

Sistema Câmbio

Roteiro dos Testes de Homologação com o Mercado Interbancário

Versão 1.2

Sistema Câmbio	05/03/2012
Roteiro dos Testes de Homologação com o Mercado Interbancário	Versão 1.2

Sumário

1.	Introdução	3
1.1	Acompanhamento dos testes	3
1.2	Período de homologação	3
1.3	Comunicação com o Banco Central	3
1.4	Referências	3
2.	Fluxos e Mensagens	4
3.	Cenários	6
3.1	Contratação com câmara e tela cega	6
3.2	Contratação com câmara e sem tela cega	6
3.3	Contratação sem câmara	6
3.4	Contratação de arbitragem com parceiro no exterior	6
3.5	Contratação de arbitragem com parceiro no país	6
3.6	Contratações do Banco Central	6
3.7	Liquidação	6
3.8	Instruções de pagamento	7
3.9	Consulta a contratos de câmbio no mercado interbancário	7
3.10	Consulta a detalhamento de contrato interbancário	7
3.11	Consulta a posição de câmbio por moeda	7
3.12	Consulta a eventos de um dia	7
3.13	Consulta a contratos em ser	7
3.14	Incorporação de registros de operação cambial	8
3.15	Consulta a histórico de incorporações	8
3.16	Consulta a contratos da incorporação	8
3.17	Consulta a cadeia de incorporações de um contrato	8

Sistema Câmbio	05/03/2012
Roteiro dos Testes de Homologação com o Mercado Interbancário	Versão 1.2

Roteiro dos Testes de Homologação com o Mercado Interbancário

1. Introdução

O propósito deste documento é orientar os agentes de câmbio que operam no mercado interbancário nos testes de homologação de seus sistemas.

Os cenários de testes deverão ser os mais variados possíveis e representar situações reais e específicas de cada instituição, bem como situações excepcionais e de erro, sem se limitar aos cenários apresentados neste documento.

É importante salientar que as instituições financeiras envolvidas deverão se organizar para a realização de cenários que envolvam mais de uma instituição, inclusive os cenários com câmara.

Apesar de não ser alvo desta etapa de testes, os eventos do mercado primário também deverão ser testados, para que seja possível avaliar a implementação de funcionalidades que são influenciadas pelos dois mercados, tais como consultas de eventos, de contratos e de posição cambial.

1.1 Acompanhamento dos testes

Os testes deverão ser cuidadosamente acompanhados pelas instituições para certificação de que seus sistemas estejam corretamente implementados, inclusive no que diz respeito à interação com o mercado primário. As instituições deverão acompanhar todas as evidências dos testes executados, incluindo a posição cambial e os saldos dos contratos (a liquidar, liquidado e, no caso de operações do mercado primário, também os saldos cancelado, baixado e restabelecido). As mensagens de retorno (E, R1, R2 e R3) recebidas devem ser analisadas pelas instituições financeiras e o Banco Central deverá ser comunicado caso ocorra alguma situação não prevista.

1.2 Período de homologação

O período de testes de homologação será de 2/5/2012 a 22/6/2012.

Salvas alterações, a grade para o envio de mensagens pelas IF estará aberta, nos dias úteis:

- Das 12h às 18h, para eventos do mercado interbancário;
- Das 9h às 20h, para eventos do mercado primário;
- Das 9h às 20h, para serviços;
- Das 8h30 às 20h30, para consultas.

1.3 Comunicação com o Banco Central

A comunicação deverá se dar preferencialmente através do Mantis (ver “Modelo de uso do Mantis”).

Os telefones e e-mail devem ser usados como segunda opção de comunicação:

- Desig/Dicam: cambio@bcb.gov.br, (51) 3215-7305.
- Departamento de TI: (61) 3414-2156.

1.4 Referências

- Carta-Circular 3.526/11 divulgando os procedimentos de testes de homologação do Sistema Câmbio – Mercado Interbancário
- Mensagens do Grupo de Serviços CAM - Volume III do Catálogo de Mensagens e de Arquivos da RSFN
- Fluxo de Eventos, Fluxo de Operações, Dicionário de Campos, Dicionário de Tipos - Volume IV do Catálogo de Mensagens e de Arquivos da RSFN
- Documento de Orientação Técnica
- Manual técnico da RSFN
- Manual de Segurança da RSFN
- Página do Novo Sistema Câmbio

Sistema Câmbio	05/03/2012
Roteiro dos Testes de Homologação com o Mercado Interbancário	Versão 1.2

2. Fluxos e Mensagens

A tabela a seguir resume as mensagens que deverão ser testadas em cada fluxo de operação:

	Fluxo	Mensagens		
		Compradora / IF A	Vendedora / IF B	Câmara
1.	Contratação de interbancário sem câmara (Bacen não é parte)	CAM0009 CAM0009R1 CAM0009E CAM0010R2 CAM0055 CAM0005 CAM0005R1 CAM0005E	CAM0009R2 CAM0010 CAM0010R1 CAM0010E CAM0055 CAM0005R2	n/a
2.	Contratação de arbitragem com parceiro no exterior	CAM0012 CAM0012R1 CAM0012E		n/a
3.	Contratação de arbitragem com parceiro no país	CAM0013 CAM0013R1 CAM0013E CAM0014R2 CAM0055 CAM0005 CAM0005R1 CAM0005E	CAM0013R2 CAM0014 CAM0014R1 CAM0014E CAM0055 CAM0005R2	n/a
4.	Contratação com Câmara e “tela cega”	CAM0054 CAM0054R1 CAM0054E CAM0055	CAM0054 CAM0054R1 CAM0054E CAM0055	CAM0053 CAM0053R1 CAM0053E CAM0054R2 CAM0055
5.	Contratação com Câmara sem “tela cega”	CAM0006 CAM0006R1 CAM0006E CAM0007R2 CAM0008R2 CAM0055 CAM0005 CAM0005R1 CAM0005E	CAM0006R2 CAM0007 CAM0007R1 CAM0007E CAM0008R2 CAM0055 CAM0005R2	CAM0006R3 CAM0007R3 CAM0008 CAM0008R1 CAM0008E CAM0055 CAM0005R3
6.	Contratação conjugada Bacen x IF	CAM0011		n/a
7.	Contratação de interbancário via leilão	CAM0015		n/a
8.	Liquidação não automática de interbancário	CAM0016 CAM0016R1 CAM0016E		n/a
9.	Inclusão e atualização de instruções de pagamento	CAM0051 CAM0051R1 CAM0051E		n/a
10.	Consulta de contratos em ser	CAM0042 CAM0042R1 CAM0042E		n/a
11.	Consulta de eventos de um dia	CAM0043 CAM0043R1 CAM0043E		n/a

Sistema Câmbio	05/03/2012
Roteiro dos Testes de Homologação com o Mercado Interbancário	Versão 1.2

	Fluxo	Mensagens		
		Compradora / IF A	Vendedora / IF B	Câmara
12.	Consulta de detalhamento de contrato interbancário	CAM0044 CAM0044R1 CAM0044E		n/a
13.	Consulta de posição de câmbio por moeda	CAM0050 CAM0050R1 CAM0050E		n/a
14.	Consulta de instruções de pagamento	CAM0052 CAM0052R1 CAM0052E		n/a
15.	Consulta de contratos de câmbio no mercado interbancário	CAM0056 CAM0056R1 CAM0056E		
16.	Incorporação de registros de operação cambial	CAM0039 CAM0039R1 CAM0039E CAM0040R2 CAM0041	CAM0039R2 CAM0040 CAM0040R1 CAM0040E CAM0041	n/a
17.	Consulta a histórico de incorporações	CAM0047 CAM0047R1 CAM0047E		n/a
18.	Consulta a contratos da incorporação	CAM0048 CAM0048R1 CAM0048E		n/a
19.	Consulta a cadeia de incorporações de um contrato	CAM0049 CAM0049R1 CAM0049E		n/a

Sistema Câmbio	05/03/2012
Roteiro dos Testes de Homologação com o Mercado Interbancário	Versão 1.2

3. Cenários

A seguir, apresentamos uma relação não exaustiva de cenários do mercado interbancário de câmbio, que devem ser testados como IF compradora e como IF vendedora (ou IF A e IF B, ou IF incorporada e IF incorporadora), quando aplicável. Sugerimos, também, que os cenários sejam combinados sempre que possível, para criar novas situações.

3.1 Contratação com câmara e tela cega

1. Primeira confirmação vinda da compradora;
2. Primeira confirmação vinda da vendedora;
3. Expiração pela não confirmação da compradora;
4. Expiração pela não confirmação da vendedora;

3.2 Contratação com câmara e sem tela cega

1. Sem expiração;
2. Expiração pela não confirmação da vendedora, sem reativação.
3. Expiração pela não confirmação da vendedora, seguida de reativação.
4. Expiração pela não confirmação da câmara, sem reativação.
5. Expiração pela não confirmação da câmara, seguida de reativação.
6. Expiração pela não confirmação da vendedora, seguida de reativação e subsequente expiração pela não confirmação da câmara, sem nova reativação;
7. Expiração pela não confirmação da vendedora, seguida de reativação e subsequente expiração pela não confirmação da câmara, seguida de nova reativação.

3.3 Contratação sem câmara

1. Sem expiração;
2. Expiração pela não confirmação da vendedora, sem reativação.
3. Expiração pela não confirmação da vendedora, seguida de reativação.

3.4 Contratação de arbitragem com parceiro no exterior

- Contratação de arbitragem com parceiro no exterior;
- IF informa contratação de arbitragem no país na própria IF.

3.5 Contratação de arbitragem com parceiro no país

- Sem expiração;
- Expiração pela não confirmação da contraparte, sem reativação;
- Expiração pela não confirmação da contraparte, seguida de reativação.

3.6 Contratações do Banco Central

- Recebimento de contratação conjugada Bacen x IF;
- Recebimento de contratação de interbancário via leilão.

3.7 Liquidação

- Sem câmara (item 3.3);
- Arbitragem com parceiro no exterior (item 3.4);
- Arbitragem no país na própria IF (item 3.4);
- Arbitragem com parceiro no país (item 3.5);
- Contratação conjugada Bacen x IF (item 3.6);
- Contratação de interbancário via leilão (item 3.6);
- Contratos que foram incorporados de outra IF;
- Com câmara (itens 3.1 e 3.2; cenário de insucesso);
- Contratos de outra IF (cenário de insucesso);
- Contratos já liquidados (cenário de insucesso);
- Contratos do primário com mensagem de liquidação do interbancário (cenário de insucesso);
- Contratos do interbancário com mensagem de liquidação do primário (cenário de insucesso);

Sistema Câmbio	05/03/2012
Roteiro dos Testes de Homologação com o Mercado Interbancário	Versão 1.2

- Contratos que pertenceram à IF, mas foram incorporados por outra IF (cenário de insucesso);

3.8 Instruções de pagamento

- Inclusão;
- Atualização;
- Consulta.

3.9 Consulta a contratos de câmbio no mercado interbancário

- Sem filtros, retornando pelo menos um contrato de cada modalidade;
- A um contrato específico, com utilização do filtro “registro operação cambial”;
- A vários contratos, com utilização dos filtros “data movimento câmbio” e “hora início”.
- Retorno via MQ sem ultrapassar o limite de tamanho da mensagem;
- Retorno via MQ ultrapassando o limite de tamanho da mensagem;
- Retorno via PSTA;
- Retorno via FTP.

3.10 Consulta a detalhamento de contrato interbancário

- Contrato do mercado interbancário próprio;
- Contrato do primário (cenário de insucesso);
- Contrato de outra IF (cenário de insucesso).

3.11 Consulta a posição de câmbio por moeda

- Com contratos do primário e interbancário influenciando a posição cambial;
- Com contratos do interbancário ainda não confirmados;
- Sem filtro de moeda;
- Com filtro para Dólar;
- Com filtro para outra moeda.

3.12 Consulta a eventos de um dia

- Sem filtro, com eventos dos mercados primário e interbancário;
- Com pelo menos um evento de cada tipo no dia;
- Filtrados por “data evento câmbio”;
- Filtrados por “data movimento câmbio”;
- Filtrados por “tipo evento câmbio”;
- Filtrados por “tipo operação câmbio”;
- Filtrados por “código fato natureza”;
- Retorno via MQ sem ultrapassar o limite de tamanho da mensagem;
- Retorno via MQ ultrapassando o limite de tamanho da mensagem;
- Retorno via PSTA;
- Retorno via FTP.

3.13 Consulta a contratos em ser

- Sem filtro, com contratos dos mercados primário e interbancário;
- Filtrados por “tipo operação câmbio” igual a compra;
- Filtrados por “tipo operação câmbio” igual a venda;
- Retorno via MQ sem ultrapassar o limite de tamanho da mensagem;
- Retorno via MQ ultrapassando o limite de tamanho da mensagem;
- Retorno via PSTA;
- Retorno via FTP.

Sistema Câmbio	05/03/2012
Roteiro dos Testes de Homologação com o Mercado Interbancário	Versão 1.2

3.14 Incorporação de registros de operação cambial

- Somente contratos do mercado interbancário;
- Contratos dos mercados primário e interbancário;
- Incorporação parcial;
- Rejeição da IF incorporadora;
- Contratos que não pertencem à IF (cenário de insucesso);
- Contratos que já estão em processo de incorporação (cenário de insucesso);
- Contratos que já foram da IF, mas foram incorporados por outra IF (cenário de insucesso).

3.15 Consulta a histórico de incorporações

- Sem incorporação;
- Com incorporação parcial efetivada;
- Com incorporação ainda não aceita pela incorporadora;
- Com incorporação aceita pela incorporadora, mas ainda não aceita/rejeitada pelo Bacen;
- Com incorporação rejeitada pela incorporadora;
- Com incorporação rejeitada pelo Bacen;
- Retorno via MQ sem ultrapassar o limite de tamanho da mensagem;
- Retorno via MQ ultrapassando o limite de tamanho da mensagem;
- Retorno via PSTA;
- Retorno via FTP.

3.16 Consulta a contratos da incorporação

- Incorporação de que participou como incorporada;
- Incorporação de que participou como incorporadora;
- Incorporação de que não participou (cenário de insucesso);
- Incorporação inexistente (cenário de insucesso).

3.17 Consulta a cadeia de incorporações de um contrato

- De contrato próprio que nunca foi incorporado;
- De contrato que já foi seu;
- De contrato que incorporou para si.