro técnico ao participante.
3. Não será permitido ao participante destino do repasse incluir direcionamento de custódia para um negócio recebido em conta final, porém se a conta destino de repasse tiver um vínculo de custódia opcional, o direcionamento ocorrerá normalmente.

## FLUXO DE ATIVIDADES

### Cenários

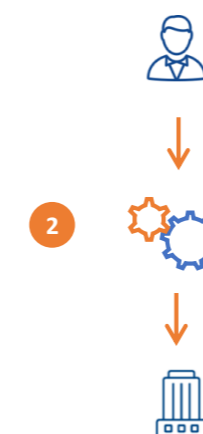
Indisponibilidade do RTC desde o início do dia

Queda do RTC durante o dia

Queda e volta do RTC durante o dia

### Regras gerais

- Participante deve efetuar as alocações via PCO, respeitando as premissas estabelecidas.
- Movimento executado em produção será desconsiderado;
- Participante deve efetuar as alocações via PCO, respeitando as premissas estabelecidas.
- Movimento executado em PCO não será desconsiderado: uma vez estabelecido o acionamento do PCO, não ocorrerá volta pro RTC ao longo do dia.



### Fluxo de atividades em PCO

A B3:

- comunica a indisponibilidade do RTC ao mercado;
- disponibiliza um material de orientações (acionamento do PCO) e contatos para esclarecimento de dúvidas;
- executa procedimentos de setup do PCO.

O participante:

- executa procedimentos de setup para início do PCO;
- efetua as alocações via mensageria, conforme regras estabelecidas para o PCO.

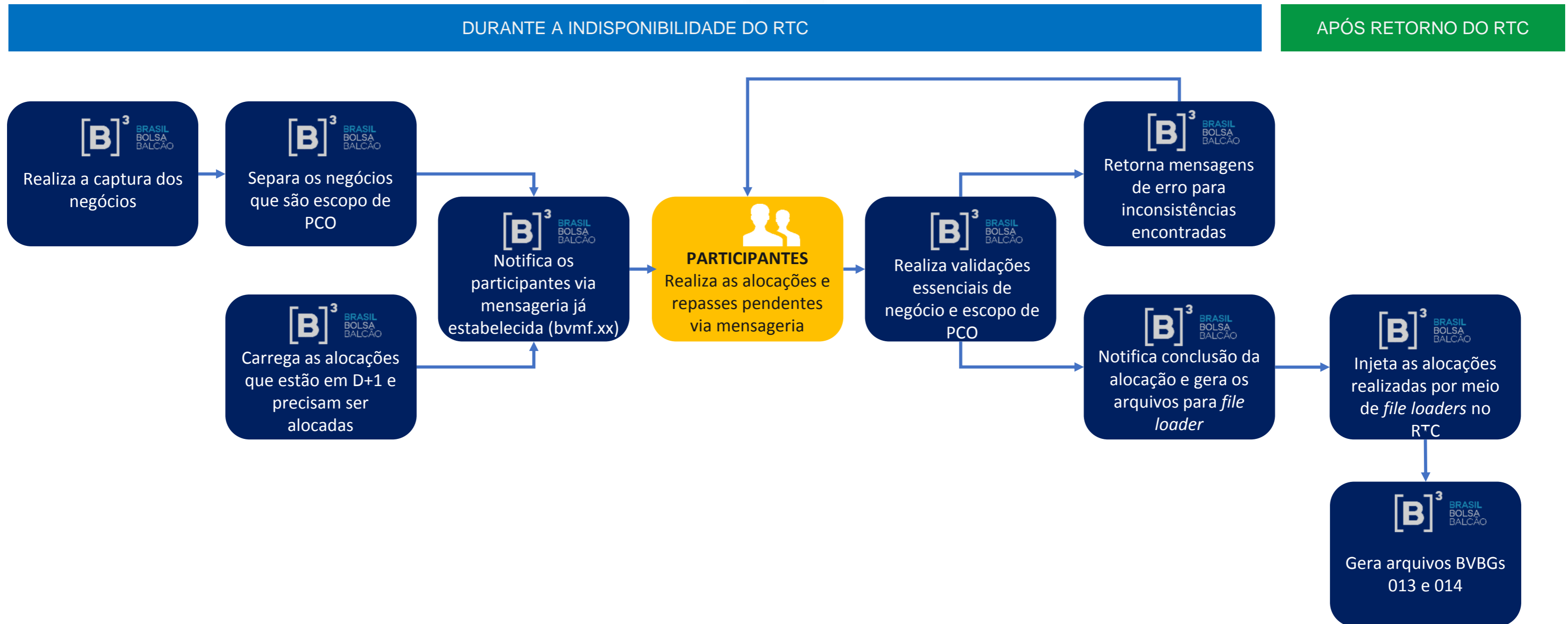
A B3:

- através do sistema alternativo, recebe e envia as mensagens de alocação e repasse para os participantes;
- envia mensagem de erro caso o participante envie mensagens fora do escopo do PCO;
- gera arquivos para carga no RTC após reestabelecimento do mesmo.

A B3:

- comunica o encerramento do PCO;
- após declaração de encerramento do PCO, executa as atividades de restabelecimento do RTC e procedimentos de fim de dia;
- gera os arquivos BVBGs 013 e 014.

## FLUXO DE ATIVIDADES



## CAPÍTULO 3

# PRÓXIMOS PASSOS





## PRÓXIMOS PASSOS

### Testes integrado com mercado



- A. Teste do Plano de Continuidade Operacional para **processos de alocação** será aberto a todos os participantes;
- B. Ambiente a ser utilizado: Certificação da Câmara BM&FBOVESPA;
- C. Período: 15 a 19/out.
- D. Cenário: Indisponibilidade total do RTC, desde a abertura do dia, com o restabelecimento do RTC depois do intradiário;
- E. O roteiro de testes será disponibilizado via Comunicado Externo a ser enviado até 21/set;
- F. Entre os dias 09 e 11/out será executado um teste piloto do PCO aberto a instituições que tenham interesse em participar (entrar em contato através de [cert@b3.com.br](mailto:cert@b3.com.br)).

PROJETOS E INICIATIVAS

2º SEMESTRE 2018

# PROPOSTA DE CERTIFICAÇÃO

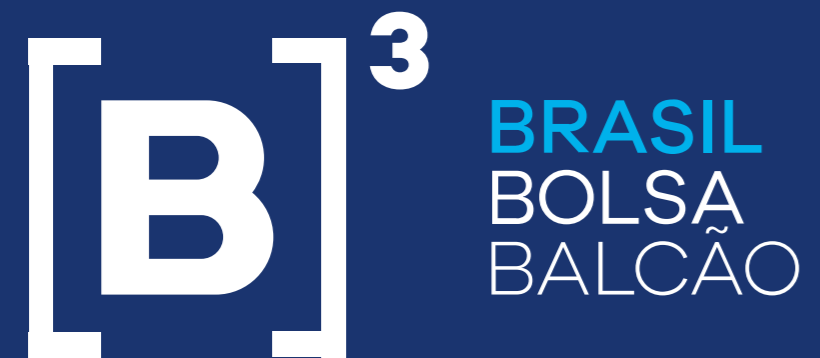


## CRONOGRAMA PROPOSTO



### CERTIFICAÇÃO

- Período de testes das melhorias, correções e dos novos contratos;
- O ambiente de certificação, com as melhorias e correções dos sistemas da pós-negociação, ficará disponível para os participantes mesmo após a entrada em produção.



## CONTATOS

Acesse o site: [www.b3.com.br/clientes](http://www.b3.com.br/clientes)

E-Mail: [transicaoexterna@b3.com.br](mailto:transicaoexterna@b3.com.br)