

CONTA DE INTERMEDIÇÃO

Roteiro de Certificação

SUMÁRIO

CONTATOS	3
HISTÓRICO DE REVISÃO	4
1 INTRODUÇÃO	5
2 PRÉ-REQUISITOS	5
3 CENÁRIOS	6
3.1 Alocação	6
3.2 Posições	7
3.3 Risco	11

CONTATOS

Atendimento Certificação

- liquidacao.certifica@b3.com.br
- +55 (11) 2565-5000 Opção 1 – 7 ou 2565-5017 para acesso direto

HISTÓRICO DE REVISÃO

Data	Versão	Descrição
30/08/2019	1.0	Versão inicial

1 INTRODUÇÃO

Para a execução dos cenários, é necessário solicitar a B3, a criação da conta de intermediação no Sincad através do atendimento de Certificação

2 PRÉ-REQUISITOS

Os pré-requisitos necessários ao ambiente são os seguintes:

- Acesso a infraestrutura do ambiente de Certificação;
- Usuários comuns e de serviço do ambiente de Certificação válidos e ativos;
- Sessões de SMP-ISO, SMP-ISO de Risco, SMP Legado para envio e recebimento de Mensagens;
- Secure Client Clearing, Secure Client de Risco e MTA para envio e recebimento de Arquivos;

3 CENÁRIOS

3.1 Alocação

Passo	Descrição	Resultado Esperado
1	<p>Pré-Condição</p> <p>1. Criar conta intermediação (9911217) no Sincad. 2. Fechar negócio entre conta do mercado no lado tomador e conta intermediação no lado doador. Automaticamente o negócio espelho será criado entre a conta intermediação no lado tomador e a conta captura no lado doador (Tela D+1).</p> <p>Teste</p> <p>1. Consulta de operação realizada em conta captura sem vínculo de repasse.</p>	<p>1. Tela: Participante consulta com sucesso informações de negócio capturado nas telas de Alocação.</p> <p>1. Mensagem: Participante recebe bvmf.145 com informação da operação realizada.</p> <p>Execução: PNP</p>
2	<p>Teste</p> <p>1. Inclusão de Alocação dentro da grade de alocação De: Conta Captura. Para: Parcial Conta Normal 1 Parcial Conta Normal 2. 2. Tela: Participante seleciona operação na tela Alocação do sistema RTC e realiza solicitação de inclusão de alocação. Mensagem: Participante envia bvmf.013 com solicitação de inclusão de alocação. OBS: <i>As grades de alocação dos devidos instrumentos e tipos de contas devem ser observadas.</i></p>	<p>2. Tela: Participante realiza com sucesso inclusão de alocação via tela do sistema RTC.</p> <p>2. Mensagem: Participante recebe em resposta do RTC mensagem bvmf.014 com status da alocação.</p> <p>Execução: PNP</p>

3.2 Posições

Passo	Descrição	Resultado Esperado
1	<p>Criação automática da intermediação para contratos de tela D+1.</p> <p>Pré-condição: que existam contratos de empréstimos utilizando os negócios de Alocação mencionados acima (tela D+1).</p> <p>Teste</p> <p>1. Em D+0, consulta das informações de posição de empréstimo de ativos em aberto. Validar atributo Broker Dealer Group ID.</p>	1. Tela: Consultas realizadas com sucesso.
2	<p>Criação manual da intermediação para contratos de registro.</p> <p>Pré-condição: que existam contratos de empréstimos de registro entre conta do mercado no lado tomador e conta intermediação no lado doador e também entre a conta intermediação no lado tomador e a conta captura no lado doador. Os contratos devem possuir mesma taxa, data de carência, data de expiração, válidos para liquidação antecipada e a soma das quantidades deve ser a mesma.</p> <p>Teste</p> <p>1. Acessar módulo Broker Dealer Group Management. 2. Realizar a criação da intermediação, selecionando contratos de ambos os lados cuja soma das quantidades é a mesma. 3. Validar os atributos em tela.</p>	1. Tela: Intermediação criada com sucesso.

3	<p>Manutenção da Intermediação – Liquidação Antecipada</p> <p>Pré-condição: que existam contratos vinculados em uma intermediação.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Participante tomador do mercado solicita a liquidação antecipada do contrato, quantidade total. – Tela ou por mensagem bvmf.131.01 2. Se custodiante diferente, este deve efetuar a aprovação da solicitação. – Tela ou por mensagem bvmf.138.01 3. Participante detentor da intermediação verifica que todos contratos dos investidores internos foram liquidados automaticamente. 	<ol style="list-style-type: none"> 1. Tela: Liquidação antecipada solicitada com sucesso. 2. Tela: Processo aceito com sucesso. <p>Mensagem bvmf.133.01 com status.</p> <ol style="list-style-type: none"> 3. Tela: Liquidação antecipada solicitada com sucesso.
4	<p>Manutenção da Intermediação – Liquidação Antecipada</p> <p>Pré-condição: que existam contratos vinculados em uma intermediação.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Participante tomador do mercado solicita a liquidação antecipada do contrato, quantidade parcial – Tela ou por mensagem bvmf.131.01 2. Se custodiante diferente, este deve efetuar a aprovação da solicitação. – Tela ou por mensagem bvmf.138.01 3. Participante detentor da intermediação deve selecionar os contratos que serão liquidados para permanecer com a intermediação casada. 	<ol style="list-style-type: none"> 1. Tela: Liquidação antecipada solicitada com sucesso. 2. Tela: Processo aceito com sucesso. <p>Mensagem bvmf.133.01 com status.</p> <ol style="list-style-type: none"> 3. Tela: Liquidação antecipada solicitada com sucesso.

5	<p>Manutenção da Intermediação – Renovação</p> <p>Pré-condição: que existam contratos vinculados em uma intermediação.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Participante tomador do mercado solicita renovação de contrato, quantidade total. – Tela ou por mensagem bvmf.130.01 2. Solicita que o doador que aprove no sistema a renovação do contrato. – Tela ou por mensagem bvmf.138.01 3. Solicitar a aprovação dos custodiantes. – Tela ou por mensagem bvmf.138.01 4. Após a aprovação, verifica no RTC se novo contrato foi criado. – Tela 5. Participante detentor da intermediação verifica que todos contratos dos investidores internos foram renovados automaticamente. 	<ol style="list-style-type: none"> 1. Tela: Renovação solicitada com sucesso. 2. Tela: Solicitação aprovada com sucesso. 3. Tela: Aprovações realizadas com sucesso. 4. Tela: Novo contrato gerado com sucesso. <p>Mensagem bvmf.133.01 com status.</p> <ol style="list-style-type: none"> 5. Renovação efetivada com sucesso.
6	<p>Manutenção da Intermediação – Renovação</p> <p>Pré-condição: que existam contratos vinculados em uma intermediação.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Participante tomador do mercado solicita renovação de contrato, quantidade parcial. – Tela ou por mensagem bvmf.130.01 2. Solicita que o doador que aprove no sistema a renovação do contrato. – Tela ou por mensagem bvmf.138.01 3. Solicitar a aprovação dos custodiantes. – Tela ou por mensagem bvmf.138.01 4. Após a aprovação, verifica no RTC se novo contrato foi criado. – Tela 5. Participante detentor da intermediação deve selecionar os contratos que serão renovados para permanecer com a intermediação casada. 	<ol style="list-style-type: none"> 1. Tela: Renovação solicitada com sucesso. 2. Tela: Solicitação aprovada com sucesso. 3. Tela: Aprovações realizadas com sucesso. 4. Tela: Novo contrato gerado com sucesso. <p>Mensagem bvmf.133.01 com status.</p> <ol style="list-style-type: none"> 5. Renovação efetivada com sucesso. 6. Nova intermediação será criada com os novos contratos, já a intermediação anterior continua válida com quantidades remanescentes.

7	<p>Manutenção da Intermediação – Troca de doador</p> <p>Pré-condição: que existam contratos vinculados em uma intermediação. Contratos que serão trocados devem possuir mesma taxa, data de expiração, válidos para liquidação antecipada e a soma das quantidades deve ser a mesma.</p> <p>Teste</p> <ol style="list-style-type: none">1. Acessar módulo Broker Dealer Group Management.2. Realizar a seleção dos contratos que serão substituídos, selecionando contratos antigos e novos cuja soma das quantidades é a mesma.3. Validar os atributos em tela.	1. Tela: Troca de doadores é realizada com sucesso.
---	---	--

3.3 Risco

Passo	Descrição	Resultado Esperado
1	<p>Monitor de Risco Intradiário – BTB via tela</p> <p>1. Consulta de atualização de risco na conta de intermediação no Monitor de Risco Intradiário após alocação de contrato padronizado de BTB tomador gerado via tela do BTB</p> <p>2. Consulta de atualização de risco na conta tomadora final no Monitor de Risco Intradiário após alocação de contrato padronizado de BTB tomador gerado via tela do BTB</p> <p>3. Consulta ao Relatório de Estratégia de Encerramento da Carteira e Relatório de Margem</p>	<p>- Tela: Participante consulta com sucesso informações de risco atualizado após captura dos negócios.</p> <p>- Mensagem: Participante recebe bvmf 102 com informação da operação realizada</p> <p>- Mensagem: Participante envia bvmf 085 solicitando detalhamento de risco calculado e recebe BVBG.032 com as informações atualizadas contendo mesmas informações visualizadas via tela</p>
2	<p>Monitor de Risco Intradiário – BTB via registro</p> <p>1. Consulta de atualização de risco na conta de intermediação no Monitor de Risco Intradiário após alocação de contrato padronizado de BTB tomador gerado via registro</p> <p>2. Consulta de atualização de risco na conta tomadora final no Monitor de Risco Intradiário após alocação de contrato padronizado de BTB tomador gerado via registro</p> <p>3. Consulta ao Relatório de Estratégia de Encerramento da Carteira e Relatório de Margem</p>	<p>- Tela: Participante consulta com sucesso informações de risco atualizado após captura dos negócios.</p> <p>- Mensagem: Participante recebe bvmf 102 com informação da operação realizada</p> <p>- Mensagem: Participante envia bvmf 085 solicitando detalhamento de risco calculado e recebe BVBG.032 com as informações atualizadas contendo mesmas informações visualizadas via tela</p>
3	<p>Simulador de Risco</p> <p>1. Realização de simulação de risco com cópia de portfólio de conta de intermediação que tenha contrato padronizado de BTB de gerado via tela do BTB e registro tomado e alocados a tomador final</p> <p>2. Consulta ao Relatório de Estratégia de Encerramento da Carteira e Relatório de Margem</p>	<p>- Tela: Participante consulta com sucesso informações de risco simulado.</p> <p>- Mensagem: Participante envia bvmf 108 solicitando detalhamento de risco simulado e recebe BVBG.036 com as informações atualizadas contendo mesmas informações visualizadas via tela</p>