

FAQ

TESTE DE CAPACIDADE
PÓS NEGOCIAÇÃO



Questão	Resposta
Para os testes dos indicadores de empréstimo, podemos usar o ambiente de certificação para executar as operações e receber mensagens, mesmo sem o suporte da B3 (mantendo o ambiente em funcionamento)?	O ambiente de certificação tem caráter funcional e não está preparado para testes de capacidade, desta forma, não deve ser utilizado.
Os testes de capacidade da pós-negociação são aplicáveis para quais instituições?	Os testes de capacidade da pós-negociação são aplicáveis para as instituições que atuam nas categorias Participante de Negociação Pleno (“PNP”), Participantes de Liquidação (“PL”) e Agentes de Custódia (“ACST”), que atendam clientes institucionais e varejo, no Segmento Listado B3.
Quais os canais de consulta podem ser utilizados em 2023?	Para dúvidas técnicas está disponível o e-mail liquidacao.certifica@b3.com.br . Dúvidas sobre a auditoria da BSM, poderão ser esclarecidas por meio do e-mail auditoria@bsmsupervisao.com.br ou telefone (11) 2565-6200, opção “3”.
Haverá <i>workshop</i> sobre testes de capacidade em 2023?	Não está previsto a realização de <i>workshop</i> relacionado a esse assunto para 2023.
Qual o prazo para a realização dos testes de capacidade em cenário de estresse para a pós-negociação? E o prazo para envio dos relatórios de teste de capacidade?	Os testes de capacidade em cenário de estresse da pós-negociação, devem ser realizados e documentados em 2023. A auditoria da BSM será realizada em 2024. Os relatórios de teste de capacidade devem ser enviados mediante solicitação da BSM.
O Participante deve enviar o Plano de Continuidade de Negócios em conjunto com os relatórios de teste de capacidade?	Não, caso seja necessária qualquer documentação adicional será solicitada sob demanda.
O Participante deve desenvolver o injetor para geração da massa de dados que será utilizada no teste para os sistemas internos, incluindo o sistema Sinacor?	Sim, o Participante é o responsável pela construção do ambiente para testes, bem como seus injetores/ <i>mocks</i> , incluindo o sistema Sinacor. Não será possível a utilização do ambiente de certificação, dado que sua natureza é funcional e não de capacidade.
A B3 e a BSM indicam empresas capazes de desenvolver esses injetores e <i>engines</i> de apuração dos indicadores?	Não indicamos. Sugerimos contatar sua área de desenvolvimento interno e/ou Fornecedores.

Qual é o período base para definição do pico?	No primeiro teste o Participante deverá utilizar o maior pico apurado para cada indicador desde janeiro de 2020. Nos testes dos anos seguintes o Participante deverá realizar a apuração do pico desde a data do último teste, compará-lo com o último pico utilizado no teste anterior e realizar o teste com o maior valor apurado entre eles. Para situações envolvendo mudança significativa no volume de clientes (por exemplo, venda de carteira de clientes), o Participante pode documentar a situação e optar por utilizar o pico apurado desde a data de ocorrência da mudança significativa.
Como o Participante deve definir o incremento?	O incremento deve ser definido pelo Participante de acordo com critérios internos, como por exemplo, expectativa de crescimento da base de clientes. Não há um valor ou percentual mínimo de incremento.
Caso não exista histórico do pico de mensagens, podemos considerar o maior dia de negócios como o dia de maior volatilidade?	O maior dia de negócios tende a ser o maior dia de alocação, entretanto pode ocorrer, por exemplo, de um negócio recebido (1 mensagem bvmf.012 recebida) gerar a alocação em diversas contas diferentes (“x” mensagens bvmf.013 enviadas). Neste caso, sugerimos que seja feita uma relação entre o dia de maior pico e seu método operacional usual, para determinar os picos de mensagens correspondentes.
O Sinacor realizará testes de capacidade que poderão ser aplicados a todos os Participantes?	Não, os picos e incrementos dos Participante são individuais e variam de acordo com seu modelo de negócio e estimativas específicas, desta forma, cada Participante deve realizar seus próprios testes de capacidade com base na sua volumetria e seu ambiente de testes.
Será disponibilizado um modelo de relatório para os testes?	Sim, no site da BSM será disponibilizado um modelo de relatório (“ <i>template</i> ”) para os testes. Sua utilização pelo Participante é opcional.
Qual o escopo mínimo para o relatório de teste de capacidade em 2023?	Para o ano de 2023 devem ser realizados ao menos os 6 (seis) indicadores mínimos apresentados no <i>webinar</i> “Teste de capacidade da infraestrutura de pós-negociação em cenário de estresse” (https://www.bsmsupervisao.com.br/publicacoes-e-eventos/treinamentos-e-workshops). Os demais indicadores apresentados no <i>webinar</i> não são obrigatórios e podem ser realizados a critério dos Participantes.
O Sinacor já possui histórico de testes?	Os testes de indicadores mínimos referentes ao ano de 2022 não foram realizados para o Sinacor.
Os indicadores de capacidade de processamento, envio e recebimento devem ser mensurados por meio da aplicação da corretora?	A aplicação deve demonstrar que foi capaz de processar os indicadores determinados (pico mais incremento). Esta demonstração deverá ser feita através de evidências (<i>prints</i> de tela, <i>logs</i> da aplicação, consultas de banco de dados) que possam ser interpretados pela equipe da BSM.
É necessário executar testes de <i>stress</i> com o pico máximo de negócios, durante 10 (dez) minutos?	Não, o teste abrange apenas o tratamento do indicador em um dia.

O teste será desconectado do RTC?	A comunicação do ambiente de teste do participante e sua aplicação será feita apenas com os injetores/ <i>mocks</i> que deverão simular o RTC, ou seja, o RTC não deve estar integrado.
-----------------------------------	---