

25 de setembro de 2018  
089/2018-VOP

## COMUNICADO EXTERNO

Participantes dos Mercados da B3 – Segmento BM&FBOVESPA

Ref.: **Teste do Plano de Continuidade Operacional de Captura, Alocação e Repasse.**

Informamos que, **de 16/10/2018 (terça-feira) a 18/10/2018 (quinta-feira)**, será realizado teste do Plano de Continuidade Operacional de Captura, Alocação e Repasse (PCO-Alocação) em ambiente de certificação da Câmara BM&FBOVESPA.

Desenvolvido para minimizar os impactos decorrentes da indisponibilidade do sistema RTC da plataforma de pós-negociação da Câmara BM&FBOVESPA, o PCO-Alocação utiliza sistema alternativo para viabilizar a captura dos negócios e o envio da mensagem informativa de captura (bvmf.012) aos participantes, além do processo de alocação e repasse. Tanto o processo de alocação como o de repasse têm, nessa situação, funcionalidades reduzidas, de forma a viabilizar o mínimo necessário para o fechamento e a abertura do dia seguinte.

### 1. Escopo dos testes em ambiente de certificação

O teste abrangerá:

- captura de operações e envio da mensagem informativa de captura (bvmf.012) aos participantes;
- inclusão de alocação via bvmf.013, com objetivo de identificar o comitente final em caso de negócios que estão alocados em contas transitórias;
- repasse de operações, sendo estes aceitos automaticamente pelo sistema PCO; e
- interação com a B3 para que atue como contraparte ou facilite a execução de cenário específico desejado pelo participante.

Os itens abaixo não fazem parte do escopo do PCO-Alocação, portanto o teste **não** abrangerá:

- processo de exclusão de alocação via mensagem bvmf.015;
- processo de aprovação ou reprovação de repasse via mensagem bvmf.016;
- solicitação de arquivos de conciliação;
- consulta das alocações em tela;
- realocação de negócios já alocados em contas finais.

## 2. Cronograma

### 16/10/2018

- Inclusão da massa de operações de D-1. A B3 realizará a inserção de massa de operações específica no RTC de certificação que servirá como preparação para o teste do PCO-Alocação. Essa massa específica de operações não conterá informações reais de produção.

### 17/10/2018

- Indisponibilidade do RTC desde o início do dia.
- A B3 fornecerá a massa de operações no ambiente de certificação. Essa massa não conterá informações reais de produção, mas será suficiente para execução de todos os cenários sugeridos no documento.

Horário inicial	Horário final	Descrição
9h	9h15	Declaração do acionamento do PCO.
10h	15h	Período de captura de operações e processos de alocação e repasse no PCO.
15h	17h	Processamento das alocações pela B3 para retorno ao sistema RTC.
17h	18h	Envio dos arquivos BVBG.013 e BVBG.014 para conciliação dos participantes.

- As operações estão divididas em quatro blocos: I, II, III e IV, conforme o horário em que serão inseridas.
  - Bloco I: 9h15 (antes da entrada no PCO)
  - Bloco II: 11h15
  - Bloco III: 12h15
  - Bloco IV: 13h15
 Os blocos II, III e IV contêm as mesmas operações do bloco I, com números de negócio diferentes, além de operações específicas para cancelamento de algumas operações do bloco I e assim por diante.

### 18/10/2018

- Abertura regular do ambiente de certificação da Câmara BM&FBOVESPA.

## 3. Informações adicionais

De **01/10/2018 a 19/10/2018**, o ambiente de certificação da Câmara BM&FBOVESPA será utilizado exclusivamente para realização dos testes internos e com o mercado relacionados ao PCO-Alocação.

As atividades a serem executadas durante o teste, além da massa de instrumentos e contas, encontram-se no roteiro obrigatório, anexo a este Comunicado Externo.

A participação no teste deverá ser confirmada até as **12h de 05/10/2018 (sexta-feira)**, pelo e-mail [cert@b3.com.br](mailto:cert@b3.com.br), com o assunto “Teste PCO-Alocação”, contendo a identificação da instituição, a lista de nomes das pessoas que participarão e os respectivos telefones, bem como os e-mails para contato.

Esclarecimentos adicionais sobre o ambiente de testes poderão ser obtidos pelo e-mail [cert@b3.com.br](mailto:cert@b3.com.br) ou pelo telefone (11) 2565-4400.

Esclarecimentos adicionais sobre o Sinacor poderão ser obtidos pelo e-mail [sinacor@bvmf.com.br](mailto:sinacor@bvmf.com.br) ou pelo telefone (11) 2565-5000, opção 5.

Cícero Augusto Vieira Neto  
Vice-Presidente de Operações, Clearing e Depositária

## Anexo do Comunicado Externo 089/2018-VOP

### Roteiro de Validação do PCO-Alocação

#### Cenários a serem executados durante o teste de validação do PCO-Alocação

Captura de operações				
Cenário	Descrição	Resultado esperado	PNP	PL
1	Captura de operação realizada em conta normal sem vínculo de repasse.	<b>Mensagem:</b> participante recebe bvmf.012.02 com informação da operação realizada em conta normal.	Sim	N/A
2	Consulta de operação realizada sem que a conta seja informada no ambiente de negociação.	<b>Mensagem:</b> participante recebe bvmf.012.02 com informação da operação realizada em conta captura.	Sim	N/A
3	Captura de operação realizada em conta máster sem vínculo de repasse.	<b>Mensagem:</b> participante recebe bvmf.012.02 com informação da operação realizada em conta máster.	Sim	N/A
4	Captura de operação realizada em conta normal com vínculo de repasse (origem) com outra conta normal (destino) sob um PL.	<b>Mensagem:</b> participante-origem recebe bvmf.012.02 e participante-destino recebe bvmf.019.02. Repasse é aceito automaticamente, gerando uma bvmf.014 para ambos os participantes.	Sim	Sim
5	Captura de operação realizada em conta normal com vínculo de repasse (origem) para conta máster (destino) sob um PL.	<b>Mensagem:</b> participante-origem recebe bvmf.012.02 e participante-destino recebe bvmf.019.02. Repasse é aceito automaticamente, gerando uma bvmf.014 para ambos os participantes.	Sim	Sim

Inclusão de alocação				
Cenário	Descrição	Resultado esperado	PNP	PL
6	Inclusão de alocação total.  <b>De:</b> conta captura <b>Para:</b> conta normal e conta normal com direcionamento de custódia de mesma titularidade  <b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação.	<b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status das alocações aceitas.	Sim	N/A

Inclusão de alocação				
Cenário	Descrição	Resultado esperado	PNP	PL
7	<p>Inclusão de alocação parcial.</p> <p><b>De:</b> conta máster <b>Para:</b> conta filhote</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação parcial.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status da alocação aceita.</p>	Sim	N/A
8	<p>Inclusão de alocação total.</p> <p><b>De:</b> conta admincon <b>Para:</b> conta intermediária e conta erro</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status da alocação aceita.</p>	Sim	N/A
9	<p>Inclusão de alocação total após recebimento de repasse em conta máster.</p> <p><b>De:</b> conta máster <b>Para:</b> duas contas filhotes da máster</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status das alocações aceitas.</p>	Sim	Sim
10	<p>Inclusão de alocação com dados de indicação de carteira.</p> <p><b>De:</b> conta captura <b>Para:</b> conta normal – indicação de carteira (2105-9)</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status da alocação aceita.</p>	Sim	N/A
11	<p>Inclusão de alocação de negócio de D-1.</p> <p><b>De:</b> conta captura <b>Para:</b> conta normal não residente</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status da alocação aceita.</p>	Sim	N/A

Repasse de operações				
Cenário	Descrição	Resultado esperado	PNP	PL
12	<p>Inclusão de alocação para conta com vínculo de repasse.</p> <p><b>De:</b> conta captura <b>Para:</b> conta normal com vínculo de repasse para conta normal <b>sob</b> um PL</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de alocação para conta normal com vínculo de repasse para conta normal.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante-origem recebe em resposta mensagem bvmf.014.02 com status de repasse pendente de aprovação e, logo em seguida, outra bvmf.014.02 com status repasse aprovado.</p> <p>Participante-destino recebe uma mensagem bvmf.019 com status de repasse pendente de aprovação e, logo em seguida, bvmf.014.02 com status repasse aprovado.</p> <p><b>No PCO, a aprovação dos repasses é automática.</b></p>	Sim	Sim
13	<p>Inclusão de alocação para conta com vínculo de repasse.</p> <p><b>De:</b> conta máster <b>Para:</b> conta filhote com vínculo de repasse para conta normal <b>sob</b> um PL</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia mensagem bvmf.013.01 com solicitação de alocação para conta filhote com vínculo de repasse para conta normal.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante-origem recebe em resposta mensagem bvmf.014.02 com status de repasse pendente de aprovação e, logo em seguida, outra bvmf.014.02 com status repasse aprovado.</p> <p>Participante-destino recebe uma mensagem bvmf.019 com status de repasse pendente de aprovação e, logo em seguida, bvmf.014.02 com status repasse aprovado.</p> <p><b>No PCO, a aprovação dos repasses é automática.</b></p>	Sim	Sim
14	<p>Inclusão de alocação para conta com vínculo de repasse.</p> <p><b>De:</b> conta captura <b>Para:</b> conta normal com vínculo de repasse para conta máster <b>sob</b> um PL</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia mensagem bvmf.013.01 com solicitação de alocação para conta filhote com vínculo de repasse para conta normal.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante-origem recebe em resposta mensagem bvmf.014.02 com status de repasse pendente de aprovação e, logo em seguida, outra bvmf.014.02 com status repasse aprovado.</p> <p>Participante-destino recebe uma mensagem bvmf.019 com status de repasse pendente de aprovação e, logo em seguida, bvmf.014.02 com status repasse aprovado.</p> <p><b>No PCO, a aprovação dos repasses é automática.</b></p>	Sim	Sim

Repasse de operações				
Cenário	Descrição	Resultado esperado	PNP	PL
15	<p>Inclusão de alocação <b>parcial</b> para conta com vínculo de repasse.</p> <p><b>De:</b> conta captura <b>Para:</b> conta normal com vínculo de repasse para conta normal <b>sob</b> um PNP</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia mensagem bvmf.013.01 com solicitação de alocação para conta Normal com vínculo de repasse para conta normal.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante-origem recebe em resposta mensagem bvmf.014.02 com status de repasse pendente de aprovação e, logo em seguida, outra bvmf.014.02 com status repasse aprovado.</p> <p>Participante-destino recebe uma mensagem bvmf.019 com status de repasse pendente de aprovação e, logo em seguida, bvmf.014.02 com status repasse aprovado.</p> <p><b>No PCO, a aprovação dos repasses é automática.</b></p>	Sim	N/A

Cancelamento de negócio				
Cenário	Descrição	Resultado esperado	PNP	PL
16	<p>Cancelamento de operação realizada em conta normal com vínculo de repasse (origem) com outra conta normal (destino) <b>sob</b> um PL.</p>	<p>Não haverá mensagem de cancelamento (bvmf.017) no PCO.</p> <p>Participante receberá arquivo com negócios cancelados durante a volta para o RTC.</p>	Sim	Sim

Arquivos – Restabelecimento RTC				
Cenário	Descrição	Resultado esperado	PNP	PL
17	<p>Participante recebe os arquivos:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>BVBG.013 (SecuritiesAllocationDetails)</li> <li>BVBG.014 (GiveUpTradeDetails).</li> </ul> <p><b>Observação:</b> PLs receberão apenas o arquivo BVBG.013.</p>	<p>Arquivos serão enviados automaticamente após a carga dos negócios no PCO para o RTC.</p>	Sim	Sim



Cenários negativos				
Cenário	Descrição	Resultado esperado	PNP	PL
18	<p>Consulta de operação realizada em conta inválida, ou seja, conta não existente no sistema de cadastro da B3.</p> <p><b>Observação:</b> neste caso, a operação será capturada na conta informada no sistema PCO e será movida para a conta erro no retorno do sistema RTC.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe bvmf.012.02 com informação da operação realizada.</p>	Sim	N/A
19	<p>Consulta de operação realizada em conta inativa no sistema de cadastro da B3.</p> <p><b>Observação:</b> neste caso, a operação será capturada na conta informada no sistema PCO e será movida para a conta erro no retorno do sistema RTC.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe bvmf.012.02 com informação da operação realizada.</p>	Sim	N/A
20	<p>Inclusão de alocação com dados de indicação de carteira.</p> <p><b>De:</b> conta captura <b>Para:</b> conta normal - indicação de carteira (2100-0)</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação.</p> <p><b>Observação:</b> neste caso, a operação será indicada na carteira informada no sistema PCO e será movida para a carteira livre no retorno do sistema RTC.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status da alocação aceita.</p>	Sim	N/A
21	<p>Inclusão de alocação.</p> <p><b>De:</b> conta máster <b>Para:</b> conta normal sem vínculo com conta máster</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação.</p> <p><b>Observação:</b> neste caso, a operação não será alocada na conta normal.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status da alocação com erro.</p>	Sim	Sim



Cenários negativos				
Cenário	Descrição	Resultado esperado	PNP	PL
22	<p>Inclusão de alocação.</p> <p><b>De:</b> conta erro <b>Para:</b> conta normal</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação.</p> <p><b>Observação:</b> neste caso, a operação não será alocada na conta normal, pois a conta erro é considerada final no sistema PCO.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status da alocação com erro.</p>	Sim	Sim
23	<p>Inclusão de alocação com direcionamento de custódia de diferente titularidade.</p> <p><b>De:</b> conta captura <b>Para:</b> conta normal - direcionando para conta de diferente titularidade</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação.</p> <p><b>Observação:</b> neste caso, a operação será indicada na conta de custódia informada no sistema PCO e será movida para a conta de posição do participante no retorno do sistema RTC.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status da alocação aceita.</p>	Sim	N/A
24	<p>Exclusão de alocação.</p> <p><b>De:</b> conta normal <b>Para:</b> conta erro</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.015 com solicitação de exclusão de alocação.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe erro tsmt, pois essa mensagem não é permitida em ambiente PCO.</p>	Sim	N/A
25	<p>Rejeição de repasse.</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.016 com solicitação de rejeição de repasse.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe erro tsmt, pois essa mensagem não é permitida em ambiente PCO.</p>	Sim	Sim

089/2018-VOP

Cenários negativos				
Cenário	Descrição	Resultado esperado	PNP	PL
26	<p>Inclusão de alocação – ações a vista D0.</p> <p><b>De:</b> conta captura <b>Para:</b> conta normal</p> <p><b>Mensagem:</b> participante envia bvmf.013.01 com solicitação de inclusão de alocação.</p> <p><b>Observação:</b> neste caso, a operação não será alocada na conta normal, pois o segmento de ações a vista em D0 está fora do escopo do PCO.</p>	<p><b>Mensagem:</b> participante recebe em resposta a mensagem bvmf.014.02 com status da alocação com erro.</p>	Sim	N/A

### Instrumentos disponíveis para os testes do PCO

Id do ativo	Código de negociação	Segmento
100000099657	B3SA3	Ações a vista
100000099907	B3SA3F	Ações a vista
200000153650	PETR4	Ações a vista
100000096380	DOLZ18	Derivativos financeiros
200000154021	DR1G19H19	Derivativos financeiros
100000066270	VTCJ19C005150	Derivativos financeiros
100000097945	ICFZ18C015000	Derivativos de commodities
200000147607	PETRA157	Derivativos de ações
100000099783	B3SA3T	Termo
100000102902	AGRU-DEB21L1	Renda fixa

Os participantes devem utilizar as contas e vínculos cadastrados no sistema Sincad no ambiente de certificação. Caso necessário, a B3, por meio do participante interno 935, poderá atuar como contraparte origem ou destino de repasse. Abaixo, segue um guia com os tipos de contas e vínculos necessários para cumprimento de todos os cenários de testes propostos.

<b>Tipo de conta</b>	<b>Conta máster</b>	<b>Conta contraparte do vínculo de repasse</b>	<b>Cenários aplicados</b>
Normal A	–	–	1/2/10/20/21/22/24/26
Normal B	–	Normal C	4/12/15/16
Normal D	–	Máster B	5/14
Normal E	–	–	2/6/23
Normal não residente	–	–	11
Máster A	–	–	3/7/9/13/21
Filhote A	Máster A	–	7/9
Filhote B	Máster A	–	9
Filhote C	Máster A	Normal F	13
Captura	–	–	2/6/10/11/12/14/15/20/23/26
Admincon	–	–	8
Intermediária	–	–	8
Erro	–	–	8/22/24