

FAQ

TESTE DE CAPACIDADE



Agosto

V. 1.1

Perguntas	Resposta
Qual o período que o Participante deve reter os logs e demais documentações de execução do teste de capacidade?	O Participante deve manter, pelo prazo mínimo de 5 (cinco) anos, ou por prazo superior por determinação expressa da CVM, todos os documentos e informações exigidas, conforme previsto no artigo 48 da resolução CVM 35/2021.
Como deve ser realizado o teste do indicador III, de negociação de dados privados?	Para o indicador III de dados privados, o Participante/Fornecedor deve simular a conexão simultânea de clientes. O cenário simulado deve refletir o pico de clientes simultaneamente conectados, com um incremento de clientes em percentual definido pelo Participante/Fornecedor, com execução de transações (por exemplo, envio de ordens) por minuto, repetindo a simulação por 10 minutos consecutivos. Exemplo: Em uma situação hipotética de um teste com 500 clientes conectados simultaneamente (sendo 250 o pico, com incremento de 100%), dentro de 1 minuto cada um dos clientes conectados devem enviar ao menos 1 ordem. Sendo esse cenário repetido durante 10 minutos consecutivos, ao final dos 10 minutos teríamos ao menos 5000 ordens enviadas.
O que é esperado do Participante para atendimento do indicador IV?	No indicador IV de dados privados é esperado que seja apurada, no mínimo, a latência máxima das ordens nos cenários de estresse durante os testes dos indicadores I, II e/ou III. E ainda, que o número apurado seja avaliado e/ou comparado com uma latência esperada, definida previamente pelo Participante. Lembrando que para o cálculo da latência deve ser considerado o intervalo de tempo entre o recebimento da ordem pelo intermediário e o envio da ordem para a B3, e entre o recebimento dos retornos dos status da ordem pelo intermediário e o envio ao investidor. Além disso, caso o Participante seja do segmento varejo, a latência máxima esperada pode ser a mesma divulgada no SLA publicado e a conclusão do indicador IV pode servir de insumo para comparação e eventual ajuste do valor (SLA) de latência máxima de envio de ordens publicado aos clientes para cumprimento dos Ofícios 3 e 6/2020-CVM/SMI
O relatório emitido por fornecedor que realizou testes em sua infraestrutura pode ser utilizado por Participante que possui a ferramenta na estrutura própria?	O Participante pode utilizar testes de capacidade em cenário de estresse realizados pelo fornecedor desde que (i) a ferramenta seja a mesma (incluindo versão do software); (ii) o volume testado (pico mais incremento) seja igual ou superior ao volume aferido (pico mais incremento) pelo Participante; e (iii) a infraestrutura utilizada no teste pelo fornecedor seja igual ou inferior à infraestrutura de produção do fornecedor (comparação mínima considerando CPU, memória e disco).
Pode ser utilizado o racional de proporcionalidade para o teste de capacidade?	Sim, o racional de proporcionalidade pode ser utilizado desde que a ferramenta seja a mesma (incluindo a versão do software) e a infraestrutura tenha as mesmas características, ou seja, se o ambiente de produção possui tamanho 2X para processar um volume (pico mais incremento) de 2X dados, pode ser utilizado ambiente de homologação com tamanho X para processar um volume de X dados. Esse racional deve estar descrito na documentação contemplando as evidências dos ambientes. Cabe destacar que não é aceito o racional de extrapolação, ou seja, caso seja processado um volume de X dados por minutos, não é possível inferir que em 2X minutos serão processados 2X dados.

O teste de negociação precisa ser realizado por completo em um dia? A simulação de <i>Market Data</i> deve ser feita no mesmo dia?	O teste de capacidade não precisa necessariamente ser realizado de maneira completa no mesmo dia. No entanto, cada indicador precisa ser avaliado dentro do mesmo dia (considerando o tempo máximo de 1 pregão). Assim, a avaliação de diferentes indicadores pode ser distribuída em dias distintos.
Qual o pico que deve ser considerado para realização dos testes a cada ano? O pico do ano ou o maior pico entre o ano atual e anos anteriores.	O Participante/Fornecedor deve 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 atual com o maior valor apurado. 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.
O número de clientes da simulação deve ser o dobro do número de clientes que estavam conectados simultaneamente no período escolhido ou deve ser o dobro do total de clientes cadastrados?	A simulação deve ser realizada com o pico de clientes simultaneamente conectados desde 2020 ou do último teste de capacidade com a adição de um incremento a ser definido pelo Participante. Cabe ressaltar que o teste do indicador III prevê a utilização de clientes conectados com transação. Caso não seja possível aferir a quantidade máxima de conexões simultâneas, o responsável pelo teste deve levantar o pico de quantidade de clientes que se conectaram ao longo de um dia e utilizar como pico, e na sequência definir um incremento.
Existe algum formato em que os resultados devem ser apresentados?	Não há um formato obrigatório para a documentação do teste de capacidade. No entanto, foi divulgado no site da BSM (https://www.bsmsupervisao.com.br/Noticias/2022-07-modelo-rel-testecapacidade) um modelo (“ <i>template</i> ”) que pode ser utilizado para documentar o teste ou pode ser utilizado como um <i>checklist</i> para avaliar a completude da documentação.
Caso o Participante utilize solução de <i>Market Data UMDF Conflated</i> , qual pico de dados deve ser considerado?	Atualmente o número de mensagens observadas no pico histórico é: BM&F – 84M Bovespa – 209M Total – 294M Cabe ressaltar que, conforme norma estabelecida, o teste de capacidade deve ser realizado com, no mínimo, duas vezes esses valores. Os valores atualizados são divulgados no endereço https://www.b3.com.br/pt_br/solucoes/plataformas/puma-trading-system/para-desenvolvedores-evendors/umdf-sinal-de-difusao/
Qual escopo de sessões a serem avaliadas no teste de capacidade?	Atualmente o escopo auditado do teste de capacidade contempla apenas os sistemas de negociação e <i>Market Data</i> que contenham sessões de negociação utilizada por clientes (DMA).
Caso o OMS do Participante só possua uma conexão ativa utilizada para receber as ordens encaminhadas por plataforma fora do país, como o responsável pelo teste deve proceder?	Caso o sistema de negociação testado não realize conexão direta com os clientes, utilizando apenas uma conexão para recebimento das ordens FIX, o Participante/Fornecedor deve formalizar tal situação na documentação do teste de capacidade e avaliar o indicador III como “não aplicável”. Para outros cenários em que o sistema de negociação não realize a conexão direta com os clientes mas crie instâncias de estratégias inseridas pelos clientes, o Participante/Fornecedor deve realizar o teste do indicador III. Nesses casos, o teste pode ser realizado da mesma forma, mas utilizando a criação de estratégias simultâneas, com transação (envio de ordens) ao invés da conexão simultânea de clientes.
Com qual frequência deve ser realizado o teste de capacidade?	Conforme esclarecido no comunicado externo CE 005/2021-PRE, o Participante deve realizar testes de estresse no mínimo anualmente, com o estabelecimento de planos de ação quando identificadas situações nas quais um aumento de demanda possa inviabilizar o processamento das operações.

O resultado do teste de capacidade deve ser compartilhado e aprovado pela Alta Administração?

Atualmente não há exigência em norma, no entanto, é recomendado o compartilhamento e aprovação da alta administração para os resultados do teste de capacidade em cenário de estresse.