

Modernização do Sistema Câmbio

IX Reunião do GT-Câmbio
São Paulo, 23 de setembro de 2011



Pauta

- Ajustes nas mensagens do primário – inclusão no catálogo na reunião do GT-mensagens de novembro.
- Ajustes nas mensagens e fluxos do interbancário - inclusão no catálogo na reunião do GT-mensagens de novembro.
- Entrada do sistema em produção: procedimentos.
- Alterações nas transações Pcams.
- Informativos.

Ajustes nas mensagens do primário

- Campo “Outras especificações”: Aumento de tamanho de 2.000 para 4.000 mil caracteres nos seguintes eventos: contratação, alteração, cancelamento, edição de contratação, edição de alteração e edição de cancelamento.
- CAM0057: Substituição do campo “CNPJ ou CPF Cliente” pelos campos “CNPJ Base Cliente” ou “CPF Cliente” para adequar a mensagem ao critério de pesquisa pelo CNPJ 8 posições do exportador.
- CAM0021: Alteração da observação:
 - 1 - Esta mensagem também será utilizada para o ajuste diário de posição relativo às operações ~~previstas no RMCCI 1.3.2.2~~ realizadas por correspondentes.

Ajustes nas mensagens e fluxos do interbancário

Premissas:

- Registro de operação cambial: número único.
- Cada contrato do mercado interbancário possui um evento de contratação e um evento de liquidação próprios.
- Operação do interbancário com câmara: um registro de operação cambial, quatro contratos, quatro eventos de contratação e quatro eventos de liquidação.
- Operação do interbancário sem câmara: um registro de operação cambial, dois contratos, dois eventos de contratação e dois eventos de liquidação.
- Operação de arbitragem com parceiro no exterior ou na própria IF: dois registros de operação cambial, dois contratos, dois eventos de contratação e dois eventos de liquidação.
- Operação de arbitragem no país: dois registros de operação cambial, quatro contratos, quatro eventos de contratação e quatro eventos de liquidação.

Ajustes nas mensagens e fluxos do interbancário

Interbancário com clearing e com tela cega:

- CAM0054R1: O campo “Número Sequência Evento Câmbio Contratação” teve sua multiplicidade alterada para [0..1] pois não será enviado na mensagem referente à primeira confirmação.

Ajustes nas mensagens e fluxos do interbancário

Interbancário com clearing e sem tela cega:

- CAM0006R1 e CAM0006R2: Exclusão dos campos “Número Sequência Evento Câmbio Contratação” e “Número Sequência Evento Câmbio Liquidação”, que serão informados na mensagem CAM0008R2.
- Inclusão da mensagem CAM0006R3: Estrutura semelhante à da mensagem CAM0007R3, porém contendo os dados do contrato da câmara com a instituição compradora.
- CAM0008R2: Inclusão dos campos “Número Sequência Evento Câmbio Contratação” e “Número Sequência Evento Câmbio Liquidação”. O fluxo prevê que ela deve ser enviada duas vezes, sendo uma vez para a instituição compradora e outra vez para a instituição vendedora, com a informação correspondente para cada IF.

Ajustes nas mensagens e fluxos do interbancário

Contratação conjugada BC:

- CAM0011: Inclusão do campo “Identificador Leilão”.

Contratação de interbancário via leilão:

- CAM0015: Inclusão do campo “Identificador Leilão” e criação do “Grupo Exterior”.

Ajustes nas mensagens e fluxos do interbancário

Arbitragem com parceiro no exterior ou no país na própria IF:

- CAM0012: Os campos “Data Entrega Moeda estrangeira” e “Código Forma Entrega Moeda” foram movidos para o “Grupo Contratação”.

Ajustes nas mensagens e fluxos do interbancário

Arbitragem com parceiro no país:

- CAM0013 e CAM0013R2: os campos “Valor Moeda Nacional”, “Data Liquidação”, “Código Fato Natureza”, “Código Cliente Natureza”, “Indicador Aval Natureza”, “Código Pagador ou Recebedor Exterior Natureza” e “Código Grupo Natureza” foram movidos para fora do “Grupo contratação”.
- CAM0013R2: as instruções de pagamento foram movidas para fora do “Grupo contratação” e compatibilizadas com os campos cadastrados.
- CAM0014R2: “Grupo Exterior” passou a ser obrigatório.

Ajustes nas mensagens e fluxos do interbancário

Arbitragem no país com o BC iniciando o processo:

- CAM0020: os campos “Valor Moeda Nacional”, “Data Liquidação”, “Código Fato Natureza”, “Código Cliente Natureza”, “Indicador Aval Natureza”, “Código Pagador ou Recebedor Exterior Natureza” e “Código Grupo Natureza” e as as instruções de pagamento foram movidas para fora do “Grupo Contratação”.

Consulta contratos em ser:

- CAM0042: Inclusão do campo “Data Liquidação”, utilizado para as operações do interbancário, na mensagem de resposta CAM0042R1 como opção ao campo “Data Limite Liquidação”, utilizado no mercado primário.

Ajustes nas mensagens e fluxos do interbancário

Outras questões do Interbancário:

- Código Cliente Natureza: será criado um novo código de cliente para o Interbancário, a ser incluído no RMCCI.

Entrada em Produção: procedimentos

- Dia 30 de setembro, abertura: conformidade do dia 29.
- Dia 30 de setembro, 19:00h: bloqueio das PCAMs de registro de contratação de operações e de conformidade.
- Grade não será prorrogada.
- Até dia 30 de setembro: migração da posição (confirmação pelas IFs e liberação do Desig).
- Dias 1 e 2 de outubro: verificação do funcionamento em produção (consultas CAM0050 e CAM0057e grade de horário) e plantão.



Entrada em Produção: procedimentos

- Dia 3 de outubro, abertura da grade padrão (RMCCI):
 - ✓ i. registro dos eventos de câmbio no mercado primário:
abertura: 9h – fechamento: 19h
 - ✓ ii. Consultas e serviços disponíveis no Sistema Câmbio :
abertura: 8h – fechamento: 21h
- IFs: conferir respostas e apontar eventuais inconsistências .
- BCB: acompanhar desempenho.



Entrada em Produção: contingência de implantação

- PSTA
- Grade de exceção: “em situação de excepcionalidade e mediante comunicação ao mercado, o Desig pode estabelecer grade de exceção para registro de eventos de câmbio do mercado primário.” (RMCCI 1-3-2-1)
- “O registro de operações de câmbio em dia diverso do movimento somente será admitido para as situações de que trata o item 6 desta subseção, ressalvadas as soluções de contingência do Sistema Câmbio ou as situações decorrentes de fatores alheios à vontade das instituições autorizadas a operar no mercado de câmbio’. (RMCCI 1-3-2-1)

Alterações nas transações Pcams

- Pcam300 – registro de operações;
- Pcam500 – registro de operações valorizadas;
- Pcam310 – Res. 3.568/2008, cadastramentos;
- Pcam415 – performance do exportador;
- Pcam410/460 – consulta posição de câmbio;
- Pcam470/480 – resumo de operações a confirmar;
- Pcam700 - corretoras – contratação de operações de câmbio;
- Pcam800/810 – conformidade;
- Pcam950 – implantação no sistema câmbio;
- Pcam970 – registro de dados antes da implantação.

Informativos

- Interbancário em desenvolvimento desde abril.
- Ajustes nas mensagens: homologação pelo GT-Mensagens em novembro.
- Testes com voluntários: janeiro/12 (versão 3.05 do catálogo - fluxos envolvendo câmara).
- Publicação da Carta-Circular para homologação: nov/11.
- Publicação da Circular para atualizar RMCCI: abril/12.
- Agenda: X Reunião do GT-Câmbio - dia 4 de novembro.
 - ✓ Interbancário
 - ✓ Testes com voluntários

FIM

Modernização do
Sistema
Câmbio