

Perguntas e Respostas: Reunião de portas abertas com o Selic

| | | |
|-------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|
| 1. | Sobre a Plataforma | 3 |
| 1.1. | Não conhecemos a plataforma, como fazemos para começar a usar, acessar e testar?..... | 3 |
| 1.2. | O uso será obrigatório por todos os participantes em todas as operações?..... | 3 |
| 1.3. | O sistema terá custo de utilização?..... | 3 |
| 1.4. | Será efetuado contato com os vendedores de mercado? Existe alguma forma de apoiar esses fornecedores para ajudar o mercado?..... | 3 |
| 1.5. | Para as instituições que têm poucas operações, a melhor opção é utilizar a plataforma via Web para ficar aderente ao projeto?..... | 3 |
| 1.6. | Eu, como participante do Selic, já tenho cadastro para acesso a essa plataforma?..... | 3 |
| 1.7. | Se eu estiver doador no à vista, coloco minha oferta na plataforma para visualização dos participantes ou já devo entrar com os dados da contraparte? | 4 |
| 1.8. | Há estimativa para inclusão de gestores e administradores na plataforma?..... | 4 |
| 1.9. | Conseguem fazer uma análise comparativa entre o Pre-Matching e a SEL1611?..... | 4 |
| 2. | Sobre as funcionalidades da plataforma..... | 4 |
| 2.1. | No caso de definitivas, só estão sendo aceitas operações à vista? Há expectativa de prazo para as operações a termo?..... | 4 |
| 2.2. | Qual é o impacto no fluxo das definitivas entre o que é feito hoje e após a conclusão do projeto?..... | 4 |
| 2.3. | Haverá a possibilidade de importação em lote de operações para batimento via plataforma, como forma de contingência no caso de a API parar de funcionar?..... | 5 |
| 2.4. | Com relação aos lastros das compromissadas com o BC ou operações definitivas com LEJ por meio do BC, teremos o uso da plataforma? | 5 |
| 2.5. | Sobre o listar eventos: na definitiva ele só retorna eventos quando ambas as partes lançarem, correto? Na compromissada é igual?..... | 5 |
| 2.6. | No fluxo da compromissada, ao efetuar a especificação, o cessionário lança somente uma especificação com sua conta Selic e o cedente lança quantas forem o lastro dela. Está correto o entendimento? | 5 |
| 2.7. | Haverá uma tela de monitoração parecida com a IOS>DOC8?..... | 5 |
| 2.8. | Os números de comando na plataforma só serão gerados caso o cedente não informe? ... | 5 |
| 2.9. | Após uma especificação ser alterada, o que acontece se ela já tiver a confirmação da contraparte? | 6 |
| 2.10. | O Pre-Matching fará validação da quantidade de custódia e de financeiro?..... | 6 |

| | | |
|-------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|
| 2.11. | A plataforma Pre-Matching tem um histórico para consulta para fins de auditoria, por exemplo? Como teoricamente substitui o callback, seria importante, não?..... | 6 |
| 2.12. | Para inclusão do negócio no Pre-Matching, usamos o ISelic das pontas. No caso de a contraparte ser um fundo, devo incluir o ISelic do participante ou o ISelic do liquidante do fundo? | 6 |
| 3. | Sobre a integração da plataforma com o Selic | 6 |
| 3.1. | Futuramente haverá a possibilidade de o batimento estar integrado com a liquidação e após a operação ser batida ela seguir direto para o Selic para liquidação? | 6 |
| 3.2. | Se o batimento no Pre-Matching estiver pronto, é só registrar no Selic e a operação não dará problema. É isso? | 7 |
| 4. | Sobre os testes na plataforma | 7 |
| 4.1. | Como saber quais participantes estão utilizando o Pre-Matching? Existirá uma API para prover essas informações? | 7 |
| 4.2. | As instituições participantes vão apoiar os testes? | 7 |
| 4.3. | É possível, no ambiente de homologação, criar um outro participante fictício, além do que já tenho acesso, para conseguir corresponder um lançamento e seguir todo o fluxo? | 7 |
| 4.4. | Existe algum roteiro de teste para homologação? | 7 |

1. Sobre a Plataforma

1.1. Não conhecemos a plataforma, como fazemos para começar a usar, acessar e testar?

Para conhecer melhor o Pre-Matching, indicamos o link <http://anbi.ma/pm11>, que fala sobre o lançamento da plataforma, além dos manuais de uso e de integração com a ferramenta disponíveis [no site do BC](#). Mais informações podem ser obtidas com a área de relacionamento com o mercado do Selic por meio do informe.selic@bcb.gov.br ou pelo telefone 0800 2001054.

1.2. O uso será obrigatório por todos os participantes em todas as operações?

O uso da plataforma não é obrigatório, mas entende-se que a adesão pela maioria dos participantes é imprescindível para o sucesso da ferramenta.

1.3. O sistema terá custo de utilização?

Não haverá custo adicional para utilização da plataforma para quem é participante do Selic.

1.4. Será efetuado contato com os vendedores de mercado? Existe alguma forma de apoiar esses fornecedores para ajudar o mercado?

O Selic somente se relaciona com os participantes do mercado, portanto as solicitações para apoio aos vendedores devem chegar por meio desses participantes. Qualquer solicitação pode ser encaminhada pelo participante para a área de relacionamento do Selic com o mercado por meio do informe.selic@bcb.gov.br ou pelo telefone 0800 2001054.

1.5. Para as instituições que têm poucas operações, a melhor opção é utilizar a plataforma via Web para ficar aderente ao projeto?

Sim, para instituições financeiras de menor porte, a plataforma Web, assim como a IOS, é a opção mais adequada para uso do sistema.

1.6. Eu, como participante do Selic, já tenho cadastro para acesso a essa plataforma?

O acesso não é automático. É necessário que o usuário esteja cadastrado no sistema Logon e adicionalmente possua o perfil de acesso para utilização da plataforma. Se houver qualquer dúvida, basta contatar a área de relacionamento do Selic com o mercado por meio do informe.selic@bcb.gov.br ou pelo telefone 0800 2001054.

1.7. Se eu estiver doador no à vista, coloco minha oferta na plataforma para visualização dos participantes ou já devo entrar com os dados da contraparte?

Essa não é uma plataforma de negociação. O objetivo do Pre-Matching é otimizar a troca de informações no pós-trade, antes de ser efetuado o registro no Selic. Após o negócio fechado, ele é registrado na plataforma para que possam ser realizadas as etapas de especificação e batimento.

1.8. Há estimativa para inclusão de gestores e administradores na plataforma?

Foi definido, com a comissão operacional Selic, que as primeiras entregas da plataforma seriam as operações definitivas e compromissadas, sem considerar os gestores e administradores. No escopo inicial está também a alocação 1:N, prevista para abril/20 em ambiente de homologação. A discussão sobre a inclusão dos gestores e administradores na plataforma será levada à comissão após essas entregas, quando será proposto um cronograma.

1.9. Conseguem fazer uma análise comparativa entre o Pre-Matching e a SEL1611?

A plataforma de Pre-Matching tem o objetivo de facilitar a troca de informações necessárias no pós-trade, antes do registro no Selic. A SEL1611 é utilizada para informar à contraparte que uma operação foi registrada no Selic e pode ser correspondida.

2. Sobre as funcionalidades da plataforma

2.1. No caso de definitivas, só estão sendo aceitas operações à vista? Há expectativa de prazo para as operações a termo?

Sim, até o momento foram implementados os fluxos para operações definitivas e compromissadas à vista. Mas o projeto prevê a implantação das operações a termo, que serão priorizadas conforme a utilização da ferramenta seja ampliada pelo mercado. Ainda não há expectativa de prazo para as operações a termo, mas a ideia é que a plataforma seja adequada ao dia a dia dos participantes conforme a necessidade, de forma a atender às expectativas das instituições.

2.2. Qual é o impacto no fluxo das definitivas entre o que é feito hoje e após a conclusão do projeto?

Atualmente as trocas de informação para especificação e alocação de contas são efetuadas basicamente por telefone ou e-mail. Com a utilização da plataforma de Pre-Matching, essas trocas serão automatizadas, otimizando o tempo entre o fechamento do negócio e o registro das operações no Selic.

Em relação ao que já foi entregue, nenhuma funcionalidade será modificada. Serão efetuadas evoluções, como o Chinese Wall e a alocação 1:N para operações definitivas, previstas para abril/20, sem impacto no que já está em funcionamento.

2.3. Haverá a possibilidade de importação em lote de operações para batimento via plataforma, como forma de contingência no caso de a API parar de funcionar?

A plataforma não prevê, até este momento, mecanismos de contingência.

2.4. Com relação aos lastros das compromissadas com o BC ou operações definitivas com LEJ por meio do BC, teremos o uso da plataforma?

O BC está estudando a integração dos seus sistemas com a plataforma de Pre-Matching.

2.5. Sobre o listar eventos: na definitiva ele só retorna eventos quando ambas as partes lançarem, correto? Na compromissada é igual?

O sistema foi ajustado e, quando um negócio é lançado contra um participante, este participante sempre recebe um evento de “negocio_lançado”. Isso ocorre tanto para definitiva quanto para compromissada. Os eventos podem ser consultados no manual de APIs do Pre-Matching, disponível [no site do BC](#).

2.6. No fluxo da compromissada, ao efetuar a especificação, o cessionário lança somente uma especificação com sua conta Selic e o cedente lança quantas forem o lastro dela. Está correto o entendimento?

Correto.

2.7. Haverá uma tela de monitoração parecida com a IOS>DOC8?

Sim, a plataforma Web disponibilizará um painel para acompanhamento dos negócios e das especificações efetuadas pelas partes. O painel de negócios exibe os negócios registrados, os negócios aguardando lançamento da contraparte e os e os negócios lançados pelas contrapartes. O painel de especificações será entregue em maio/20, quando teremos visões sobre as várias etapas da especificação até que seja confirmada pelas partes.

2.8. Os números de comando na plataforma só serão gerados caso o cedente não informe?

Sim, caso o cedente ou cessionário não informe número de comando, será gerado um número de uma faixa do Selic reservada para essa finalidade.

2.9. Após uma especificação ser alterada, o que acontece se ela já tiver a confirmação da contraparte?

Sempre que ocorre uma alteração, a plataforma verifica se a especificação se manteve completa. Se sim, a especificação vai para o estado “Especificação completa”, devendo as duas partes confirmarem, mesmo que uma já o tenha feito anteriormente. Caso a especificação não se mantenha completa, o estado vai para “Em especificação”, retornando o fluxo para o passo inicial.

Via API, será gerado um evento para ambas as partes quando a especificação ficar no estado “Especificação completa”. A partir do evento, as partes conseguem identificar que há a necessidade de confirmação. Os eventos gerados pela API devem ser consultados no endpoint GET eventos pelos sistemas das instituições. A plataforma não envia mensagens. A comunicação é passiva.

2.10. O Pre-Matching fará validação da quantidade de custódia e de financeiro?

Não, o Pre-Matching faz apenas o batimento das informações fornecidas pelas instituições no pós-trade. Somente se verifica a validade das informações (conta existente, título existente, por exemplo). Validações de negócio serão efetuadas somente no Selic.

2.11. A plataforma Pre-Matching tem um histórico para consulta para fins de auditoria, por exemplo? Como teoricamente substitui o callback, seria importante, não?

No momento, a auditoria está disponível somente para usuários do BC, mas pode ser evoluída para uso das instituições.

2.12. Para inclusão do negócio no Pre-Matching, usamos o ISelic das pontas. No caso de a contraparte ser um fundo, devo incluir o ISelic do participante ou o ISelic do liquidante do fundo?

ISelic do participante sob o qual o fundo está cadastrado.

3. Sobre a integração da plataforma com o Selic

3.1. Futuramente haverá a possibilidade de o batimento estar integrado com a liquidação e após a operação ser batida ela seguir direto para o Selic para liquidação?

O Pre-Matching é uma ferramenta para automatizar a troca de informações que acontece após a negociação e antes do registro no Selic. Após a especificação e o batimento pelas partes envolvidas, a plataforma gera as informações das operações por meio de arquivo ou APIs, que

podem ser utilizadas para o registro pelos participantes, mas não haverá integração de forma direta. O objetivo é que sejam ferramentas independentes.

3.2. Se o batimento no Pre-Matching estiver pronto, é só registrar no Selic e a operação não dará problema. É isso?

Não necessariamente. O Pre-Matching não critica as regras de negócio, somente verifica se as informações são válidas. Uma operação batida na plataforma pode não passar no Selic. As únicas regras que a plataforma verifica são as de cadastro: conta existente, título válido.

4. Sobre os testes na plataforma

4.1. Como saber quais participantes estão utilizando o Pre-Matching? Existirá uma API para prover essas informações?

A ANBIMA está consolidando os participantes que já estão utilizando a plataforma e estejam disponíveis para testes com outras instituições. Basta entrar em contato com representacao@anbima.com.br para obter a lista completa ou solicitar a inclusão da instituição. Essa informação não será divulgada por meio de API.

4.2. As instituições participantes vão apoiar os testes?

A lista disponibilizada pela ANBIMA identificará os participantes dispostos a efetuar os testes com outros participantes e os contatos de cada instituição.

4.3. É possível, no ambiente de homologação, criar um outro participante fictício, além do que já tenho acesso, para conseguir corresponder um lançamento e seguir todo o fluxo?

Não há a possibilidade da criação de participantes fictícios no ambiente de homologação. É possível realizar todo o fluxo de lançamento, especificação e batimento com apenas uma instituição, em que ela é tanto parte quanto contraparte, utilizando contas distintas. Pode-se também consultar a lista dos participantes que já utilizam a plataforma para execução de testes completos.

4.4. Existe algum roteiro de teste para homologação?

Não há roteiros de testes previstos para os participantes, dadas as características específicas de cada instituição.