

# CICLO DE LIQUIDAÇÃO EM D+2 e iMERCADO

WORKSHOP PREPARATÓRIO

ENSAIO DOS DIAS D E L

29 de Janeiro de 2019

*A implantação do Projeto de Ciclo de Liquidação em D+2 depende da aprovação dos órgãos reguladores*

1. Objetivo, Público Alvo e Obrigatoriedade
2. Estratégia de Implantação e Plano de Retorno
3. Ensaios do Dia D e L
4. SINACOR
5. Declaração de Prontidão
6. Perguntas e Respostas

CAPÍTULO 1

# Objetivo do Ensaio, Público Alvo e Obrigatoriedade

# Ensaio dos Dias D e L

## Público-alvo e obrigatoriedade

O ensaio dos dias D e L deverá ser realizado por todos os participantes, com o objetivo de avaliar as modificações decorrentes da alteração do ciclo de liquidação de D+3 para D+2 e validar seus processos internos para a implantação.

Desta forma, deverão efetuar os testes no ensaio:

1. Membros de compensação.
2. Participantes de Negociação Pleno.
3. Participantes de Liquidação.
4. Agentes de Custódia.
5. Gestores, administradores e fundações (no caso de acesso direto, exclusivamente para o iMercado).

# Ciclo de Liquidação em D+2 e iMercado

## Cronograma Geral do Projeto\*

FASE	2018		2019				
	FEVEREIRO A NOVEMBRO	DEZ	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI
<b>ESPECIFICAÇÃO, CONSTRUÇÃO E TESTES</b>	▼ Workshop <b>Modelo de Negócios</b> (17/04) ▼ Workshop <b>Técnico</b> (31/07) ESPECIFICAÇÃO, CONSTRUÇÃO E TESTES						
<b>CERTIFICAÇÃO</b>		▼ Workshop de <b>Certificação</b> (07/11)					
<b>GO LIVE*</b>							iMercado NOVOS FLUXOS ♦ Mai/19 D+2* ♦ 27/05

\*GO LIVE está condicionado à prontidão da B3, prontidão dos participantes e aprovação dos órgãos reguladores

# Ciclo de Liquidação em D+2 e iMercado

## Atendimento aos participantes

Interação		Canal de Atendimento	
<b>CERTIFICAÇÃO</b>	Questões de Certificação relacionadas a sistemas, conectividade, infraestrutura e incidentes.	<b>CTC – Centro de Testes e Certificação</b> (11) 2565-4400 <a href="mailto:cert.D2@b3.com.br">cert.D2@b3.com.br</a>	
<b>TRANSIÇÃO EXTERNA</b>	Equipe dedicada para esclarecimento de dúvidas e auxílio durante todas as fases do Projeto D+2 e iMercado, bem como monitoramento da prontidão dos participantes.	<b>Transição Externa</b> (11) 2565-6056 <a href="mailto:projetoD2@b3.com.br">projetoD2@b3.com.br</a>	
<b>SINACOR</b>	Dúvidas direcionadas a questões específicas do ambiente e sistema SINACOR e também suas interações.	<b>Implantação da versão no ambiente de certificação</b> <b>Formas de agendamento:</b> A. Solicitação pelo MyIT <i>ou</i> B. 11 2565-5000 opção 5 <i>ou</i> C. <a href="mailto:sinacor@b3.com.br">sinacor@b3.com.br</a> .	<b>Atendimento e Suporte SINACOR</b>  (11) 2565-5000 opção 5, grupo 4 <a href="mailto:sinacor@b3.com.br">sinacor@b3.com.br</a>

CAPÍTULO 2

# Estratégia de Implantação e Plano de Retorno

# Ciclo de Liquidação em D+2

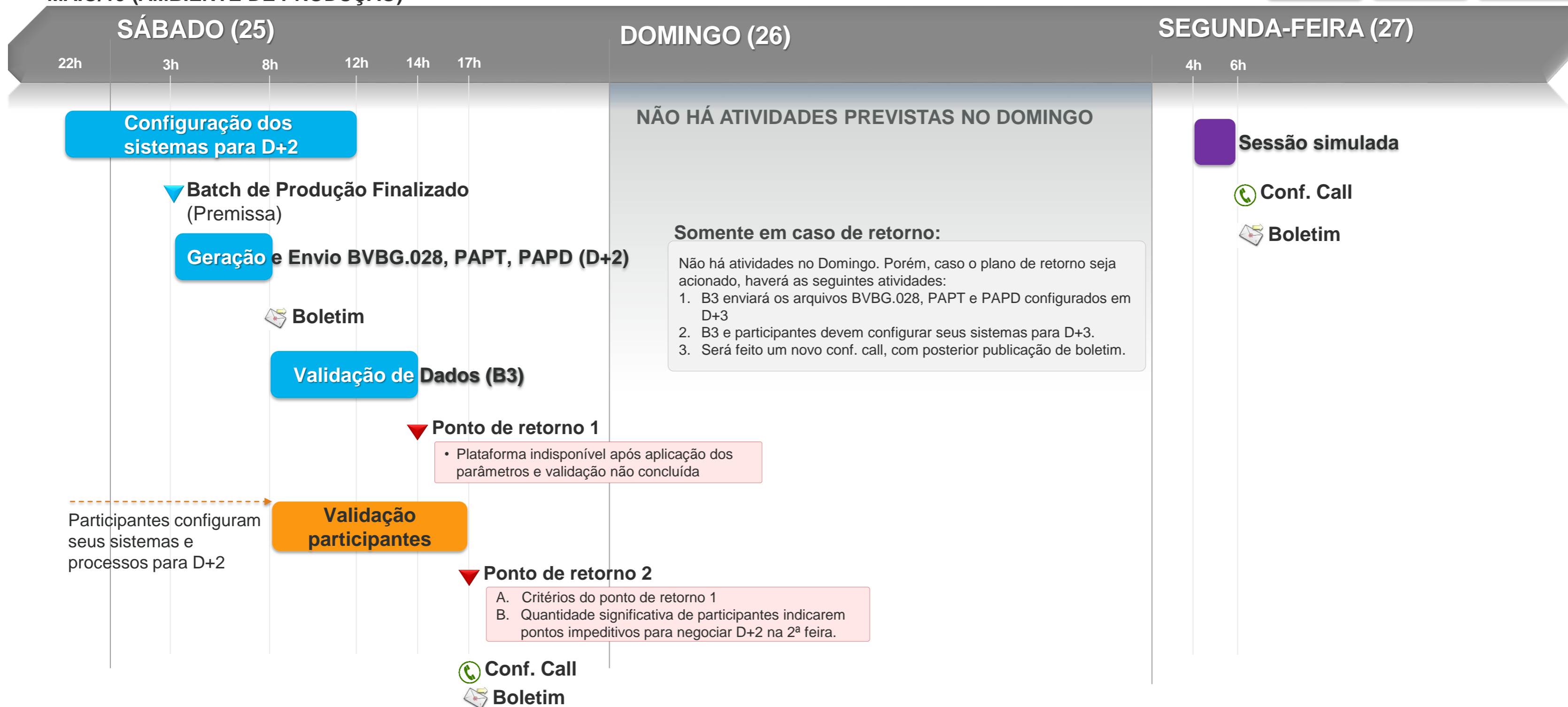
## Estratégia de Implantação e Plano de Retorno

MAIO/19 (AMBIENTE DE PRODUÇÃO)

B3

Participantes

TODOS





# Ciclo de Liquidação em D+2

## Estratégia de Implantação e Plano de Retorno

### Premissas gerais

#### A. Sexta-feira (24/05)

1. Pregão de 6ª feira encerrado normalmente, com o envio dos arquivos e EoD.
2. A configuração dos sistemas B3 para D+2 inicia no mesmo dia, por volta das 22h e finaliza no Sábado, às 12h.

#### B. Sábado (25)

1. Os arquivos BVBG.028, PAPT e PAPD, parametrizados em D+2, são enviados aos participantes até às 8h.
2. Haverá validação interna B3 até às 14h, sendo o ponto de retorno 1.
3. Em paralelo, os participantes devem efetuar seus procedimentos de configuração e validação para D+2.
4. às 17h ocorre conf. call com o mercado (prontidão B3 e participantes), sendo o ponto de retorno 2.

#### C. Domingo (26)

- Não há atividades previstas pela B3.

# Ciclo de Liquidação em D+2

## Estratégia de Implantação e Plano de Retorno

### Premissas gerais (cont.)

#### D. Segunda-feira (27)

1. Antes da abertura do pregão, no Dia D, está prevista a realização de uma sessão simulada (das 4h às 6h), com o objetivo de validar a captura de negócios para liquidação em D+2.
  - A. Serão inseridos negócios de um ativo-teste (LIQU3) na plataforma de negociação em Produção.
  - B. As mensagens de *drop copy* e captura (bvmf.012) serão enviadas aos participantes.
  - C. Os negócios serão cancelados (bvmf.017) antes da abertura do pregão.
  
2. Ao fim da sessão simulada, será dado início à contratação de negócios com liquidação para D+2.

# Ciclo de Liquidação em D+2

## Estratégia de Implantação e Plano de Retorno

### Pontos de Retorno - critérios

#### ➤ **Sábado (25/05)**

##### **A. 14h – Ponto de retorno 1**

- Plataforma indisponível após aplicação dos parâmetros e validação não concluída.

##### **B. 17h – Ponto de retorno 2**

1. Plataforma indisponível após aplicação dos parâmetros e validação não concluída.
2. Quantidade significativa de participantes indicarem pontos impeditivos para negociar D+2 na 2ª feira.

## CAPÍTULO 3

# Ensaio dos Dias D e L

# Ensaio dos Dias D e L

## Pré-requisitos

### Conectividade

#### 1. VPN:

- Os participantes deverão possuir VPN com o ambiente de certificação da BM&FBOVESPA;
- Os endereços para acesso ao ambiente de certificação podem ser encontrados em <http://www.ctc.bvmfnet.com.br/pt-br/download/ServicosNP.pdf>.

#### 2. Acesso as aplicações:

- Para acessar as aplicações do ambiente de certificação da BM&FBOVESPA deverão ser utilizados os usuários cadastrados no CAU.

### Dados de referência

#### 1. Instrumentos:

- Serão definidos instrumentos específicos para os ensaios dos Dias D e L.
- Os instrumentos estarão disponíveis no arquivo BVBG.028, que pode ser recebido via Secure Client.

#### 2. Contas e vínculos:

- Os participantes devem criar as contas e vínculos para os ensaios (podem ser as mesmas já utilizadas para certificação de D+2).
- A criação das contas e vínculos deve ser feita antes do início dos ensaios e informada para o CTC e Sinacor, visando a preparação de massa de dados.

# Dias D e L

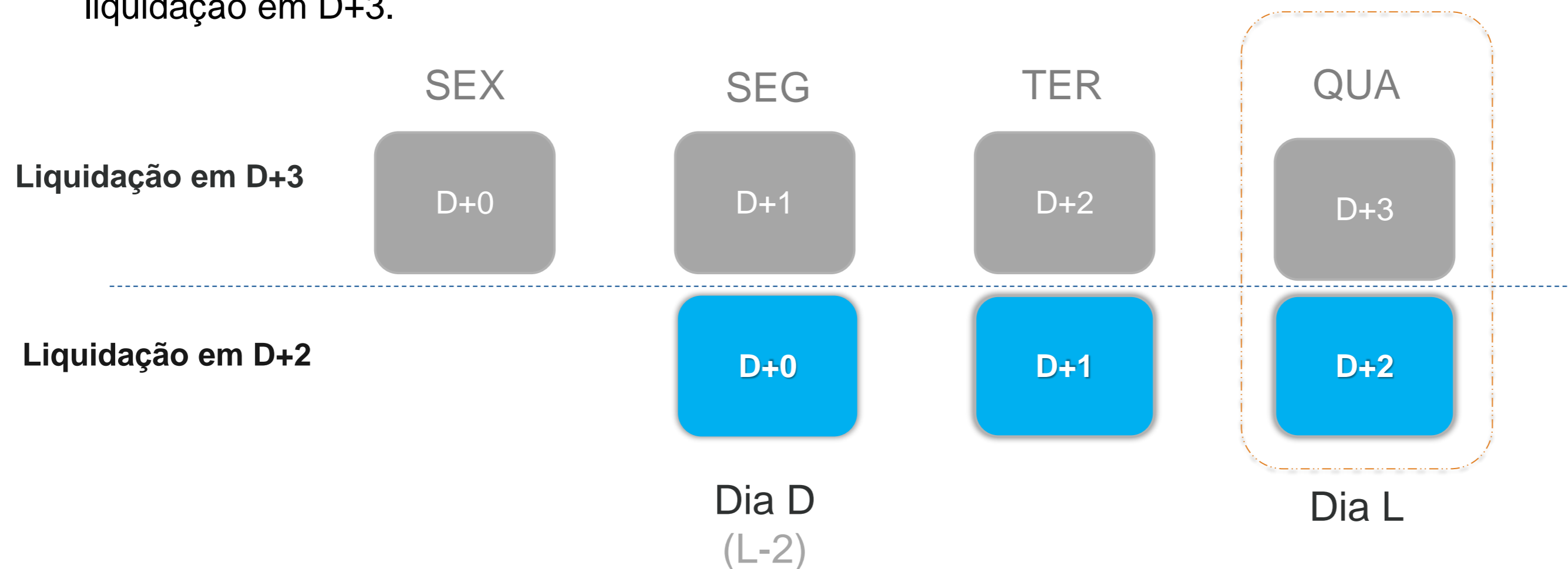
## Terminologia

### Dia D

- Primeiro pregão para contratação de negócios do mercado à vista com liquidação em D+2.

### Dia L

- Liquidação do 1º pregão contratado para liquidação em D+2 e liquidação do último pregão contratado para liquidação em D+3.



# Dias D e L

## Transição para Liquidação no Dia L

Processo	Dia L-3	Dia L-2 (Dia D)	Dia L-1	Dia L	Dia L+1	Dia L+2
<b>Negociação</b>	Negocia para D+3	<b>Negocia para D+2</b>	Negocia para D+2	Negocia para D+2	Negocia para D+2	Negocia para D+2
<b>Alocação D+0</b>	Aloca até 20h30	Aloca até 20h30	Aloca até 20h30	Aloca até 20h30	Aloca até 20h30	Aloca até 20h30
<b>Alocação D+1</b>	Aloca até às 15h	Aloca até 15h	Aloca até às 15h	Aloca até às 15h	Aloca até às 15h	Aloca até às 15h
<b>Autorização de custódia</b>	Autoriza em D2	Autoriza em D2	<b>Autoriza em D2</b> (Negócios de L-3) <b>Autoriza até D1</b> (Negócios de L-2)	Autoriza até D1	Autoriza até D1	Autoriza até D1
<b>Composição da janela de liquidação</b>	Falhas de D4 Liquidação D3	Falhas de D4 Liquidação D3	Falhas de D4 Liquidação D3	<b>Falhas de D4 (L-4)</b> <b>Liquidação D3 (L-3)</b> <b>Liquidação D2 (L-2)</b>	Falhas de D4 (L-3) Falhas de D3 (L-2) Liquidação D2 (L-1)	Falhas de D3 (L-1) Liquidação D2 (L)
<b>Emissão Recompra</b>	Emite p/ falhas D4	Emite p/ falhas D4	Emite p/ falhas D4	<b>Emite p/ falhas D4</b> (L-4)	Emite p/ falhas D4 (L-3) Emite p/ falhas D3 (L-2)	Emite p/ falhas D3 (L-1)

# Ensaio dos Dias D e L

## Processo de Liquidação no Dia L

1. Os processos de alocação e autorização de direcionamento de custódia para os pregões L-3 e L-2 serão mantidos segregados.
2. No Dia L, ocorrerá a liquidação dos dois pregões (L-3 e L-2) em uma única janela de entrega de ativos.
3. As instruções de liquidação de ativos dos dois pregões compõem as instruções a liquidar no Dia L de forma segregada. Caso haja instruções de naturezas opostas dos pregões L-3 e L-2, a câmara considerará as instruções como liquidadas na quantidade compatível.



# Ensaio dos Dias D e L

## Processo de Liquidação no Dia L (cont.)

4. A liquidação financeira no Dia L será compensada.
5. As falhas de L-3 (última negociação em D+3) e L-2 (1º dia de negociação em D+2) gerarão instruções a liquidar no dia seguinte (L+1).
6. As recompras abertas com data de negociação anterior a L-2 (1º dia de negociação em D+2), permanecem com os prazos de recompra atuais. As recompras com data de negociação a partir de L-2 (inclusive), respeitarão os novos prazos de recompra.

# Roteiro para os Ensaios do Dia L

## Dinâmica



# Ensaio dos Dias D e L

## Premissas / pontos importantes para verificação

### **Dia L-4 (quinta-feira)**

- Os sistemas retornarão para D+3 no início de todos os ensaios (quinta-feira), com a limpeza dos dados do ambiente de certificação.

### **Dia L-3 (sexta-feira)**

1. Na sexta-feira que antecede o Dia D, ocorrerá a última negociação das operações contratadas para liquidação em D+3.
2. O processamento batch e a geração e disponibilização dos arquivos ocorrerão normalmente.
3. Após o fim do processamento noturno de sexta-feira, a Câmara iniciará seus procedimentos internos de mudança para o D+2.

# Ensaio dos Dias D e L

## Premissas / pontos importantes para verificação (cont.)

### Sábado anterior ao Dia D

1. Os sistemas dos participantes deverão ser “chaveados” para a mudança do ciclo de liquidação para D+2
2. O arquivo BVBG.028, da abertura de segunda-feira, estará disponível até às 08h do sábado, na ferramenta Secure Client, com os instrumentos do mercado à vista já atualizados para liquidação em D+2.
3. Os participantes deverão realizar as validações dos seus processos internos para a implantação.
4. Haverá suporte dos times do CTC e Sinacor das 08 às 12h.

### Comunicação durante o sábado

1. A B3 comunicará os participantes o status das atividades do ensaio. Serão emitidos boletins em 2 horários:
  - A. Boletim inicial às 08h
  - B. Boletim final das atividades de acompanhamento às 12h.
2. A Transição Externa fará o acompanhamento da prontidão para o Dia D, via recebimento de *checklist*.

# Ensaio dos Dias D e L

## Premissas / pontos importantes para verificação (cont.)

### **Dia D ou L-2 (segunda-feira)**

- Início da contratação de negócios com liquidação para D+2.

### **Dia L-1 (terça-feira)**

1. A partir de terça-feira, após o encerramento do processo de alocação em D+1, a câmara disponibilizará os arquivos intradiários BVBG.019, BVBG.013 (custodiantes) e IMBARQ005.
2. Na terça-feira, os custodiantes devem realizar a autorização de movimentação de custódia das operações contratadas para liquidação em D+3 (prazo atual) e das operações contratadas para D+2 (novo prazo).

# Ensaio dos Dias D e L

## Premissas / pontos importantes para verificação (cont.)

### Dia L (quarta-feira)

1. No Dia L (quarta-feira) ocorrerá a liquidação dos dois pregões (L-3 e L-2).
2. A janela para entrega dos ativos (atual SPB10) iniciará às 11h a partir deste dia.
3. A Transição Externa fará o acompanhamento do resultado do ensaio do Dia L, via recebimento de *checklist*
4. Os testes continuarão em D+2 até o início do próximo ensaio.

# Ensaio dos Dias D e L

## Datas Importantes\*

### 1º Ensaio do Dia D e L: 08/02 a 20/02/19

Atenção: Em 07/02 os participantes devem configurar seus sistemas para D+3 (pré-requisito para início do ensaio em 08/02)

### 2º Ensaio do Dia D e L: 12/04 a 18/04/19

FASE	2019			
	FEV	MAR	ABR	MAI
CERTIFICAÇÃO	Dias D e L		Dias D e L	
	D+2 07/02 1º ENSAIO 08/02 - 20/02 25/02	D+3	11/04 2º ENS. 12/04 - 18/04 22/04	D+2 17/05
GO LIVE*			iMercado NOVOS FLUXOS ◆ Mai/19	D+2* ◆ 27/05

Configuração dos sistemas de D+2 para D+3

**Homologação do Banco Central:** data a ser oficializada com o regulador.

\*GO LIVE está condicionado à prontidão da B3, prontidão dos participantes e aprovação dos órgãos reguladores

## CAPÍTULO 4

# SINACOR



# SINACOR

## Premissas e pontos importantes

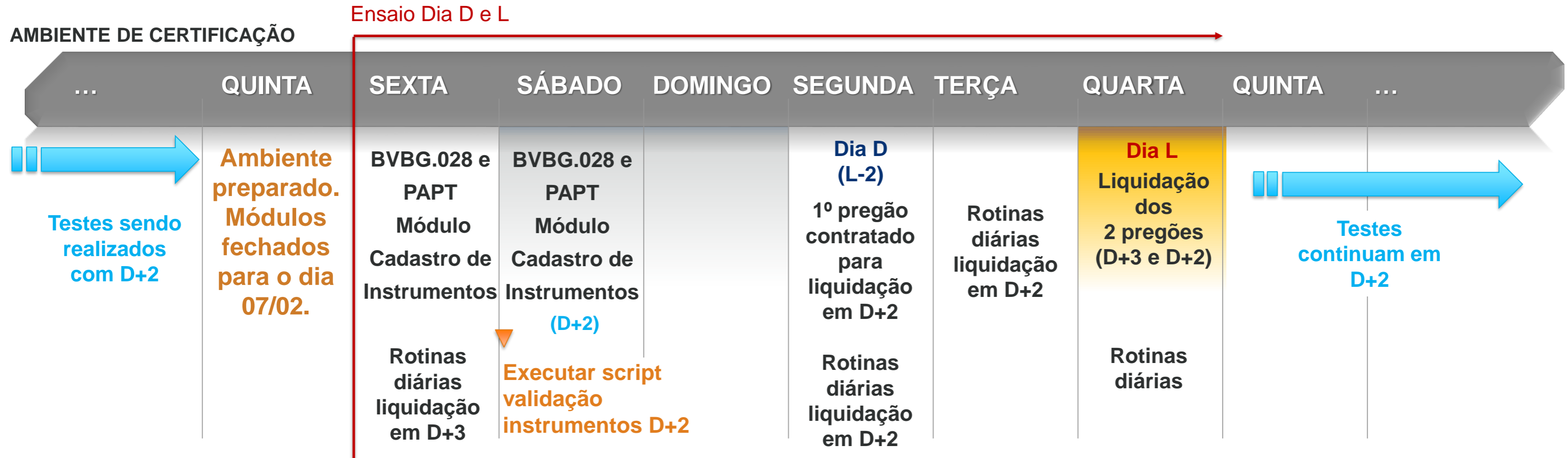
### Pré-requisitos

1. Instalação da **versão V19.1.0** do SINACOR.
  - Executar toda orientação do COOKBOOK.
2. Preparação da massa de testes.
  - A. Contas (Manual, via arquivos BVBG002, BVBG102).
  - B. Vínculos (Manual, via arquivos BVBG005).

### Ensaio

- Disponibilizaremos um guia para auxiliar os usuários no ensaio dos dias D e L.
- Disponibilizaremos um script (banco de dados), para ajudar na verificação da preparação do ambiente SINACOR, para o pregão em D+3 e D+2.

# SINACOR - Roteiro para os Ensaios dos Dias D e L



1. No Módulo de Tesouraria, informar a data do **Dia L (13/02/19)**, na tela de parâmetros.
2. Na sexta-feira dia **08/02/19**, as importações do bvbG.028 (D+3) e PAPT, deverão ocorrer antes do recebimento das operações. Disponibilizaremos um script para confirmação dos instrumentos em D+3 ou D+2.
3. No sábado dia **09/02/19**, as importações do bvbG.028 (D+2) e PAPT, deverão ocorrer normalmente.
4. Dia D (1º pregão contratado para liquidação em D+2) ocorrerá na segunda-feira dia **11/02/19**.
5. O Dia L (liquidação dos 2 pregões, D+2 e D+3) ocorrerá na quarta-feira dia **13/02/19**.

## CAPÍTULO 5

# Declaração de Prontidão

# Ciclo de Liquidação em D+2 e iMercado

## Declaração de Prontidão

O acompanhamento da evolução dos testes, bem como a prontidão dos participantes serão realizados pela equipe da Transição Externa.

Haverá uma prontidão específica para o ensaio. Será realizada em dois momentos (exemplo para o 1º ensaio):

1. Prontidão cobrindo os principais pontos de controle, a ser informado pelos participantes durante o ensaio, simulando a implantação para o Dia D. **Prazo para declaração:** *Ocorrerá no dia 09/02 (sábado) até às 12 horas.*

**IMPORTANTE:** Informar até quinta, 06/02, às 18 horas, o ponto focal que atuará no dia 09/02 (e-mail e telefones para contato) para [projetoD2@b3.com.br](mailto:projetoD2@b3.com.br)

2. Prontidão cobrindo os principais pontos de controle, a ser informado pelos participantes após o Dia L. **Prazo para declaração:** *Ocorrerá no dia 13/02 (quarta) até às 18 horas.*

O template da prontidão será enviado pela Transição Externa e disponibilizado no site do projeto: [www.b3.com.br/clientes](http://www.b3.com.br/clientes) > Projeto D+2.

## CAPÍTULO 6

# Perguntas e Respostas

Obrigado.



Caso tenha alguma dúvida,  
entre em contato:

[projetoD2@b3.com.br](mailto:projetoD2@b3.com.br)