



BRASIL
BOLSA
BALCÃO

UMDF PUMA BINÁRIO

Roteiro de Certificação

Versão: 1.1
Última modificação:
30/03/2023

Contato

Trading Certification

- tradingcertification@b3.com.br
- +55 11 2565-5023

Conteúdo

Histórico de Revisão.....	4
1. Prefácio	5
2. Pré Requisitos	6
3. Glossário.....	7
4. Cenários de Teste.....	8
A. Mensagens de Sessão.....	9
B1. Pré-Abertura	10
B2. Mercado Aberto.....	11
B3. Leilão Especial.....	12
B4. Mercado em Pausa	12
B5. Final Closing Call	13
B6. After Market	14
C. Estratégia Definida pelo Usuário (UDS)	15

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição	Autor
30 de março de 2023	1.1	- Atualização dos passos para contemplar os novos procedimentos do SBE	Trading Certification
26 de janeiro de 2023	1.0	- Criação do documento	Trading Certification

1. Prefácio

Este documento descreve uma série de testes que qualificam *vendors* a conectar-se à B3 com o propósito de solicitar e receber dados de mercado (*market data*) nos segmentos de Ações e Derivativos via protocolo SBE.

O SBE é uma especificação técnica para a comunicação eletrônica de mensagens de negócio. É um padrão aberto, mantido por membros da FIX Protocol Ltd. (www.fixprotocol.org/).

2. Pré requisitos

Os cenários de testes deverão ser executados sequencialmente.

Todas as mensagens devem seguir o padrão especificado no documento “MARKET DATA B3: BINARY UMDF Messaging Specification Guidelines – Version 1.5.4, disponível para download no site da B3:

<https://clientes.b3.com.br/data/files/53/A6/A6/A2/DB0F68103189BD68180808FF/BinaryUMDF-MessageSpecificationGuidelines-v.1.5.4.pdf>

3. Glossário

MBO	Mercado Por Oferta
UDS	Estratégia Definida pelo Usuário
MOA	Market On Auction
MOC	Market On Close
ETF	Exchange Traded Funds (Fundos de Índices)

4. Cenários de Teste

Este Roteiro de Certificação está estruturado de acordo com as Fases do Pregão durante um dia regular de negociação, incluindo uma sessão de After Market. O Roteiro de Certificação se inicia com o preço de fechamento para o instrumento escolhido e há incrementos de acordo com o tick de preço. A sequência de execução deve ser seguida do início ao fim dos testes. Qualquer circunstância imprevista, que possa instabilizar ou inviabilizar o uso da aplicação, requer o reinício dos testes de conformidade.

A tabela abaixo descreve os cenários e seus objetivos neste Roteiro de Certificação.

Cenários	Objetivo
A. Mensagens do canal	Testar as mensagens SBE do canal.
B. Fases de Mercado	Testar Fases de Mercado e Estados de Instrumentos.
C. Estratégias	Receber mensagens de Market Data para UDS.

A. Mensagens de Canal

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
A.1	Conectar em algum canal e aguardar mensagem de Sequence.	Receber Mensagem de Sequence	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
A.2	Conectar no Instrument Definition e aguardar receber as mensagens de Security List.	Receber Mensagem de Security List	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

B1. Pré-Abertura

Disponível: Equities e Derivativos

Aguardar TRADING CERTIFICATION configurar Fase de Pré-Abertura

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
B1.1	Conectar ao canal escolhido de Snapshot.	Snapshot Full Refresh	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.2	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Compra 100@Preço de Fechamento.	Nova ordem de compra no 6º nível	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.3	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Preço de Fechamento	Novo topo do book de Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.4	TRADING CERTIFICATION envia MOA de Compra e ordem de Venda 100@Preço de Fechamento	Novo topo do book de Compra e 2º nível de Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.5	TRADING CERTIFICATION cancela ordens de Compra e Venda ao Preço de Fechamento	Deleção do 7º nível de Compra e 2º nível de Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B1.6	TRADING CERTIFICATION altera Fase do Pregão para ABERTO	Atualização de todos os níveis e negócio realizado ao Preço de Fechamento	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

B2. Mercado Aberto

Disponível: Equities e Derivativos

Aguardar TRADING CERTIFICATION configurar o instrumento Aberto

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
B2.1	Conectar ao canal escolhido de Snapshot.	Snapshot Full Refresh	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.2	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Compra 100@Preço de Fechamento	Novo 6º nível de Compra	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.3	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Melhor Preço.	Novo 3º nível na Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.5	TRADING CERTIFICATION cancela melhor ordem de venda	Novo topo do book na Venda.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.6	TRADING CERTIFICATION altera Estado do Instrumento para Reservado.	Recebe Security Status	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.7	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Preço de Fechamento.	Novo Topo do Book na Venda.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.8	TRADING CERTIFICATION altera o estado do instrumento para Aberto.	Incremental Refresh com novo Topo do Book na venda, negócios gerados e Delete From BID; Mudança no Security Status	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.9	TRADING CERTIFICATION envia 2 ordens de compra com Preço de fechamento + 1 tick.	Novo Topo do Book e 2º Nível na Compra.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.10	TRADING CERTIFICATION envia um Trade on Behalf.	Novo negócio	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.11	TRADING CERTIFICATION altera o estado do instrumento para CLOSED.	Receber Incremental Refresh com Delete From. Mudança no Security Status	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B2.12	TRADING CERTIFICATION altera o estado do instrumento para OPEN.	Mudança no Security Status	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

B3. Leilão Especial

Disponível: Equities

Aguardar TRADING CERTIFICATION configurar Leilão Especial

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
B3.1	TRADING CERTIFICATION configura o instrumento para Leilão Especial	Receber Security List.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B3.2	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Compra 100@Preço de Fechamento	Novo Topo do Book de Compra	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B3.3	TRADING CERTIFICATION envia nova Venda 100@Preço de Fechamento acrescido de um tick.	Novo Topo do Book de Venda	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B3.4	TRADING CERTIFICATION envia MOA na Compra	Novo Topo do Book de Compra sem preço	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B3.5	TRADING CERTIFICATION modifica preço de Venda	Novo Topo do Book de Venda	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B3.6	TRADING CERTIFICATION altera Estado do Instrumento para Aberto.	Novos negócios e Mudança no Security Status	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B3.7	TRADING CERTIFICATION envia ordens de Compra e Venda	Novo Topo do Book em ambos os lados	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B3.8	TRADING CERTIFICATION altera Fase do Pregão para Pause.	Mudança no Security Status	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

B4. Mercado em Pausa

Disponível: Equities e Derivativos

Aguardar TRADING CERTIFICATION configurar instrumento em Pausa

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
B4.1	Conectar ao canal escolhido de Snapshot.	Snapshot Full Refresh	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B4.2	TRADING CERTIFICATION cancela ordem de Compra	Receber Incremental Refresh com deleção de Compra	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B4.3	TRADING CERTIFICATION cancela ordem de Venda	Receber Incremental Refresh com deleção de venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B4.4	TRADING CERTIFICATION altera Fase do Pregão para PRE-CLOSE	Mudança no Security Status	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

B5. Final Closing Call

Disponível: Equities e Derivativos

Aguardar TRADING CERTIFICATION configurar o FCC

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
B5.1	Conectar ao canal escolhido de Snapshot.	Snapshot Full Refresh com tag e ordem MOC na compra.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B5.2	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Preço de Fechamento	Novo Topo do Book de Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B5.3	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Compra 100@Preço de Fechamento + 1 tick.	Novo 2º nível de Compra	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B5.4	TRADING CERTIFICATION altera quantidade em ordem de Venda	Aumento de quantidade na Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B5.5	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Preço de Fechamento	Novo 2º nível de Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B5.6	Encerramento do Final Closing Call	Novos negócios	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B5.7	TRADING CERTIFICATION altera Fase do Pregão para PRÉ-FECHAMENTO.	Mudança no Security Status	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

B6. After Market

Disponível: Equities e Derivativos

Aguardar TRADING CERTIFICATION configurar After Market e popular o book.

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
B6.1	Conectar ao canal escolhido de Snapshot.	Snapshot Full Refresh.	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B6.2	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Compra 100@Preço de Fechamento.	Nova ordem de Compra	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B6.3	TRADING CERTIFICATION envia nova ordem de Venda 100@Melhor preço.	Novo 3º nível na Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B6.4	TRADING CERTIFICATION deleta Topo de Book da Venda	Novo Topo de Book na Venda	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B6.5	TRADING CERTIFICATION envia ordem de Venda 100@Preço de Fechamento	Novo Topo do Book de Venda, Delete From na Compra e novos negócios	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B6.6	TRADING CERTIFICATION envia duas ofertas – Ordem de compra 100@Preço de fechamento e Ordem de compra 100@Preço de Fechamento + 1 tick.	Novo Topo do Book e 2º nível de Compra	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
B6.7	TRADING CERTIFICATION altera Estado do Instrumento para FECHADO	Incremental Refresh com Delete From; Mudança no Security Status	S	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E

C. Estratégia Definida pelo Usuário (UDS)

Disponível: Equities e Derivativos

Passo	Descrição	Resultado Esperado	Req	Status	
D4.1	TRADING CERTIFICATION cria nova UDS com duas patas	Receber Security List no canal de Opções referente à primeira pata.	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
D4.2	Assinar UDS criada	Receber Snapshot Full Refresh	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
D4.3	TRADING CERTIFICATION altera o estado do instrumento para RESERVADO	Mudança no Security Status	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
D4.4	TRADING CERTIFICATION envia ordem de compra para a UDS	Nova compra no Top do Book	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
D4.5	TRADING CERTIFICATION altera o estado para Aberto	Mudança no Security Status	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E
D4.6	TRADING CERTIFICATION envia ordem de venda para a UDS	Negócio fechado na UDS e patas	N	<input type="checkbox"/> Passou	<input type="checkbox"/> N/E