

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

Atendimento aos participantes

Interação		Canal de Atendimento	
CERTIFICAÇÃO	Questões de Certificação relacionadas a sistemas, conectividade, infraestrutura e incidentes.	CTC – Centro de Testes e Certificação (11) 2565-4400 cert.D2@b3.com.br	
TRANSIÇÃO EXTERNA	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.	Transição Externa (11) 2565-6056 projetoD2@b3.com.br	
SINACOR	Dúvidas direcionadas a questões específicas do ambiente e sistema SINACOR e também suas interações.	Implantação da versão no ambiente de certificação Formas de agendamento: A. Solicitação pelo MyIT <i>ou</i> B. 11 2565-5000 opção 5 <i>ou</i> C. sinacor@b3.com.br .	Atendimento e Suporte SINACOR (11) 2565-5000 opção 5, grupo 4 sinacor@b3.com.br

CAPÍTULO 2

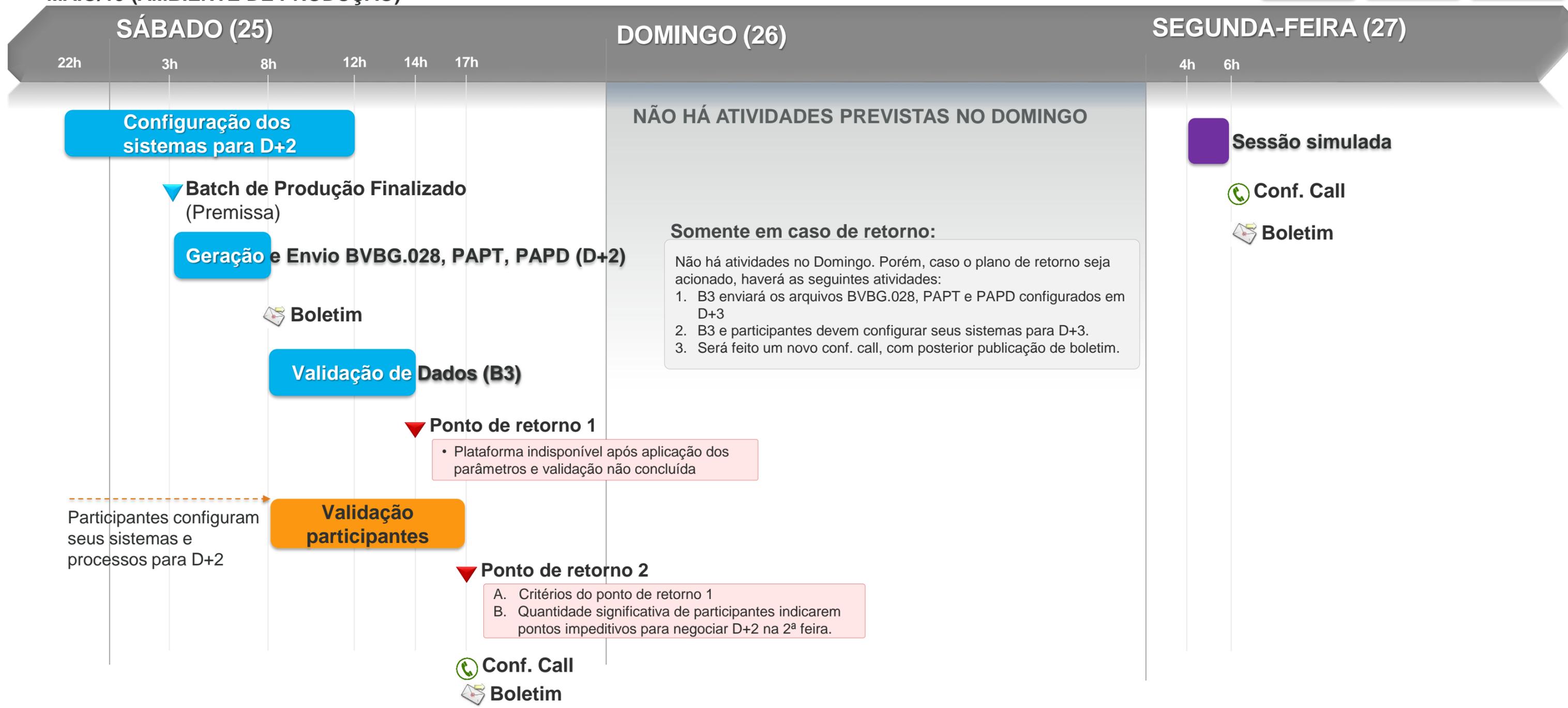
Estratégia de Implantação e Plano de Retorno

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

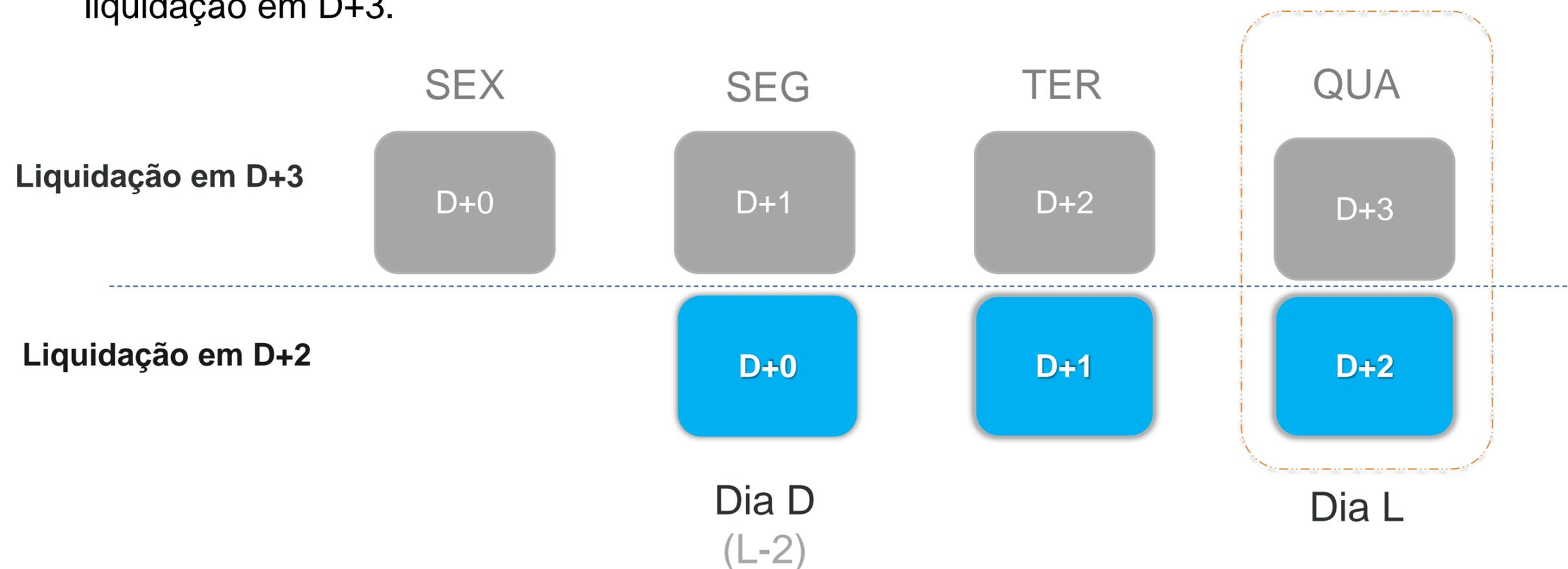
Terminologia

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

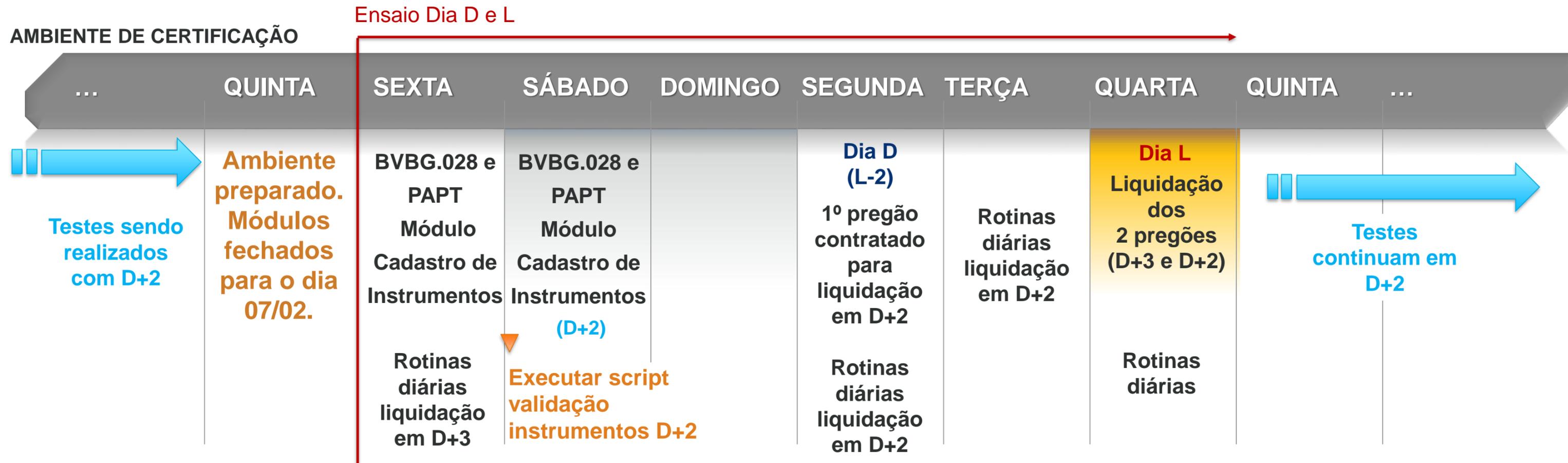
1. Instalação da **versão V19.1.0** do SINACOR.
 - Executar toda orientação do COOKBOOK.

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

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 > Projeto D+2.

CAPÍTULO 6

Perguntas e Respostas

Obrigado.



Caso tenha alguma dúvida,
entre em contato:

projetoD2@b3.com.br